

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)
2015年半年度报告
2015年6月30日

基金管理人：国联安基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

1. 重要提示及目录

1.1. 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

自2015年3月23日国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力A和双力B份额终止上市起，原国联安双力中小板综指分级证券投资基金名称变更为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)。原国联安双力中小板综指分级证券投资基金报告期自2015年1月1日至2015年3月23日止，国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)报告期自2015年3月24日至2015年6月30日止。

1.2 目录

1. 重要提示及目录	2
1.1. 重要提示	2
2. 基金简介	6
2.1. 基金基本情况	6
2.1.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	6
2.1.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	6
2.2. 基金产品说明	7
2.2.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	7
2.2.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	7
2.3. 基金管理人和基金托管人	8
2.4. 信息披露方式	8
2.5. 其他相关资料	9
3. 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	9
3.1.1. 主要会计数据和财务指标	9
3.1.2. 基金净值表现	9
3.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	11
3.2.1. 主要会计数据和财务指标	11
3.2.2. 基金净值表现	12
4. 管理人报告	13
4.1. 基金管理人及基金经理情况	14
4.2. 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3. 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4. 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6. 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7. 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8. 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
5. 托管人报告	17
5.1. 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2. 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3. 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
6. 半年度财务会计报告(未经审计)	17
6.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	18
6.1.1. 资产负债表	18
6.1.2. 利润表	19
6.1.3. 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.1.4. 报表附注	21
6.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	43
6.2.1. 资产负债表	43
6.2.2. 利润表	44

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

6.2.3.	所有者权益（基金净值）变动表	46
6.2.4.	报表附注	47
7.	投资组合报告	64
7.1.	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF).....	64
7.1.1.	期末基金资产组合情况	64
7.1.2.	期末按行业分类的股票投资组合	65
7.1.2.1.	指数投资期末按行业分类的股票投资组合	65
7.1.2.2.	积极投资期末按行业分类的股票投资组合	65
7.1.3.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	66
7.1.3.1.	期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	66
7.1.3.2.	期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细.	76
7.1.4.	报告期内股票投资组合的重大变动	76
7.1.5.	期末按债券品种分类的债券投资组合	77
7.1.6.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	77
7.1.7.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	77
7.1.8.	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	77
7.1.9.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	77
7.1.10.	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	77
7.1.11.	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.1.12.	投资组合报告附注	78
7.2.	国联安双力中小板综指分级证券投资基金	79
7.2.1.	期末基金资产组合情况	79
7.2.2.	期末按行业分类的股票投资组合	79
7.2.2.1.	指数投资期末按行业分类的股票投资组合	79
7.2.2.2.	积极投资期末按行业分类的股票投资组合	80
7.2.3.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	80
7.2.3.1.	期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	80
7.2.3.2.	期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	90
7.2.4.	报告期内股票投资组合的重大变动	90
7.2.5.	期末按债券品种分类的债券投资组合	91
7.2.6.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	91
7.2.7.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	91
7.2.8.	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	91
7.2.9.	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	91
7.2.10.	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	91
7.2.11.	投资组合报告附注	92
8.	基金份额持有人信息	93
8.1.	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF).....	93
8.1.1.	期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
8.1.2.	期末上市基金前十名持有人	93
8.2.	国联安双力中小板综指分级证券投资基金	93
8.2.1.	期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
8.2.2.	期末上市基金前十名持有人	94
8.3.	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96
8.4.	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	96

9. 开放式基金份额变动	96
9.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF).....	96
9.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	96
10. 重大事件揭示	97
10.1. 基金份额持有人大会决议	97
10.2. 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	97
10.3. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	97
10.4. 基金投资策略的改变	97
10.5. 报告期内改聘会计师事务所情况	97
10.6. 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	98
10.7. 基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
10.8. 其他重大事件	99
11. 影响投资者决策的其他重要信息	106
12. 备查文件目录	106
12.1. 备查文件目录	106
12.2. 存放地点	106
12.3. 查阅方式	107

2. 基金简介

2.1. 基金基本情况

2.1.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

基金名称	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
基金简称	国联安双力中小板(LOF)
场内简称	国安双力
基金主代码	162510
交易代码	162510
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年3月24日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,524,284.29份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年5月20日

2.1.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

基金名称	国联安双力中小板综指分级证券投资基金
基金简称	国联安双力中小板综指分级
场内简称	国安双力
基金主代码	162510
交易代码	162510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月23日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,332,807.68份
基金合同存续期	不定期

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年4月16日		
下属分级基金的基金简称	国联安双力A中小板综指	国联安双力B中小板综指	国联安双力中小板综指
下属分级基金场内简称	双力A	双力B	国安双力
下属分级基金的交易代码	150069	150070	162510
报告期末下属分级基金的份额总额	6,744,926.00 份	6,744,927.00 份	4,842,954.68 份

注：国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力A、双力B基金份额自2015年3月23日起终止上市。

2.2. 基金产品说明

2.2.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.2.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。		
业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	双力 A: 低风险低收益。	双力 B: 高风险高收益。	国安双力: 本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.3. 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	田青
	联系电话	021-38992806	010-67595096
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		庾启斌	王洪章

2.4. 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报及深交所网站
登载基金半年度报告正文的管理人	www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com

互联网网址	
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

2.5. 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

3. 主要财务指标和基金净值表现

3.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

3.1.1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年3月24日至2015年6月30日)
本期已实现收益	5,987,386.27
本期利润	4,889,627.69
加权平均基金份额本期利润	0.2933
本期加权平均净值利润率	13.01%
本期基金份额净值增长率	26.85%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	13,819,096.80
期末可供分配基金份额利润	0.7886
期末基金资产净值	38,417,518.49
期末基金份额净值	2.192
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	26.85%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.1.2. 基金净值表现

3.1.2.1. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-14.01%	3.76%	-11.91%	3.46%	-2.10%	0.30%
过去三个月	22.12%	2.93%	24.89%	2.74%	-2.77%	0.19%
自基金份额 转换日次日 起至今	26.85%	2.81%	29.42%	2.63%	-2.57%	0.18%

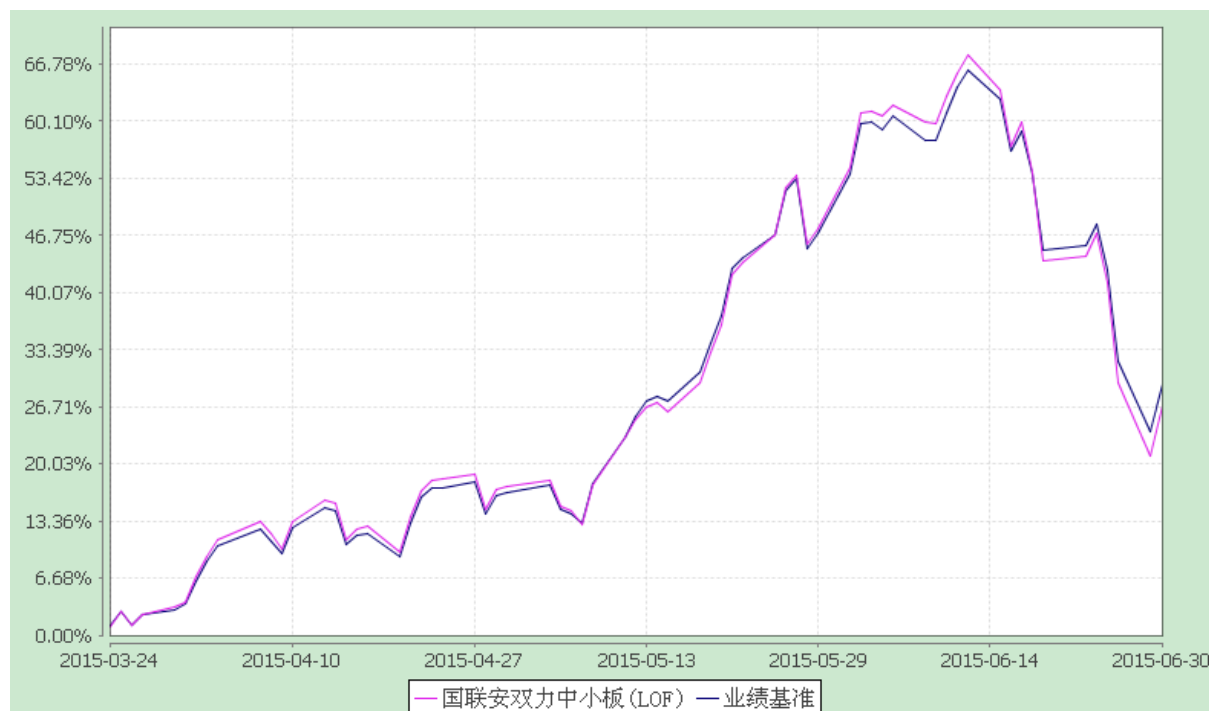
注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、本基金份额转换日次日（2015年3月24日）起至报告期末未满半年；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1.2.2. 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月24日至2015年6月30日)



国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、本基金份额转换日次日（2015年3月24日）起至报告期末未满半年；

3、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

4、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金合同于2012年3月23日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

5、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

3.2.1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年3月23日)
本期已实现收益	3,477,500.04
本期利润	9,611,963.05
加权平均基金份额本期利润	0.4304
本期加权平均净值利润率	30.47%
本期基金份额净值增长率	35.96%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年3月23日)
期末可供分配利润	7,632,313.90
期末可供分配基金份额利润	0.4163
期末基金资产净值	31,670,880.78
期末基金份额净值	1.728
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年3月23日)
基金份额累计净值增长率	84.64%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.2. 基金净值表现

3.2.2.1. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月 (2015年3月1日至2015年3月23日)	17.79%	1.27%	17.00%	1.22%	0.79%	0.05%
过去三个月 (2015年1月1日至2015年3月23日)	35.96%	1.24%	37.47%	1.24%	-1.51%	0.00%
过去六个月 (2014年10月1日至2015年3月23日)	34.16%	1.35%	34.11%	1.35%	0.05%	0.00%
过去一年 (2014年4月1日至2015年3月23日)	72.11%	1.17%	72.72%	1.16%	-0.61%	0.01%
过去三年 (2012年4月1日至2015年3月23日)	84.64%	1.29%	106.09%	1.30%	-21.45%	-0.01%
自基金合同生效起至基金份额转换日	84.64%	1.28%	89.62%	1.31%	-4.98%	-0.03%

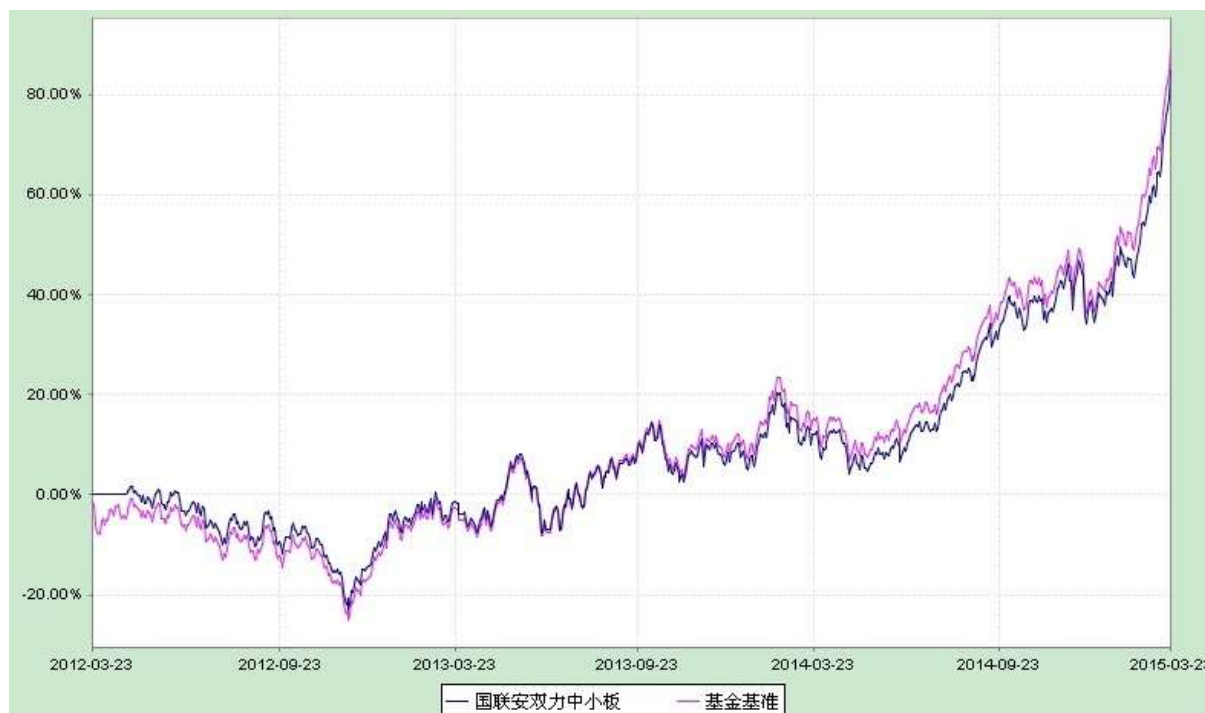
注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益

水平要低于所列数字。

3.2.2.2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安双力中小板综指分级证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年3月23日至2015年3月23日)



注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于2012年3月23日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4. 管理人报告

4.1. 基金管理人及基金经理情况

4.1.1. 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理二十八只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2. 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄志钢	本基金基金经理、兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理	2012-03-23	2015-06-04	8年（自2007年起）	黄志钢先生，硕士，先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司，曾担任金融工程分析师。2010年11月起，担任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2010年12月起，兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理助理。2012年3月至2015年6月，兼任国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理。2012年6月起至2013年7月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理。2013年8月至2015年6月兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。
冒浩	本基金	2015-05-29	-	5年（自	冒浩，英国帝国理工大学

	基金经 理、兼任 国联安 中证医 药 100 指数证 券投资 基金基 金经理			2010 年 起)	硕士研究生毕业，2009 年加入国联安基金管理有限公司，从事量化投资相关工作。先后担任基金经理助理、基金经理。2015 年 5 月起担任国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起兼任国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理。
冒浩	本基金 基金经 理助理	2015-04-02	2015-05-28	5 年（自 2010 年 起）	-

4.2. 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3. 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1. 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2. 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4. 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1. 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采取市值优先和行业分层的抽样方法来复制中小板综合指数。在处理日常的申购赎回、新增成份股、流通股本变动、成份股长期停牌等事件过程中，综合考虑交易成本、个股和行业权重偏离等因素进行组合调整，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2. 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末（2015年6月30日），本基金份额净值为2.192。自本基金份额转换日次日（2015年3月24日）起至本报告期期末，本基金份额净值增长率为26.85%，同期业绩比较基准收益率为29.42%。自本基金份额转换日次日起至本报告期期末，日均跟踪偏离度为0.18%，年化跟踪误差为3.92%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

截止本基金份额转换日（2015年3月23日），原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的份额净值为1.728。自本报告期期初（2015年1月1日）起至本基金份额转换日，原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的份额净值增长率为35.96%，同期业绩比较基准收益率为37.47%。自本报告期期初起至本基金份额转换日，日均跟踪偏离度为0.10%，年化跟踪误差为2.32%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

4.5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年二季度，从宏观经济面来看，宏观经济延续探底的走势。从需求端来看，消费保持稳定，出口略有改善，投资继续下滑；从供给端来看，工业产出弱势反弹（工业增加值从3月5.6%升至5月6.1%）。从资本市场来看，去年以来资金入市和股市上涨的正反馈在6月被打破，股市去杠杆导致A股出现严重踩踏。从政策面来看，在经济增速疲弱，6月银行间市场利率上升，以及A股严重下跌的背景下，央行同时出台了降息，降准措施。预计在资金面总体宽松、政策刺激和改革红利不断释放的预期推动下，A股有望止跌反弹。

优质中小市值公司继续肩负经济转型的重任，而我们也判断优秀的中小公司也将在这轮泡沫清洗以后将继续享受政策红利，为投资人带来良好的收益。

4.6. 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作

小组成员 1/2 以上多数票通过，数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7. 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金（包括双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额）分级运作期内，不进行收益分配；转型后本基金本报告期未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

2015 年 1 月 5 日-2015 年 2 月 2 日、2015 年 2 月 5 日-2015 年 6 月 4 日本基金资产净值低于 5000 万元。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模。

5. 托管人报告

5.1. 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2. 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3. 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6. 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

6.1.1. 资产负债表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日
资 产：		
银行存款	6.1.4.7.1	3,494,242.03
结算备付金		14,573.17
存出保证金		4,096.58
交易性金融资产	6.1.4.7.2	35,851,350.44
其中：股票投资		35,851,350.44
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
应收证券清算款		787,445.59
应收利息	6.1.4.7.5	675.81
应收股利		-
应收申购款		32,131.07
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	32,566.42
资产总计		40,217,081.11
负债和所有者权益		本期末 2015年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,685,452.86

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

应付管理人报酬		30,912.33
应付托管费		8,990.14
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.1.4.7.7	24,084.38
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.8	50,122.91
负债合计		1,799,562.62
所有者权益：		
实收基金	6.1.4.7.9	16,394,640.31
未分配利润	6.1.4.7.10	22,022,878.18
所有者权益合计		38,417,518.49
负债和所有者权益总计		40,217,081.11

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.192 元，基金份额总额 17,524,284.29 份。

2、本基金于 2015 年 3 月 24 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 24 日（基金转型后首日）至 2015 年 6 月 30 日，无上年度数据（下同）。

6.1.2. 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		5,117,094.08
1.利息收入		7,222.27
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	7,222.27
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,165,317.88
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	6,037,263.39

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.14	-
股利收益	6.1.4.7.15	128,054.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	-1,097,758.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	42,312.51
减：二、费用		227,466.39
1. 管理人报酬		76,449.04
2. 托管费		22,425.10
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.1.4.7.18	41,949.40
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.1.4.7.19	86,642.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,889,627.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,889,627.69

注：本基金于2015年3月24日转型，本财务报表的实际编制期间为2015年3月24日（基金转型后首日）至2015年6月30日，无上年度数据（下同）。

6.1.3. 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年3月24日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	17,150,609.79	14,520,270.99	31,670,880.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,889,627.69	4,889,627.69

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-755,969.48	2,612,979.50	1,857,010.02
其中：1.基金申购款	13,329,113.98	23,560,216.11	36,889,330.09
2.基金赎回款	-14,085,083.46	-20,947,236.61	-35,032,320.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	16,394,640.31	22,022,878.18	38,417,518.49

注：本基金于 2015 年 3 月 24 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 24 日（基金转型后首日）至 2015 年 6 月 30 日，无上年度数据（下同）。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

6.1.4. 报表附注

6.1.4.1. 基金基本情况

国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来。根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》原国联安双力中小板综指分级证券投资基金为契约型基金，封闭期为 3 年期。国联安双力中小板综指分级证券投资基金在深圳证券交易所交易上市，至 2015 年 3 月 23 日终止上市。自 2015 年 3 月 24 日（转型后首日）起，国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满后自动转为上市开放式基金（LOF），并更名为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》，国联安双力中小板综指分级证券投资基金在封闭期届满后，按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对双力 A 份额和双力 B 份额计算封闭期末基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，按照国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金份额净值转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的份额。于 2015 年 3 月 23 日（基金份额转换日）日终，双力 A 份额转换前份额数为 6,744,926.00 份，转换比例为 0.61668539，转换后对应本基金份额数为 4,159,497.00 份；双力 B 份额转换前份额数为 6,744,927.00 份，转换比例为 1.38331461，

转换后对应本基金份额数为9,330,356.00份。本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司根据基金合同约定,对双力A、双力B的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所审核同意,本基金于2015年5月20日在深圳证券交易所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.1.4.2. 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本基金的收益分配原则遵循了《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定。

6.1.4.3. 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况、2015年3月24日(转型后首日)至2015年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.1.4.4. 重要会计政策和会计估计

6.1.4.4.1. 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

6.1.4.4.2. 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.1.4.4.3. 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债(包括交易性金融资产或金融负债)

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。

—应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

—其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

6.1.4.4.4. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价,与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.1.4.4.5. 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时,考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等),并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

6.1.4.4.6. 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列条件的,以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;
- 本基金计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.1.4.4.7. 实收基金

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列条件的,以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;
- 本基金计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.1.4.4.8. 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时,申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益,包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量,并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.1.4.4.9. 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可

能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.1.4.4.10. 费用的确认和计量

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率逐日计提。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的规定，指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率每日计算，逐日累计，按季支付。基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

6.1.4.4.11. 基金的收益分配政策

分级运作期内,本基金(包括双力中小板份额、双力A份额、双力B份额)不进行收益分配。本基金分级运作期满并转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)后,每一基金份额享有同等分配权。场外份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式,基金份额持有人可自行选择收益分配方式。基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利。场内份额收益分配只采用现金红利一种方式,基金份额持有人不能自行选择。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%。基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

6.1.4.4.12. 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称“《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》”),若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种,根据《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.1.4.5. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1. 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.1.4.5.2. 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),自2015年3月26日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于2015年3月26日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

6.1.4.5.3. 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

6.1.4.6. 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.1.4.7. 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1. 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	3,494,242.03
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,494,242.03

6.1.4.7.2. 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,483,453.09	35,851,350.44	12,367,897.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	23,483,453.09	35,851,350.44	12,367,897.35

6.1.4.7.3. 衍生金融资产/负债

本报告期末（2015年6月30日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.1.4.7.4. 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1. 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2015年6月30日）本基金未持有买入返售金融资产。

6.1.4.7.4.2. 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2015年6月30日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.1.4.7.5. 应收利息

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	667.41
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6.60
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.80
合计	675.81

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息。

6.1.4.7.6. 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	32,566.42
合计	32,566.42

6.1.4.7.7. 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	24,084.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,084.38

6.1.4.7.8. 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,073.21
预提信息披露费	14,876.39
审计费	27,273.08
指数使用费	1,900.23
合计	50,122.91

6.1.4.7.9. 实收基金

项目	本期	
	2015年3月24日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	18,332,807.68	17,150,609.79
本期申购	14,247,312.14	13,329,113.98
本期赎回(以“-”号填列)	-15,055,835.53	-14,085,083.46
基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算调整		
本期申购		
本期赎回(以“-”号填列)		
本期末	17,524,284.29	16,394,640.31

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金于2015年3月23日转型成LOF基金，相应份额折算成LOF基金份额。

6.1.4.7.10. 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	7,632,313.90	6,887,957.09	14,520,270.99
本期利润	5,987,386.27	-1,097,758.58	4,889,627.69
本期基金份额交易产生的变动数	199,396.63	2,413,582.87	2,612,979.50
其中：基金申购款	9,628,721.81	13,931,494.30	23,560,216.11
基金赎回款	-9,429,325.18	-11,517,911.43	-20,947,236.61

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

本期已分配利润	-	-	0.00
本期末	13,819,096.80	8,203,781.38	22,022,878.18

6.1.4.7.11. 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
活期存款利息收入	7,185.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19.07
其他	17.38
合计	7,222.27

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.1.4.7.12. 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	13,541,740.72
减：卖出股票成本总额	7,504,477.33
买卖股票差价收入	6,037,263.39

6.1.4.7.13. 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.1.4.7.14. 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.1.4.7.15. 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	128,054.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	128,054.49

6.1.4.7.16. 公允价值变动收益

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-1,097,758.58
——股票投资	-1,097,758.58
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,097,758.58

6.1.4.7.17. 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
基金赎回费收入	42,193.38
转换费收入	119.13
合计	42,312.51

注：本基金赎回费和转换费的25%归入基金资产。

6.1.4.7.18. 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	41,949.40
银行间市场交易费用	-
合计	41,949.40

6.1.4.7.19. 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
审计费	14,917.32
信息披露费	8,136.81

银行划款费用	1,049.62
银行间账户维护费	-
上市费	7,433.58
其他	-
指数使用费	55,105.52
合计	86,642.85

6.1.4.8. 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1. 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.1.4.8.2. 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.1.4.9. 关联方关系

6.1.4.9.1. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.1.4.9.2. 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司（“中德安联”）	基金管理人的股东控制的公司

6.1.4.10. 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.1.4.10.1. 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.10.1.1. 股票交易

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

6.1.4.10.1.2. 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

6.1.4.10.1.3. 债券交易

本报告期内，本基金与关联方无债券交易。

6.1.4.10.1.4. 债券回购交易

本报告期，本基金与关联方无债券回购交易。

6.1.4.10.1.5. 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无支付关联方的佣金。

6.1.4.10.2. 关联方报酬

6.1.4.10.2.1. 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	76,449.04
其中：支付销售机构的客户维护费	21,901.72

注：1、在本基金分级运作期内，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数；

2、在本基金分级运作期到期后，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.1.4.10.2.2. 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	22,425.10

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.1.4.10.3. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.1.4.10.4. 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.10.4.1. 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未投资本基金。

6.1.4.10.4.2. 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末其他关联方均未投资本基金。

6.1.4.10.5. 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	2015年3月24日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	3,494,242.03	7,185.82

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

6.1.4.10.6. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.1.4.10.7. 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

6.1.4.11. 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.1.4.12. 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1. 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末（2015年6月30日）未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.1.4.12.2. 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002001	新和成	2015-06-30	重大事项停牌	17.09	2015/7/13	18.49	5,809.00	100,245.17	99,275.81	-
002003	伟星股份	2015-06-05	重大事项停牌	16.17	-	-	3,077.00	22,669.93	49,755.09	-
002012	凯恩股份	2015-05-28	重大事项停牌	14.00	2015/7/1	12.6	4,330.00	23,988.20	60,620.00	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项停牌	44.08	-	-	2,196.00	8,788.74	96,799.68	-
002020	京新药业	2015-04-16	重大事项停牌	29.44	2015/8/10	26.1	1,882.00	11,376.02	55,406.08	-
002045	国光电器	2015-06-01	重大事项停牌	13.92	2015/7/14	12.53	3,773.00	18,569.44	52,520.16	-
002069	獐子岛	2015-06-01	重大事项停牌	19.76	-	-	3,093.00	61,436.98	61,117.68	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大事项停牌	33.00	-	-	8,700.00	294,930.00	287,100.00	-
002088	中材	2015-0	重大事	23.23	-	-	4,474.00	46,166.22	103,931.02	-

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

0	科技	4-21	项停牌							
002091	江苏国泰	2015-06-01	重大事 项停牌	22.45	-	-	4,389.00	81,068.87	98,533.05	-
002097	山河智能	2015-05-21	重大事 项停牌	17.75	-	-	4,251.00	29,790.62	75,455.25	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事 项停牌	18.93	-	-	4,158.00	66,214.36	78,710.94	-
002109	兴化股份	2015-05-08	重大事 项停牌	8.54	-	-	3,465.00	26,919.50	29,591.10	-
002110	三钢闽光	2015-04-02	重大事 项停牌	11.47	-	-	9,276.00	64,434.74	106,395.72	-
002143	印纪传媒	2015-06-30	重大事 项停牌	32.01	2015/7/1	33.5	1,346.00	7,908.84	43,085.46	-
002147	方圆支承	2015-06-01	重大事 项停牌	17.90	-	-	2,699.00	19,290.67	48,312.10	-
002170	芭田股份	2015-05-26	重大事 项停牌	26.12	2015/7/28	23.51	2,844.00	14,426.80	74,285.28	-
002183	怡亚通	2015-06-01	重大事 项停牌	65.78	-	-	4,758.00	33,068.53	312,981.24	-
002191	劲嘉股份	2015-06-18	重大事 项停牌	19.22	-	-	8,884.00	77,308.55	170,750.48	-
002203	海亮股份	2015-04-27	重大事 项停牌	11.83	-	-	7,449.00	34,546.32	88,121.67	-
002209	达意隆	2015-06-08	重大事 项停牌	26.54	2015/7/13	23.89	1,619.00	11,273.40	42,968.26	-
002211	宏达新材	2014-12-10	重大事 项停牌	15.11	-	-	4,699.00	35,245.43	71,001.89	-
002212	南洋股份	2015-04-27	重大事 项停牌	13.08	-	-	3,671.00	17,592.95	48,016.68	-
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	重大事 项停牌	67.20	2015/7/13	60.48	2,837.00	86,033.96	190,646.40	-
002226	江南化工	2015-06-08	重大事 项停牌	13.18	-	-	7,812.00	50,745.51	102,962.16	-
002238	天威视讯	2015-06-29	重大事 项停牌	23.76	-	-	2,720.00	29,386.71	64,627.20	-
002242	九阳股份	2015-06-15	重大事 项停牌	19.45	2015/7/7	17.51	3,669.00	28,949.98	71,362.05	-
002269	美邦服饰	2015-05-22	重大事 项停牌	11.29	2015/7/2	10.67	12,725.00	108,234.11	143,665.25	-
002276	万马股份	2015-06-30	重大事 项停牌	34.15	2015/7/20	30.74	4,981.00	60,500.92	170,101.15	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事 项停牌	37.29	-	-	2,912.00	18,575.14	108,588.48	-
002299	鑫龙	2015-0	重大事	28.16	2015/7/	25.34	2,388.00	19,177.34	67,246.08	-

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

8	电器	6-25	项停牌		2						
002303	美盈森	2015-06-09	重大事 项停牌	47.70	2015/7/13	21.43	2,326.00	14,314.17	110,950.20	-	
002308	威创股份	2015-06-12	重大事 项停牌	23.15	-	-	5,756.00	72,377.59	133,251.40	-	
002309	中利科技	2015-06-02	重大事 项停牌	33.39	2015/7/21	30.05	1,642.00	18,422.14	54,826.38	-	
002310	东方园林	2015-05-27	重大事 项停牌	28.57	-	-	2,824.00	47,605.51	80,681.68	-	
002316	键桥通讯	2015-02-17	重大事 项停牌	14.95	-	-	5,376.00	39,066.89	80,371.20	-	
002320	海峡股份	2015-06-26	重大事 项停牌	27.43	-	-	2,433.00	23,308.14	66,737.19	-	
002325	洪涛股份	2015-06-03	重大事 项停牌	31.15	-	-	2,755.00	31,499.49	85,818.25	-	
002345	潮宏基	2015-05-22	重大事 项停牌	19.58	-	-	3,634.00	17,077.39	71,153.72	-	
002348	高乐股份	2015-06-30	重大事 项停牌	15.63	-	-	4,900.00	113,729.00	76,587.00	-	
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事 项停牌	44.35	-	-	3,085.00	67,136.94	136,819.75	-	
002367	康力电梯	2015-06-02	重大事 项停牌	20.90	-	-	6,612.00	41,588.75	138,190.80	-	
002369	卓翼科技	2015-06-03	重大事 项停牌	20.03	-	-	2,867.00	21,712.68	57,426.01	-	
002374	丽鹏股份	2015-06-30	重大事 项停牌	23.34	2015/7/13	22.5	2,800.00	84,280.00	65,352.00	-	
002375	亚厦股份	2015-06-17	重大事 项停牌	23.96	2015/7/20	26.29	6,753.00	100,373.07	161,801.88	-	
002377	国创高新	2015-06-26	重大事 项停牌	13.32	2015/7/3	11.99	3,366.00	11,531.16	44,835.12	-	
002398	建研集团	2015-06-08	重大事 项停牌	28.49	2015/7/13	18.5	2,167.00	22,133.66	61,737.83	-	
002404	嘉欣丝绸	2015-06-10	重大事 项停牌	14.37	2015/7/23	12.93	4,838.00	16,611.71	69,522.06	-	
002406	远东传动	2015-06-30	重大事 项停牌	11.45	2015/7/1	12	2,836.00	13,962.35	32,472.20	-	
002416	爱施德	2015-05-05	重大事 项停牌	20.97	2015/7/29	18.6	5,215.00	41,430.97	109,358.55	-	
002417	*ST元达	2015-02-09	重大事 项停牌	17.51	2015/7/28	11.25	3,986.00	32,648.69	69,794.86	-	
002443	金洲管道	2015-05-18	重大事 项停牌	17.07	2015/7/13	14.27	5,346.00	33,649.40	91,256.22	-	
002444	中南	2015-0	重大事	51.39	-	-	3,157.00	118,413.98	162,238.23	-	

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

5	重工	6-02	项停牌							
002461	珠江啤酒	2015-06-04	重大事 项停牌	26.40	2015/7/24	23.76	3,242.00	29,819.17	85,588.80	-
002498	汉缆股份	2015-06-30	重大事 项停牌	20.57	2015/7/20	22.63	6,100.00	138,074.32	125,477.00	-
002511	中顺洁柔	2015-06-01	重大事 项停牌	14.18	2015/7/14	12.76	5,551.00	48,042.98	78,713.18	-
002522	浙江众成	2015-06-23	重大事 项停牌	30.60	2015/7/13	27.54	2,588.00	15,190.93	79,192.80	-
002527	新时达	2015-06-15	重大事 项停牌	30.92	-	-	2,824.00	17,845.26	87,318.08	-
002528	英飞拓	2015-06-25	重大事 项停牌	15.18	2015/7/2	13.66	6,664.00	70,458.30	101,159.52	-
002545	东方铁塔	2015-05-19	重大事 项停牌	26.79	-	-	1,396.00	22,060.16	37,398.84	-
002546	新联电子	2015-06-17	重大事 项停牌	33.16	2015/7/16	29.84	1,756.00	20,482.57	58,228.96	-
002557	洽洽食品	2015-06-29	重大事 项停牌	16.38	2015/8/24	14.74	7,552.00	133,343.85	123,701.76	-
002574	明牌珠宝	2015-06-04	重大事 项停牌	22.90	-	-	6,096.00	56,660.21	139,598.40	-
002581	万昌科技	2015-06-18	重大事 项停牌	132.01	2015/7/1	118.81	1,211.00	58,897.38	159,864.11	-
002589	瑞康医药	2015-05-21	重大事 项停牌	104.25	-	-	812.00	16,402.65	84,651.00	-
002602	世纪华通	2014-12-05	重大事 项停牌	18.97	-	-	5,222.00	21,484.42	99,061.34	-
002605	姚记扑克	2015-06-16	重大事 项停牌	29.01	-	-	2,493.00	31,934.74	72,321.93	-
002617	露笑科技	2015-06-23	重大事 项停牌	53.28	2015/7/2	47.95	818.00	7,226.16	43,583.04	-
002620	瑞和股份	2015-06-09	重大事 项停牌	58.49	2015/8/13	52.55	816.00	12,918.18	47,727.84	-
002636	金安国纪	2015-06-29	重大事 项停牌	22.10	-	-	3,068.00	9,177.90	67,802.80	-
002647	宏磊股份	2015-06-05	重大事 项停牌	35.40	-	-	1,632.00	12,528.86	57,772.80	-
002649	博彦科技	2015-06-01	重大事 项停牌	83.81	2015/8/18	75.43	950.00	27,484.03	79,619.50	-
002662	京威股份	2015-05-15	重大事 项停牌	17.84	2015/8/13	16.06	2,315.00	24,358.73	41,299.60	-
002665	首航节能	2015-06-30	重大事 项停牌	27.70	2015/7/1	30	3,992.00	75,392.57	110,578.40	-
002666	鞍重	2015-0	重大事	23.79	-	-	1,186.00	15,457.11	28,214.94	-

7	股份	4-07	项停牌							
002676	顺威股份	2015-04-20	重大事 项停牌	26.94	2015/7/29	24.25	653.00	8,540.92	17,591.82	-

6.1.4.12.3. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.3.1. 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。

6.1.4.12.3.2. 交易所市场债券正回购

截至本报告期末（2015 年 6 月 30 日）止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.1.4.13. 金融工具风险及管理

6.1.4.13.1. 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金基金管理人的风险控制组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.1.4.13.2. 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.1.4.13.2.1. 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末，本基金未持有短期信用债券投资。

本基金由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金经份额转换而来，份额转换日为2015年3月23日，份额转换日次日（2015年3月24日）起至报告期末未满半年。

6.1.4.13.2.2. 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末，本基金未持有长期信用债券投资。

本基金由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金经份额转换而来，份额转换日为2015年3月23日，份额转换日次日（2015年3月24日）起至报告期末未满半年。

6.1.4.13.3. 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注6.1.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.1.4.13.4. 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.1.4.13.4.1. 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.1.4.13.4.1.1. 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6 月30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产										
银行存款	3494242 .03	-	-	-	-	-	-	-	-	3494242 .03
结算备付	14573.1	-	-	-	-	-	-	-	-	14573.1

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

金	7									7
存出保证金	4096.58	-	-	-	-	-	-	-	-	4096.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	3585135.044	3585135.044
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	787445.59	787445.59
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	675.81	675.81
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	32131.07	32131.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	32566.42	32566.42
资产总计	3512911.78	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	36704169.33	40217081.11
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1685452.86	1685452.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	30912.33	30912.33
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	8990.14	8990.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	24084.38	24084.38
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	50122.91	50122.91
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1799562.62	1799562.62
利率敏感度缺口	3512911.78	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	34904606.71	38417518.49

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.1.4.13.4.1.2. 利率风险的敏感性分析

本期末，本基金未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

本基金由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金经份额转换而来，份额转换日为2015年3月23日，份额转换日次日（2015年3月24日）起至报告期末未满半年。

6.1.4.13.4.2. 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.1.4.13.4.3. 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的93.32%，无债券投资和衍生金融资产。于2015年6月30日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.1.4.13.4.3.1. 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	35,851,350.44	93.32
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	35,851,350.44	93.32

6.1.4.13.4.3.2. 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

		2015 年 6 月 30 日
业绩比较基准上升 5%		增加 2,043,767.86
业绩比较基准下降 5%		减少 2,043,767.86

注：本基金由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金经份额转换而来，份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，份额转换日次日（2015 年 3 月 24 日）起至报告期末未满半年。

6.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

6.2.1. 资产负债表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 3 月 23 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 3 月 23 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.2.4.7.1	1,456,596.02	1,220,850.88
结算备付金		-	-
存出保证金		3,847.48	2,387.84
交易性金融资产	6.2.4.7.2	29,588,092.96	25,615,228.54
其中：股票投资		29,588,092.96	25,615,228.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收证券清算款		882,009.39	832,405.72
应收利息	6.2.4.7.5	461.06	403.24
应收股利		-	-
应收申购款		228,642.13	33,738.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	4,608.23	-
资产总计		32,164,257.27	27,705,014.51
负债和所有者权益		本期末 2015 年 3 月 23 日	上年度末 2014 年 12 月 31

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

			日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		381,120.47	775,623.11
应付管理人报酬		19,183.62	25,181.91
应付托管费		4,220.41	5,540.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.7	12,203.88	4,711.22
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.8	76,648.11	89,479.19
负债合计		493,376.49	900,535.44
所有者权益:			
实收基金	6.2.4.7.9	17,150,609.79	19,730,852.65
未分配利润	6.2.4.7.10	14,520,270.99	7,073,626.42
所有者权益合计		31,670,880.78	26,804,479.07
负债和所有者权益总计		32,164,257.27	27,705,014.51

注：报告截止日 2015 年 3 月 23 日，基金份额净值 1.728 元，基金份额总额 18,332,807.68 份。其中国联安双力 A 中小板综指份额 6,744,926.00 份；国联安双力 B 中小板综指份额 6,744,927.00 份；国联安双力中小板综指份额 4,842,954.68 份。

6.2.2. 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	-	9,800,698.55	1,565,270.43

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

1.利息收入	-	5,866.46	7,895.26
其中：存款利息收入	6.2.4.7. 11	5,866.46	7,895.26
债券利息收入	-	-	-
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	3,623,755.34	1,736,386.91
其中：股票投资收益	6.2.4.7. 12	3,620,570.89	1,505,156.60
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.2.4.7. 13	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
收益	-	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.2.4.7. 14	-	-
股利收益	6.2.4.7. 15	3,184.45	231,230.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7. 16	6,134,463.01	-190,607.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7. 17	36,613.74	11,595.45
减：二、费用	-	188,735.50	503,405.96
1. 管理人报酬	-	70,146.59	168,496.62
2. 托管费	-	15,432.29	37,069.24
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.2.4.7. 18	23,578.17	16,905.42
5. 利息支出	-	-	-

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

其中: 卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 其他费用	6.2.4.7.19	79,578.45	280,934.68
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-	9,611,963.05	1,061,864.47
减: 所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-	9,611,963.05	1,061,864.47

6.2.3. 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	19,730,852.65	7,073,626.42	26,804,479.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,611,963.05	9,611,963.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,580,242.86	-2,165,318.48	-4,745,561.34
其中: 1. 基金申购款	17,002,156.60	7,726,679.29	24,728,835.89
2. 基金赎回款	-19,582,399.46	-9,891,997.77	-29,474,397.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	17,150,609.79	14,520,270.99	31,670,880.78
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	35,731,949.68	3,153,441.50	38,885,391.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,061,864.47	1,061,864.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-7,912,977.12	-871,138.09	-8,784,115.21
其中：1.基金申购款	1,036,843.65	148,559.86	1,185,403.51
2.基金赎回款	-8,949,820.77	-1,019,697.95	-9,969,518.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	27,818,972.56	3,344,167.88	31,163,140.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

6.2.4. 报表附注

6.2.4.1. 基金基本情况

国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011] 1593 号文)批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 809,109,186.27 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持

有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.2.4.2. 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本基金的收益分配原则遵循了《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的有关规定。

6.2.4.3. 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年3月23日(封闭期届满日)的财务状况、2015年1月1日至2015年3月23日(封闭期届满日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2.4.4. 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.2.4.5. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更,未发生过会计差错。

6.2.4.6. 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工

作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.2.4.7. 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1. 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年3月23日
活期存款	1,456,596.02
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,456,596.02

6.2.4.7.2. 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年3月23日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,122,437.03	29,588,092.96	13,465,655.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	-	-	-

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	16,122,437.03	29,588,092.96	13,465,655.93

6.2.4.7.3. 衍生金融资产/负债

本报告期末（2015年3月23日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.2.4.7.4. 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1. 各项项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2015年3月23日）本基金未持有买入返售金融资产。

6.2.4.7.4.2. 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2015年3月23日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.2.4.7.5. 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年3月23日
应收活期存款利息	100.53
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	360.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.51
合计	461.06

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息。

6.2.4.7.6. 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年3月23日
其他应收款	-

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

待摊费用	4,608.23
合计	4,608.23

6.2.4.7.7. 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年3月23日
交易所市场应付交易费用	12,203.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,203.88

6.2.4.7.8. 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年3月23日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,149.83
预提信息披露费	6,739.58
审计费	67,355.76
指数使用费	1,402.94
合计	76,648.11

6.2.4.7.9. 实收基金

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,093,447.46	19,730,852.65
本期申购	18,174,486.62	17,002,156.60
本期赎回（以“-”号填列）	-20,935,126.40	-19,582,399.46
基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算调整		
本期申购		

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

本期赎回（以“-”号填列）		
本期末	18,332,807.68	17,150,609.79

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金于2015年3月23日转型成LOF基金，相应份额折算成LOF基金份额。

3、根据本基金合同规定，投资者可申购、赎回国联安双力中小板综指分级份额，国联安双力A中小板综指和国联安双力B中小板综指只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露国联安双力A中小板综指和国联安双力B中小板综指的情况。

6.2.4.7.10. 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	5,203,958.50	1,869,667.92	7,073,626.42
本期利润	3,477,500.04	6,134,463.01	9,611,963.05
本期基金份额交易产生的变动数	-1,049,144.64	-1,116,173.84	-2,165,318.48
其中：基金申购款	4,585,207.07	3,141,472.22	7,726,679.29
基金赎回款	-5,634,351.71	-4,257,646.06	-9,891,997.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,632,313.90	6,887,957.09	14,520,270.99

6.2.4.7.11. 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日
活期存款利息收入	5,444.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	50.46
其他	371.01
合计	5,866.46

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.2.4.7.12. 股票投资收益

单位：人民币元

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日
卖出股票成交总额	9,786,671.81
减：卖出股票成本总额	6,166,100.92
买卖股票差价收入	3,620,570.89

6.2.4.7.13. 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.2.4.7.14. 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.2.4.7.15. 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日
股票投资产生的股利收益	3,184.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,184.45

6.2.4.7.16. 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日
1.交易性金融资产	6,134,463.01
——股票投资	6,134,463.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	6,134,463.01

6.2.4.7.17. 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

基金赎回费收入	36,456.03
转换费收入	157.71
合计	36,613.74

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

6.2.4.7.18. 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日
交易所市场交易费用	23,578.17
银行间市场交易费用	-
合计	23,578.17

6.2.4.7.19. 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日
审计费	12,355.76
信息披露费	6,739.58
银行划款费用	298.09
银行间账户维护费	-
上市费	15,000.00
其他	-
指数使用费	45,185.02
合计	79,578.45

6.2.4.8. 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1. 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.2.4.8.2. 资产负债表日后事项

本基金于 2015 年 3 月 23 日终止上市，在封闭期届满后，按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对双力 A 和双力 B 份额计算封闭期末基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额。基金份额转换完成后，本基金更名为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”。

6.2.4.9. 关联方关系

6.2.4.9.1. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.2.4.9.2. 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司 (“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司 (“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司

6.2.4.10. 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.2.4.10.1. 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1. 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

6.2.4.10.1.2. 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

6.2.4.10.1.3. 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

6.2.4.10.1.4. 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

6.2.4.10.1.5. 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

6.2.4.10.2. 关联方报酬

6.2.4.10.2.1. 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 3月23日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,146.59	168,496.62
其中：支付销售机构的客户维护 费	5,555.34	11,608.56

注：1、在本基金分级运作期内，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数；

2、在本基金分级运作期到期后，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.2.4.10.2.2. 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年3月23日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,432.29	37,069.24

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.2.4.10.3. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间内，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.2.4.10.4. 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.4.1. 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.2.4.10.4.2. 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

6.2.4.10.5. 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年3月23日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	1,456,596.02	5,444.99	1,854,930.79	7,849.29

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

6.2.4.10.6. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.2.4.10.7. 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.2.4.11. 利润分配情况

根据法律法规的规定及《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的约定,本基金(包括双力中小板份额、双力A份额、双力B份额)分级运作期内,不进行收益分配。

6.2.4.12.期末(2015年3月23日)本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1. 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末(2015年3月23日)未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.2.4.12.2. 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002010	传化股份	2015-01-05	重大事项停牌	9.07	2015-06-23	9.98	5,344.00	40,717.84	48,470.08	-
002037	久联发展	2015-02-03	重大事项停牌	19.66	2015-04-28	21.63	2,963.00	41,021.97	58,252.58	-
002086	东方海洋	2015-03-23	重大事项停牌	16.28	2015-04-01	16.99	3,724.00	48,756.28	60,626.72	-
002089	新海宜	2015-03-18	重大事项停牌	18.17	2015-04-14	19.99	4,158.00	64,170.04	75,550.86	-
002122	天马股份	2015-03-06	重大事项停牌	8.00	2015-03-31	8.80	9,120.00	64,356.87	72,960.00	-
002123	荣信股份	2014-12-22	重大事项停牌	9.22	2015-03-26	10.14	4,370.00	59,162.52	40,291.40	-
002171	精诚铜业	2014-11-24	重大事项停牌	17.99	2015-05-11	14.38	6,609.00	76,244.36	118,895.91	-
002176	江特电机	2015-01-27	重大事项停牌	15.75	2015-04-14	17.33	3,015.00	28,920.59	47,486.25	-
002180	艾派克	2014-11-06	重大事项停牌	23.51	2015-05-18	25.86	1,457.00	16,373.31	34,254.07	-
002211	宏达新材	2014-12-10	重大事项停牌	8.93	-	-	4,699.00	35,245.43	41,962.07	-
002255	海陆重工	2015-03-04	重大事项停牌	14.46	2015-05-26	15.91	2,111.00	29,530.30	30,525.06	-
002279	久其软件	2015-02-09	重大事项停牌	56.70	2015-04-13	44.11	2,128.00	19,384.92	120,657.60	-
002298	鑫龙电器	2014-09-30	重大事项停牌	12.34	2015-04-10	9.87	6,388.00	51,300.19	78,827.92	-
002301	齐心集团	2015-03-19	重大事项停牌	16.45	2015-04-21	18.10	5,322.00	34,044.06	87,546.90	-
002311	键桥	2015-03-19	重大事项停牌	11.01	-	-	5,376.00	39,066.89	59,189.76	-

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

6	通讯	2-17	项停牌							
002317	众生药业	2015-01-07	重大事项停牌	24.49	2015-04-02	21.77	1,789.00	28,266.20	43,812.61	-
002321	华英农业	2015-03-19	重大事项停牌	10.02	2015-03-31	10.18	6,554.00	50,487.56	65,671.08	-
002331	皖通科技	2014-11-10	重大事项停牌	27.62	2015-03-25	16.96	2,033.00	14,642.50	56,151.46	-
002350	北京科锐	2015-03-06	重大事项停牌	14.38	2015-04-13	15.82	2,276.00	29,260.48	32,728.88	-
002356	浩宁达	2015-03-13	重大事项停牌	45.32	2015-03-24	44.90	834.00	15,070.86	37,796.88	-
002675	东诚药业	2014-10-10	重大事项停牌	24.18	2015-04-23	26.60	2,867.00	39,079.28	69,324.06	-
002417	三元达	2015-02-09	重大事项停牌	10.71	2015-07-28	11.25	3,986.00	32,648.69	42,690.06	-
002441	众业达	2015-03-05	重大事项停牌	29.17	2015-03-27	32.09	1,859.00	29,459.43	54,227.03	-
002513	蓝丰生化	2015-02-09	重大事项停牌	12.11	2015-05-15	13.32	3,083.00	35,613.21	37,335.13	-
002548	金新农	2015-02-03	重大事项停牌	10.84	2015-05-12	11.92	4,761.00	31,196.93	51,609.24	-
002596	海南瑞泽	2015-03-04	重大事项停牌	12.81	2015-06-09	14.09	3,044.00	32,415.68	38,993.64	-
002602	世纪华通	2014-12-05	重大事项停牌	26.58	-	-	2,611.00	21,484.42	69,400.38	-
002617	露笑科技	2014-12-01	重大事项停牌	23.41	2015-04-29	25.75	818.00	7,226.16	19,149.38	-
002629	仁智油服	2015-03-23	重大事项停牌	11.10	2015-03-24	10.91	4,546.00	31,521.73	50,460.60	-
002656	卡奴迪路	2015-03-16	重大事项停牌	17.64	2015-06-09	19.28	830.00	16,233.22	14,641.20	-
002660	茂硕电源	2015-02-10	重大事项停牌	9.54	2015-05-26	10.49	2,011.00	15,606.13	19,184.94	-

6.2.4.12.3. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.3.1. 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 3 月 23 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元, 因此没有作为抵押的债券。

6.2.4.12.3.2. 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 (2015 年 3 月 23 日) 止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元, 因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交

易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.2.4.13.金融工具风险及管理

6.2.4.13.1. 风险管理政策和组织架构

国联安双力中小板综指分级证券投资基金（以下简称“双力分级”）所投资的金融工具面临的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

双力分级的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

双力分级基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.2.4.13.2. 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。双力分级均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。双力分级投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且双力分级与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

双力分级在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；双力分级在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.2.4.13.2.1. 按短期信用评级列示的债券投资

份额转换日（2015年3月23日）及上年度末，国联安双力中小板综指分级证券投资基金均未持有短期信用债券投资。

本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”。

6.2.4.13.2.2. 按长期信用评级列示的债券投资

份额转换日(2015年3月23日)及上年度末,国联安双力中小板综指分级证券投资基金均未持有长期信用债券投资。

本基金份额转换日为2015年3月23日,在转换日日终,国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额(基金代码:150069)、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额(基金代码:150070)的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金份额。自2015年3月24日起,本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。

6.2.4.13.3. 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。双力分级的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。双力分级所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可于银行间同业市场交易,因此除在附注6.2.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,双力分级可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

双力分级的基金管理人每日预测双力分级的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.2.4.13.4. 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.2.4.13.4.1. 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。双力分级的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。双力分级的基金管理人每日对双力分级面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.2.4.13.4.1.1. 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015年3 月23日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产										
银行存款	1456596 .02	-	-	-	-	-	-	-	-	1456596 .02
结算备付 金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

存出保证金	3847.48	-	-	-	-	-	-	-	-	3847.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	2958809.296	2958809.296
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	882009.39	882009.39
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	461.06	461.06
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	228642.13	228642.13
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	4608.23	4608.23
资产总计	1460443.50	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3070381.377	3216425.727
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	381120.47	381120.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	19183.62	19183.62
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4220.41	4220.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	12203.88	12203.88
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	76648.11	76648.11
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	493376.49	493376.49
利率敏感度缺口	1460443.50	-	-	-	-	-	-	-	3021043.728	3167088.078
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	1,220,850.88	-	-	-	-	-	-	-	-	1,220,850.88

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,387.84	-	-	-	-	-	-	-	-	2,387.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	25,615,28.54	25,615,28.54
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	832,405.72	832,405.72
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	403.24	403.24
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	33,738.29	33,738.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1223238.72	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26481775.79	27705014.51
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	775,623.11	775,623.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	25,181.91	25,181.91
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	5,540.01	5,540.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	4,711.22	4,711.22
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	89,479.19	89,479.19
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0	0	900,535.44	900,535.44
利率敏感度缺口	1223238.72	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0	0	25,581,240.35	26,804,479.07

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.2.4.13.4.1.2. 利率风险的敏感性分析

份额转换日（2015 年 3 月 23 日）及上年度末，国联安双力中小板综指分级证券投资基金均未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”。

6.2.4.13.4.2. 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

双力分级的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.2.4.13.4.3. 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。双力分级主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。双力分级通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且双力分级的基金管理人每日对双力分级所持有的证券价格实施监控。

双力分级的投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 93.42%，无债券投资和衍生金融资产。于 2015 年 3 月 23 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.2.4.13.4.3.1. 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 3 月 23 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	29,588,092.96	93.42	25,615,228.54	95.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	29,588,092.9	93.42	25,615,228.	95.56

	6		54
--	---	--	----

6.2.4.13.4.3.2. 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015年3月23日	上年度末 2014年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加 1,576,263.21	增加 1,339,320.79
	业绩比较基准下降5%	减少 1,576,263.21	减少 1,339,320.79

本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”。

7. 投资组合报告

7.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

（报告期：2015年3月24日-2015年6月30日）

7.1.1. 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	35,851,350.44	89.14
	其中：股票	35,851,350.44	89.14
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,508,815.20	8.72

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

7	其他各项资产	856,915.47	2.13
8	合计	40,217,081.11	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.1.2. 期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1. 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	425,521.84	1.11
B	采矿业	267,361.23	0.70
C	制造业	26,624,238.79	69.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,879.78	0.59
E	建筑业	1,476,807.42	3.84
F	批发和零售业	1,317,023.94	3.43
G	交通运输、仓储和邮政业	179,414.16	0.47
H	住宿和餐饮业	116,502.82	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,330,670.35	6.07
J	金融业	1,133,514.59	2.95
K	房地产业	731,965.66	1.91
L	租赁和商务服务业	690,737.93	1.80
M	科学研究和技术服务业	166,525.83	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	124,020.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41,166.10	0.11
S	综合	-	-
	合计	35,851,350.44	93.32

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.1.2.2. 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.1.3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.1.3.1. 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	16,603	743,814.40	1.94
2	002304	洋河股份	6,533	453,128.88	1.18
3	002024	苏宁云商	27,487	420,551.10	1.09
4	002673	西部证券	12,980	368,242.60	0.96
5	002252	上海莱士	5,588	365,678.72	0.95
6	002142	宁波银行	16,175	342,101.25	0.89
7	002183	怡亚通	4,758	312,981.24	0.81
8	002075	沙钢股份	8,700	287,100.00	0.75
9	002081	金螳螂	9,240	260,475.60	0.68
10	002500	山西证券	14,050	254,164.50	0.66
11	002241	歌尔声学	6,817	244,730.30	0.64
12	002450	康得新	7,946	243,147.60	0.63
13	002202	金风科技	12,127	236,112.69	0.61
14	002146	荣盛发展	17,660	220,750.00	0.57
15	002065	东华软件	7,600	218,500.00	0.57
16	002594	比亚迪	3,854	212,856.42	0.55
17	002475	立讯精密	6,100	206,241.00	0.54
18	002223	鱼跃医疗	2,837	190,646.40	0.50
19	002230	科大讯飞	5,368	187,557.92	0.49
20	002465	海格通信	5,500	177,045.00	0.46
21	002191	劲嘉股份	8,884	170,750.48	0.44
22	002276	万马股份	4,981	170,101.15	0.44
23	002736	国信证券	6,736	169,006.24	0.44
24	002152	广电运通	5,200	168,168.00	0.44
25	002129	中环股份	8,448	167,185.92	0.44
26	002520	日发精机	4,967	162,917.60	0.42
27	002445	中南重工	3,157	162,238.23	0.42
28	002375	亚厦股份	6,753	161,801.88	0.42
29	002405	四维图新	3,658	160,220.40	0.42
30	002581	万昌科技	1,211	159,864.11	0.42
31	002030	达安基因	3,597	159,347.10	0.41
32	002008	大族激光	5,462	156,868.64	0.41
33	002399	海普瑞	4,526	153,838.74	0.40
34	002219	恒康医疗	3,414	151,786.44	0.40
35	002285	世联行	6,863	147,142.72	0.38
36	002470	金正大	6,698	145,413.58	0.38

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

37	002269	美邦服饰	12,725	143,665.25	0.37
38	002664	信质电机	3,952	142,311.52	0.37
39	002423	中原特钢	8,800	142,120.00	0.37
40	002574	明牌珠宝	6,096	139,598.40	0.36
41	002367	康力电梯	6,612	138,190.80	0.36
42	002353	杰瑞股份	3,085	136,819.75	0.36
43	002031	巨轮股份	8,478	135,139.32	0.35
44	002228	合兴包装	4,623	133,373.55	0.35
45	002308	威创股份	5,756	133,251.40	0.35
46	002055	得润电子	2,242	129,766.96	0.34
47	002049	同方国芯	2,700	129,600.00	0.34
48	002344	海宁皮城	6,593	129,420.59	0.34
49	002089	新海宜	5,490	128,575.80	0.33
50	002085	万丰奥威	2,093	128,238.11	0.33
51	002051	中工国际	4,293	127,845.54	0.33
52	002007	华兰生物	2,856	126,492.24	0.33
53	002498	汉缆股份	6,100	125,477.00	0.33
54	002153	石基信息	965	125,440.35	0.33
55	002372	伟星新材	7,050	125,278.50	0.33
56	002301	齐心集团	4,322	124,473.60	0.32
57	002573	清新环境	6,000	124,020.00	0.32
58	002557	洽洽食品	7,552	123,701.76	0.32
59	002493	荣盛石化	5,669	120,409.56	0.31
60	002384	东山精密	5,433	120,123.63	0.31
61	002563	森马服饰	4,943	119,422.88	0.31
62	002038	双鹭药业	2,104	119,191.60	0.31
63	002570	贝因美	6,137	119,119.17	0.31
64	002128	露天煤业	7,153	117,881.44	0.31
65	002236	大华股份	3,689	117,752.88	0.31
66	002244	滨江集团	6,385	117,547.85	0.31
67	002456	欧菲光	3,483	117,516.42	0.31
68	002187	广百股份	6,235	116,594.50	0.30
69	002186	全聚德	4,462	116,502.82	0.30
70	002564	天沃科技	9,363	116,101.20	0.30
71	002400	省广股份	4,564	115,286.64	0.30
72	002318	久立特材	2,200	115,236.00	0.30
73	002100	天康生物	9,836	115,179.56	0.30
74	002311	海大集团	8,236	113,574.44	0.30
75	002195	二三四五	2,690	111,796.40	0.29
76	002432	九安医疗	3,991	111,748.00	0.29
77	002303	美盈森	2,326	110,950.20	0.29
78	002665	首航节能	3,992	110,578.40	0.29

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

79	002366	丹甫股份	1,496	109,776.48	0.29
80	002385	大北农	8,109	109,633.68	0.29
81	002489	浙江永强	2,904	109,480.80	0.28
82	002416	爱施德	5,215	109,358.55	0.28
83	002429	兆驰股份	8,458	109,108.20	0.28
84	002312	三泰控股	2,900	108,634.00	0.28
85	002292	奥飞动漫	2,912	108,588.48	0.28
86	002095	生意宝	1,690	107,974.10	0.28
87	002685	华东重机	8,280	107,640.00	0.28
88	002508	老板电器	2,800	107,408.00	0.28
89	002491	通鼎互联	5,900	107,144.00	0.28
90	002603	以岭药业	5,300	106,848.00	0.28
91	002110	三钢闽光	9,276	106,395.72	0.28
92	002179	中航光电	3,191	105,303.00	0.27
93	002178	延华智能	6,700	104,788.00	0.27
94	002080	中材科技	4,474	103,931.02	0.27
95	002559	亚威股份	5,500	103,235.00	0.27
96	002299	圣农发展	5,076	103,042.80	0.27
97	002226	江南化工	7,812	102,962.16	0.27
98	002266	浙富控股	7,498	102,572.64	0.27
99	002439	启明星辰	2,984	102,351.20	0.27
100	002540	亚太科技	7,022	101,819.00	0.27
101	002657	中科金财	1,100	101,222.00	0.26
102	002528	英飞拓	6,664	101,159.52	0.26
103	002410	广联达	4,300	100,620.00	0.26
104	002625	龙生股份	1,300	99,606.00	0.26
105	002544	杰赛科技	2,826	99,446.94	0.26
106	002001	新和成	5,809	99,275.81	0.26
107	002602	世纪华通	5,222	99,061.34	0.26
108	002091	江苏国泰	4,389	98,533.05	0.26
109	002376	新北洋	5,500	98,450.00	0.26
110	002358	森源电气	4,564	98,034.72	0.26
111	002018	华信国际	2,196	96,799.68	0.25
112	002463	沪电股份	11,527	96,250.45	0.25
113	002631	德尔家居	3,428	96,086.84	0.25
114	002363	隆基机械	2,812	95,073.72	0.25
115	002190	成飞集成	1,861	94,892.39	0.25
116	002483	润邦股份	5,400	94,500.00	0.25
117	002050	三花股份	8,222	94,470.78	0.25
118	002650	加加食品	5,466	94,397.82	0.25
119	002340	格林美	6,166	93,784.86	0.24
120	002161	远望谷	4,289	93,328.64	0.24

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

121	002501	利源精制	5,804	92,747.92	0.24
122	002443	金洲管道	5,346	91,256.22	0.24
123	002543	万和电气	3,674	91,041.72	0.24
124	002642	荣之联	1,587	90,697.05	0.24
125	002588	史丹利	3,140	90,275.00	0.23
126	002029	七匹狼	4,286	90,006.00	0.23
127	002181	粤传媒	6,120	89,964.00	0.23
128	002314	雅致股份	6,960	89,227.20	0.23
129	002408	齐翔腾达	5,162	88,476.68	0.23
130	002060	粤水电	7,112	88,331.04	0.23
131	002108	沧州明珠	5,600	88,256.00	0.23
132	002459	天业通联	3,700	88,134.00	0.23
133	002203	海亮股份	7,449	88,121.67	0.23
134	002618	丹邦科技	2,074	87,999.82	0.23
135	002177	御银股份	6,092	87,846.64	0.23
136	002424	贵州百灵	1,400	87,584.00	0.23
137	002371	七星电子	2,300	87,400.00	0.23
138	002527	新时达	2,824	87,318.08	0.23
139	002261	拓维信息	1,795	87,183.15	0.23
140	002474	榕基软件	4,485	87,143.55	0.23
141	002433	太安堂	5,387	87,053.92	0.23
142	002151	北斗星通	1,700	86,445.00	0.23
143	002462	嘉事堂	1,623	86,181.30	0.22
144	002521	齐峰新材	6,179	86,011.68	0.22
145	002010	传化股份	5,344	85,931.52	0.22
146	002325	洪涛股份	2,755	85,818.25	0.22
147	002378	章源钨业	5,100	85,680.00	0.22
148	002461	珠江啤酒	3,242	85,588.80	0.22
149	002601	佰利联	1,881	85,585.50	0.22
150	002099	海翔药业	3,284	85,449.68	0.22
151	002063	远光软件	2,727	85,273.29	0.22
152	002444	巨星科技	4,606	85,118.88	0.22
153	002589	瑞康医药	812	84,651.00	0.22
154	002004	华邦颖泰	6,503	84,408.94	0.22
155	002104	恒宝股份	3,559	84,312.71	0.22
156	002093	国脉科技	5,253	84,048.00	0.22
157	002396	星网锐捷	2,613	83,877.30	0.22
158	002006	精功科技	7,200	83,736.00	0.22
159	002427	尤夫股份	4,000	83,720.00	0.22
160	002481	双塔食品	2,000	83,260.00	0.22
161	002556	辉隆股份	4,142	82,881.42	0.22
162	002221	东华能源	2,768	82,569.44	0.21

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

163	002233	塔牌集团	4,732	81,674.32	0.21
164	002531	天顺风能	5,586	81,499.74	0.21
165	002267	陕天然气	5,240	81,167.60	0.21
166	002047	宝鹰股份	6,348	81,127.44	0.21
167	002310	东方园林	2,824	80,681.68	0.21
168	002157	正邦科技	4,514	80,574.90	0.21
169	002316	键桥通讯	5,376	80,371.20	0.21
170	002638	勤上光电	4,257	80,287.02	0.21
171	002022	科华生物	1,882	80,286.12	0.21
172	002032	苏泊尔	3,255	80,105.55	0.21
173	002649	博彦科技	950	79,619.50	0.21
174	002522	浙江众成	2,588	79,192.80	0.21
175	002488	金固股份	2,425	78,764.00	0.21
176	002511	中顺洁柔	5,551	78,713.18	0.20
177	002106	莱宝高科	4,158	78,710.94	0.20
178	002073	软控股份	3,355	77,500.50	0.20
179	002348	高乐股份	4,900	76,587.00	0.20
180	002701	奥瑞金	2,942	76,580.26	0.20
181	002232	启明信息	4,007	75,732.30	0.20
182	002612	朗姿股份	1,121	75,611.45	0.20
183	002039	黔源电力	3,656	75,606.08	0.20
184	002287	奇正藏药	1,951	75,523.21	0.20
185	002097	山河智能	4,251	75,455.25	0.20
186	002078	太阳纸业	9,408	75,264.00	0.20
187	002014	永新股份	3,107	75,251.54	0.20
188	002496	辉丰股份	2,800	75,180.00	0.20
189	002331	皖通科技	2,540	74,625.20	0.19
190	002170	芭田股份	2,844	74,285.28	0.19
191	002510	天汽模	4,843	73,855.75	0.19
192	002041	登海种业	4,137	73,183.53	0.19
193	002537	海立美达	4,652	72,617.72	0.19
194	002302	西部建设	3,566	72,425.46	0.19
195	002590	万安科技	3,186	72,322.20	0.19
196	002605	姚记扑克	2,493	72,321.93	0.19
197	002281	光迅科技	1,500	72,120.00	0.19
198	002083	孚日股份	8,213	72,028.01	0.19
199	002609	捷顺科技	3,600	72,000.00	0.19
200	002681	奋达科技	2,612	71,725.52	0.19
201	002242	九阳股份	3,669	71,362.05	0.19
202	002428	云南锗业	3,034	71,329.34	0.19
203	002641	永高股份	7,460	71,317.60	0.19
204	002345	潮宏基	3,634	71,153.72	0.19

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

205	002211	宏达新材	4,699	71,001.89	0.18
206	002284	亚太股份	2,817	70,791.21	0.18
207	002171	精诚铜业	3,209	70,662.18	0.18
208	002121	科陆电子	2,334	70,090.02	0.18
209	002036	汉麻产业	3,300	69,927.00	0.18
211	002404	嘉欣丝绸	4,838	69,522.06	0.18
212	002479	富春环保	3,766	69,106.10	0.18
213	002339	积成电子	2,065	68,971.00	0.18
214	002251	步步高	2,805	68,442.00	0.18
215	002663	普邦园林	7,055	68,433.50	0.18
216	002224	三力士	3,985	68,103.65	0.18
217	002117	东港股份	2,031	68,018.19	0.18
218	002636	金安国纪	3,068	67,802.80	0.18
219	002550	千红制药	3,216	67,568.16	0.18
220	002156	通富微电	3,616	67,474.56	0.18
221	002482	广田股份	2,466	67,321.80	0.18
222	002298	鑫龙电器	2,388	67,246.08	0.18
223	002422	科伦药业	1,673	66,986.92	0.17
224	002440	闰土股份	2,793	66,948.21	0.17
225	002320	海峡股份	2,433	66,737.19	0.17
226	002565	上海绿新	6,588	66,209.40	0.17
227	002630	华西能源	2,447	66,093.47	0.17
228	002023	海特高新	2,910	65,911.50	0.17
229	002430	杭氧股份	4,984	65,888.48	0.17
230	002064	华峰氨纶	7,214	65,430.98	0.17
231	002374	丽鹏股份	2,800	65,352.00	0.17
232	002019	亿帆鑫富	1,900	65,170.00	0.17
233	002535	林州重机	4,762	65,144.16	0.17
234	002419	天虹商场	3,825	65,025.00	0.17
235	002174	游族网络	700	64,932.00	0.17
236	002238	天威视讯	2,720	64,627.20	0.17
237	002005	德豪润达	5,611	64,414.28	0.17
238	002390	信邦制药	3,600	64,368.00	0.17
239	002478	常宝股份	3,920	64,248.80	0.17
240	002180	艾派克	1,457	64,108.00	0.17
241	002360	同德化工	3,601	64,097.80	0.17
242	002503	搜于特	3,395	64,097.60	0.17
243	002627	宜昌交运	2,163	63,224.49	0.16
244	002420	毅昌股份	5,600	63,224.00	0.16
245	002294	信立泰	2,198	62,862.80	0.16
246	002293	罗莱家纺	3,465	62,681.85	0.16
247	002275	桂林三金	2,449	62,596.44	0.16

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

248	002056	横店东磁	1,983	62,028.24	0.16
249	002398	建研集团	2,167	61,737.83	0.16
250	002626	金达威	3,136	61,716.48	0.16
251	002062	宏润建设	5,397	61,687.71	0.16
252	002271	东方雨虹	2,398	61,628.60	0.16
253	002204	大连重工	4,597	61,415.92	0.16
254	002069	獐子岛	3,093	61,117.68	0.16
255	002122	天马股份	5,720	60,918.00	0.16
256	002646	青青稞酒	2,087	60,898.66	0.16
257	002661	克明面业	1,200	60,780.00	0.16
258	002012	凯恩股份	4,330	60,620.00	0.16
259	002217	合力泰	2,700	60,534.00	0.16
260	002596	海南瑞泽	3,044	60,514.72	0.16
261	002042	华孚色纺	4,439	60,459.18	0.16
262	002185	华天科技	3,350	60,367.00	0.16
263	002092	中泰化学	5,913	60,253.47	0.16
264	002165	红宝丽	5,896	60,198.16	0.16
265	002101	广东鸿图	1,995	60,089.40	0.16
266	002256	彩虹精化	2,712	59,880.96	0.16
267	002086	东方海洋	2,524	59,591.64	0.16
268	002441	众业达	2,318	59,456.70	0.15
269	002494	华斯股份	2,646	59,217.48	0.15
270	002176	江特电机	2,115	59,050.80	0.15
271	002011	盾安环境	4,072	59,003.28	0.15
272	002567	唐人神	4,777	58,757.10	0.15
273	002364	中恒电气	2,052	58,646.16	0.15
274	002546	新联电子	1,756	58,228.96	0.15
275	002647	宏磊股份	1,632	57,772.80	0.15
276	002262	恩华药业	1,785	57,726.90	0.15
277	002369	卓翼科技	2,867	57,426.01	0.15
278	002394	联发股份	3,708	57,399.84	0.15
279	002533	金杯电工	4,416	57,363.84	0.15
280	002240	威华股份	4,229	57,345.24	0.15
281	002025	航天电器	2,188	57,325.60	0.15
282	002513	蓝丰生化	3,083	56,788.86	0.15
283	002154	报喜鸟	6,084	56,763.72	0.15
284	002386	天原集团	6,671	56,703.50	0.15
285	002250	联化科技	2,527	56,604.80	0.15
286	002418	康盛股份	1,817	56,545.04	0.15
287	002273	水晶光电	1,808	56,500.00	0.15
288	002495	佳隆股份	5,400	56,322.00	0.15
289	002016	世荣兆业	3,990	56,139.30	0.15

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

290	002333	罗普斯金	2,842	56,015.82	0.15
291	002155	湖南黄金	4,505	55,997.15	0.15
292	002597	金禾实业	4,578	55,988.94	0.15
293	002614	蒙发利	3,139	55,968.37	0.15
294	002436	兴森科技	3,088	55,892.80	0.15
295	002402	和而泰	1,920	55,872.00	0.15
296	002362	汉王科技	1,772	55,747.12	0.15
297	002382	蓝帆医疗	2,036	55,562.44	0.14
298	002020	京新药业	1,882	55,406.08	0.14
299	002048	宁波华翔	2,659	55,280.61	0.14
300	002484	江海股份	2,328	55,173.60	0.14
301	002309	中利科技	1,642	54,826.38	0.14
302	002449	国星光电	2,491	54,802.00	0.14
303	002321	华英农业	4,454	54,695.12	0.14
304	002518	科士达	1,752	54,417.12	0.14
305	002534	杭锅股份	2,570	54,149.90	0.14
306	002431	棕榈园林	1,863	54,064.26	0.14
307	002013	中航机电	1,931	53,778.35	0.14
308	002455	百川股份	4,140	53,157.60	0.14
309	002123	荣信股份	2,370	52,732.50	0.14
310	002037	久联发展	1,563	52,610.58	0.14
311	002045	国光电器	3,773	52,520.16	0.14
312	002327	富安娜	4,218	52,050.12	0.14
313	002135	东南网架	4,206	51,313.20	0.13
314	002208	合肥城建	2,945	51,213.55	0.13
315	002477	雏鹰农牧	2,651	50,899.20	0.13
316	002052	同洲电子	3,641	50,573.49	0.13
317	002389	南洋科技	2,600	50,440.00	0.13
318	002317	众生药业	1,789	50,431.91	0.13
319	002168	深圳惠程	3,209	49,803.68	0.13
320	002028	思源电气	2,705	49,772.00	0.13
321	002003	伟星股份	3,077	49,755.09	0.13
322	002279	久其软件	928	49,648.00	0.13
323	002502	骅威股份	2,226	49,617.54	0.13
324	002167	东方锆业	4,137	49,602.63	0.13
325	002492	恒基达鑫	3,168	49,452.48	0.13
326	002206	海利得	2,922	49,206.48	0.13
327	002118	紫鑫药业	2,827	48,907.10	0.13
328	002629	仁智油服	4,119	48,892.53	0.13
329	002255	海陆重工	2,111	48,785.21	0.13
330	002305	南国置业	5,945	48,392.30	0.13
331	002096	南岭民爆	1,469	48,330.10	0.13

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

332	002147	方圆支承	2,699	48,312.10	0.13
333	002280	联络互动	902	48,076.60	0.13
334	002212	南洋股份	3,671	48,016.68	0.12
335	002485	希努尔	3,025	47,885.75	0.12
336	002620	瑞和股份	816	47,727.84	0.12
337	002216	三全食品	3,242	47,657.40	0.12
338	002347	泰尔重工	1,948	47,628.60	0.12
339	002335	科华恒盛	1,308	47,323.44	0.12
340	002068	黑猫股份	4,800	47,136.00	0.12
341	002622	永大集团	1,677	47,106.93	0.12
342	002393	力生制药	1,031	47,096.08	0.12
343	002457	青龙管业	3,000	47,070.00	0.12
344	002220	天宝股份	3,292	47,009.76	0.12
345	002133	广宇集团	4,652	46,845.64	0.12
346	002539	新都化工	1,421	46,750.90	0.12
347	002139	拓邦股份	1,989	46,403.37	0.12
348	002237	恒邦股份	3,850	46,084.50	0.12
349	002392	北京利尔	5,318	45,947.52	0.12
350	002054	德美化工	4,031	45,872.78	0.12
351	002035	华帝股份	2,879	45,632.15	0.12
352	002332	仙琚制药	2,628	45,516.96	0.12
353	002053	云南盐化	1,573	45,160.83	0.12
354	002138	顺络电子	2,950	44,987.50	0.12
355	002377	国创高新	3,366	44,835.12	0.12
356	002628	成都路桥	5,898	44,765.82	0.12
357	002079	苏州固锝	4,104	44,692.56	0.12
358	002554	惠博普	3,103	44,590.11	0.12
359	002675	东诚药业	967	44,124.21	0.11
360	002548	金新农	2,781	44,078.85	0.11
361	002077	大港股份	2,410	43,934.30	0.11
362	002115	三维通信	2,919	43,755.81	0.11
363	002617	露笑科技	818	43,583.04	0.11
364	002143	印纪传媒	1,346	43,085.46	0.11
365	002209	达意隆	1,619	42,968.26	0.11
366	002435	长江润发	2,769	42,919.50	0.11
367	002277	友阿股份	2,493	42,779.88	0.11
368	002254	泰和新材	2,630	42,343.00	0.11
369	002140	东华科技	1,893	42,327.48	0.11
370	002283	天润曲轴	2,445	41,687.25	0.11
371	002307	北新路桥	3,005	41,589.20	0.11
372	002454	松芝股份	1,908	41,403.60	0.11
373	002107	沃华医药	1,369	41,384.87	0.11

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

374	002662	京威股份	2,315	41,299.60	0.11
375	002071	长城影视	1,951	41,166.10	0.11
376	002182	云海金属	2,618	41,076.42	0.11
377	002184	海得控制	894	41,052.48	0.11
378	002295	精艺股份	1,985	40,077.15	0.10
379	002087	新野纺织	4,719	40,064.31	0.10
380	002391	长青股份	2,000	39,920.00	0.10
381	002124	天邦股份	1,956	39,511.20	0.10
382	002328	新朋股份	2,811	39,354.00	0.10
383	002356	浩宁达	1,602	39,136.86	0.10
384	002322	理工监测	1,771	38,696.35	0.10
385	002300	太阳电缆	3,330	38,428.20	0.10
386	002472	双环传动	1,191	38,409.75	0.10
387	002201	九鼎新材	1,900	38,380.00	0.10
388	002088	鲁阳股份	2,272	37,919.68	0.10
389	002523	天桥起重	3,710	37,916.20	0.10
390	002452	长高集团	3,638	37,798.82	0.10
391	002218	拓日新能	2,954	37,752.12	0.10
392	002600	江粉磁材	3,954	37,523.46	0.10
393	002160	常铝股份	2,800	37,436.00	0.10
394	002545	东方铁塔	1,396	37,398.84	0.10
395	002141	蓉胜超微	1,599	37,304.67	0.10
396	002148	北纬通信	1,600	36,496.00	0.09
397	002313	日海通讯	1,904	36,480.64	0.09
398	002365	永安药业	1,786	36,077.20	0.09
399	002074	东源电器	1,407	34,907.67	0.09
400	002350	北京科锐	1,476	33,918.48	0.09
401	002343	禾欣股份	1,343	32,796.06	0.09
402	002406	远东传动	2,836	32,472.20	0.08
403	002674	兴业科技	1,681	30,560.58	0.08
404	002584	西陇化工	834	30,524.40	0.08
405	002109	兴化股份	3,465	29,591.10	0.08
406	002578	闽发铝业	2,697	29,046.69	0.08
407	002451	摩恩电气	1,815	28,386.60	0.07
408	002667	鞍重股份	1,186	28,214.94	0.07
409	002580	圣阳股份	1,553	27,550.22	0.07
410	002541	鸿路钢构	1,400	27,076.00	0.07
411	002692	远程电缆	1,251	26,696.34	0.07
412	002656	卡奴迪路	830	25,306.70	0.07
413	002593	日上集团	982	23,685.84	0.06
414	002134	天津普林	1,800	23,634.00	0.06
415	002694	顾地科技	1,630	23,406.80	0.06

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

416	002696	百洋股份	1,061	22,991.87	0.06
417	002504	东光微电	822	22,267.98	0.06
418	002112	三变科技	1,267	21,551.67	0.06
419	002676	顺威股份	653	17,591.82	0.05
420	002695	煌上煌	353	15,270.78	0.04
421	002689	博林特	5	65.75	0.00

7.1.3.2. 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.1.4. 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1. 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	367,534.00	0.96
2	002673	西部证券	315,462.00	0.82
3	002075	沙钢股份	294,930.00	0.77
4	002465	海格通信	252,725.00	0.66
5	002024	苏宁云商	247,475.00	0.64
6	002475	立讯精密	234,396.00	0.61
7	002493	荣盛石化	232,120.00	0.60
8	002491	通鼎互联	208,361.65	0.54
9	002304	洋河股份	206,901.00	0.54
10	002573	清新环境	197,802.00	0.51
11	002312	三泰控股	192,511.00	0.50
12	002563	森马服饰	191,772.00	0.50
13	002049	同方国芯	189,804.00	0.49
14	002423	中原特钢	181,192.00	0.47
15	002151	北斗星通	172,644.00	0.45
16	002483	润邦股份	169,320.00	0.44
17	002498	汉缆股份	167,500.00	0.44
18	002142	宁波银行	167,099.00	0.43
19	002318	久立特材	162,360.00	0.42
20	002178	延华智能	161,910.00	0.42

7.1.4.2. 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	352,541.00	0.92

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

2	002304	洋河股份	234,735.39	0.61
3	002024	苏宁云商	224,166.55	0.58
4	002142	宁波银行	151,547.00	0.39
5	002065	东华软件	148,315.00	0.39
6	002252	上海莱士	142,887.00	0.37
7	002445	中南重工	141,810.00	0.37
8	002673	西部证券	138,322.00	0.36
9	002500	山西证券	129,478.00	0.34
10	002055	得润电子	126,951.95	0.33
11	002594	比亚迪	125,636.00	0.33
12	002202	金风科技	120,921.00	0.31
13	002241	歌尔声学	119,930.58	0.31
14	002129	中环股份	117,734.00	0.31
15	002187	广百股份	116,545.00	0.30
16	002450	康得新	115,076.45	0.30
17	002146	荣盛发展	113,459.00	0.30
18	002284	亚太股份	106,366.05	0.28
19	002208	合肥城建	102,404.44	0.27
20	002540	亚太科技	101,954.00	0.27

7.1.4.3. 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	14,865,493.39
卖出股票的收入（成交）总额	13,541,740.72

注：不考虑相关交易费用。

7.1.5. 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.1.6. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.1.7. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.1.8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.1.10.2. 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

7.1.11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1. 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.1.11.2. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.1.11.3. 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.1.12. 投资组合报告附注

7.1.12.1. 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.1.12.2. 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.1.12.3. 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,096.58
2	应收证券清算款	787,445.59
3	应收股利	-
4	应收利息	675.81
5	应收申购款	32,131.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,566.42
8	其他	-
9	合计	856,915.47

7.1.12.4. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.1.12.5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.1.12.5.1. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资 产净值比 例(%)	流通受限情况说 明
1	002183	怡亚通	312,981.24	0.81	重大事项停牌
2	002075	沙钢股份	287,100.00	0.75	重大事项停牌

7.1.12.5.2. 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

(报告期：2015年1月1日-2015年3月23日)

7.2.1. 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比 例(%)
1	权益投资	29,588,092.96	91.99
	其中：股票	29,588,092.96	91.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,456,596.02	4.53
7	其他各项资产	1,119,568.29	3.48
8	合计	32,164,257.27	100.00

7.2.2. 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1. 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净
----	------	------	--------

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

			值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	441,133.70	1.39
B	采矿业	282,094.78	0.89
C	制造业	21,363,003.79	67.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	258,907.98	0.82
E	建筑业	1,447,185.07	4.57
F	批发和零售业	1,341,159.14	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	231,524.69	0.73
H	住宿和餐饮业	46,124.60	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,940,117.48	6.13
J	金融业	913,626.54	2.88
K	房地产业	742,432.11	2.34
L	租赁和商务服务业	482,824.16	1.52
M	科学研究和技术服务业	49,340.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,618.92	0.15
S	综合	-	-
	合计	29,588,092.96	93.42

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2.2. 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.2.3.1. 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	18003	537389.55	1.70%
2	002304	洋河股份	5103	404259.66	1.28%
3	002024	苏宁云商	28228	366117.16	1.16%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

4	002252	上海莱士	5688	302032.80	0.95%
5	002081	金螳螂	10340	299446.40	0.95%
6	002142	宁波银行	16475	297209.00	0.94%
7	002065	东华软件	8300	274066.00	0.87%
8	002500	山西证券	14250	240397.50	0.76%
9	002241	歌尔声学	7055	227876.50	0.72%
10	002594	比亚迪	4114	218494.54	0.69%
11	002152	广电运通	5400	205524.00	0.65%
12	002450	康得新	5497	203553.91	0.64%
13	002183	怡亚通	6158	199642.36	0.63%
14	002202	金风科技	12327	199450.86	0.63%
15	002673	西部证券	4490	197829.40	0.62%
16	002146	荣盛发展	10330	195030.40	0.62%
17	002399	海普瑞	5226	182910.00	0.58%
18	002736	国信证券	7836	178190.64	0.56%
19	002230	科大讯飞	3679	176592.00	0.56%
20	002051	中工国际	4993	170810.53	0.54%
21	002187	广百股份	10235	164783.50	0.52%
22	002405	四维图新	4058	155583.72	0.49%
23	002285	世联行	4702	153896.46	0.49%
24	002007	华兰生物	3556	150418.80	0.47%
25	002236	大华股份	4172	148773.52	0.47%
26	002344	海宁皮城	6793	147951.54	0.47%
27	002385	大北农	6006	144144.00	0.46%
28	002520	日发精机	3787	143300.08	0.45%
29	002353	杰瑞股份	3685	141872.50	0.45%
30	002129	中环股份	4531	141729.68	0.45%
31	002030	达安基因	3464	138040.40	0.44%
32	002470	金正大	3649	137932.20	0.44%
33	002445	中南重工	4557	131469.45	0.42%
34	002031	巨轮股份	7591	130413.38	0.41%
35	002153	石基信息	1065	130249.50	0.41%
36	002557	洽洽食品	5135	127039.90	0.40%
37	002367	康力电梯	8012	125948.64	0.40%
38	002311	海大集团	6983	124995.70	0.39%
39	002375	亚厦股份	4502	122769.54	0.39%
40	002038	双鹭药业	2330	121346.40	0.38%
41	002279	久其软件	2128	120657.60	0.38%
42	002008	大族激光	6062	119785.12	0.38%
43	002171	精诚铜业	6609	118895.91	0.38%
44	002219	恒康医疗	3714	118476.60	0.37%
45	002001	新和成	6609	116582.76	0.37%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

46	002095	生意宝	1308	116098.08	0.37%
47	002416	爱施德	6315	115627.65	0.37%
48	002429	兆驰股份	10358	115595.28	0.36%
49	002570	贝因美	5837	115455.86	0.36%
50	002564	天沃科技	9063	110387.34	0.35%
51	002223	鱼跃医疗	3234	108403.68	0.34%
52	002055	得润电子	4383	107821.80	0.34%
53	002456	欧菲光	4183	107670.42	0.34%
54	002544	杰赛科技	3326	106598.30	0.34%
55	002474	榕基软件	6285	106593.60	0.34%
56	002540	亚太科技	3469	106151.40	0.34%
57	002299	圣农发展	6476	106012.12	0.33%
58	002400	省广股份	3143	105604.80	0.33%
59	002372	伟星新材	5646	103604.10	0.33%
60	002588	史丹利	1970	101258.00	0.32%
61	002440	闰土股份	3593	100208.77	0.32%
62	002203	海亮股份	9549	99787.05	0.32%
63	002267	陕天然气	6640	98670.40	0.31%
64	002177	御银股份	7992	98541.36	0.31%
65	002269	美邦服饰	6190	96997.30	0.31%
66	002128	露天煤业	8663	95986.04	0.30%
67	002244	滨江集团	8260	94659.60	0.30%
68	002004	华邦颖泰	3176	94644.80	0.30%
69	002292	奥飞动漫	2056	94473.20	0.30%
70	002444	巨星科技	5906	94259.76	0.30%
71	002208	合肥城建	5529	93716.55	0.30%
72	002190	成飞集成	2126	92714.86	0.29%
73	002574	明牌珠宝	6096	92354.40	0.29%
74	002232	启明信息	5707	92168.05	0.29%
75	002108	沧州明珠	4294	91891.60	0.29%
76	002565	上海绿新	9288	91858.32	0.29%
77	002650	加加食品	6366	91415.76	0.29%
78	002191	劲嘉股份	4192	90924.48	0.29%
79	002179	中航光电	2901	89437.83	0.28%
80	002063	远光软件	2927	89244.23	0.28%
81	002204	大连重工	5997	88575.69	0.28%
82	002422	科伦药业	2273	88487.89	0.28%
83	002396	星网锐捷	2242	88200.28	0.28%
84	002631	德尔家居	3514	88166.26	0.28%
85	002085	万丰奥威	2235	87612.00	0.28%
86	002301	齐心集团	5322	87546.90	0.28%
87	002364	中恒电气	2126	87314.82	0.28%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

88	002436	兴森科技	2044	86870.00	0.27%
89	002156	通富微电	7067	86853.43	0.27%
90	002039	黔源电力	5272	86566.24	0.27%
91	002050	三花股份	4711	86211.30	0.27%
92	002340	格林美	4920	86001.60	0.27%
93	002462	嘉事堂	2023	85977.50	0.27%
94	002522	浙江众成	2594	85083.20	0.27%
95	002618	丹邦科技	2274	84933.90	0.27%
96	002310	东方园林	3624	84149.28	0.27%
97	002503	搜于特	3228	83928.00	0.27%
98	002489	浙江永强	4480	83820.80	0.26%
99	002556	辉隆股份	5168	83773.28	0.26%
100	002478	常宝股份	5620	83738.00	0.26%
101	002492	恒基达鑫	6368	83675.52	0.26%
102	002308	威创股份	5456	83258.56	0.26%
103	002294	信立泰	1874	82980.72	0.26%
104	002701	奥瑞金	2439	82804.05	0.26%
105	002228	合兴包装	4723	82558.04	0.26%
106	002432	九安医疗	2291	82315.63	0.26%
107	002092	中泰化学	8113	81454.52	0.26%
108	002073	软控股份	4455	81348.30	0.26%
109	002510	天汽模	6743	81320.58	0.26%
110	002641	永高股份	5130	81054.00	0.26%
111	002488	金固股份	1370	80693.00	0.25%
112	002537	海立美达	2726	80117.14	0.25%
113	002362	汉王科技	2472	80092.80	0.25%
114	002605	姚记扑克	3393	79973.01	0.25%
115	002110	三钢闽光	9276	78938.76	0.25%
116	002298	鑫龙电器	6388	78827.92	0.25%
117	002439	启明星辰	1742	78564.20	0.25%
118	002185	华天科技	4550	78487.50	0.25%
119	002041	登海种业	2155	78355.80	0.25%
120	002097	山河智能	5951	78196.14	0.25%
121	002287	奇正藏药	2651	78177.99	0.25%
122	002240	威华股份	4229	78151.92	0.25%
123	002419	天虹商场	5225	77748.00	0.25%
124	002104	恒宝股份	3559	77550.61	0.24%
125	002646	青青稞酒	2787	77367.12	0.24%
126	002011	盾安环境	5172	76855.92	0.24%
127	002221	东华能源	2768	76728.96	0.24%
128	002056	横店东磁	2683	76706.97	0.24%
129	002022	科华生物	2482	75998.84	0.24%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

130	002155	辰州矿业	6505	75848.30	0.24%
131	002089	新海宜	4158	75550.86	0.24%
132	002325	洪涛股份	3755	75325.30	0.24%
133	002266	浙富控股	7098	75238.80	0.24%
134	002083	孚日股份	11413	75097.54	0.24%
135	002428	云南锗业	4134	74825.40	0.24%
136	002080	中材科技	4474	74805.28	0.24%
137	002005	德豪润达	7611	74663.91	0.24%
138	002226	江南化工	5206	74289.62	0.23%
139	002029	七匹狼	5786	74176.52	0.23%
140	002665	首航节能	1337	73789.03	0.23%
141	002479	富春环保	5266	73671.34	0.23%
142	002366	丹甫股份	1496	73588.24	0.23%
143	002122	天马股份	9120	72960.00	0.23%
144	002271	东方雨虹	1699	72887.10	0.23%
145	002482	广田股份	3266	72766.48	0.23%
146	002626	金达威	2168	72649.68	0.23%
147	002543	万和电气	5074	72405.98	0.23%
148	002280	联络互动	521	72366.90	0.23%
149	002443	金洲管道	7346	71990.80	0.23%
150	002384	东山精密	5133	71810.67	0.23%
151	002461	珠江啤酒	4442	71782.72	0.23%
152	002242	九阳股份	4969	71752.36	0.23%
153	002345	潮宏基	5434	71728.80	0.23%
154	002275	桂林三金	3249	71413.02	0.23%
155	002154	报喜鸟	4542	71127.72	0.22%
156	002118	紫鑫药业	3927	71117.97	0.22%
157	002064	华峰氨纶	5107	71038.37	0.22%
158	002093	国脉科技	5253	70915.50	0.22%
159	002251	步步高	3350	70886.00	0.22%
160	002224	三力士	5885	70620.00	0.22%
161	002535	林州重机	6462	70048.08	0.22%
162	002602	世纪华通	2611	69400.38	0.22%
163	002675	东诚药业	2867	69324.06	0.22%
164	002531	天顺风能	3693	69206.82	0.22%
165	002485	希努尔	4325	69113.50	0.22%
166	002078	太阳纸业	12908	69057.80	0.22%
167	002195	二三四五	1090	67961.50	0.21%
168	002079	苏州固锝	6104	67937.52	0.21%
169	002523	天桥起重	7600	67716.00	0.21%
170	002382	蓝帆医疗	2736	67524.48	0.21%
171	002100	天康生物	4418	67507.04	0.21%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

172	002501	利源精制	2102	66885.64	0.21%
173	002550	千红制药	2208	66681.60	0.21%
174	002463	沪电股份	10927	66436.16	0.21%
175	002559	亚威股份	2350	66387.50	0.21%
176	002023	海特高新	2055	66376.50	0.21%
177	002273	水晶光电	2608	66347.52	0.21%
178	002106	莱宝高科	4158	66320.10	0.21%
179	002309	中利科技	2342	66278.60	0.21%
180	002597	金禾实业	3139	65919.00	0.21%
181	002216	三全食品	2521	65672.05	0.21%
182	002321	华英农业	6554	65671.08	0.21%
183	002307	北新路桥	4269	65401.08	0.21%
184	002642	荣之联	1087	65220.00	0.21%
185	002028	思源电气	4005	65201.40	0.21%
186	002048	宁波华翔	3859	65178.51	0.21%
187	002161	远望谷	4289	64678.12	0.20%
188	002107	沃华医药	1969	64484.75	0.20%
189	002335	科华恒盛	1908	64433.16	0.20%
190	002663	普邦园林	2828	64308.72	0.20%
191	002638	勤上光电	3757	64207.13	0.20%
192	002256	彩虹精化	3512	64129.12	0.20%
193	002250	联化科技	3427	63879.28	0.20%
194	002363	隆基机械	1712	63652.16	0.20%
195	002614	蒙发利	3093	63623.01	0.20%
196	002589	瑞康医药	1112	63395.12	0.20%
197	002581	万昌科技	1111	63315.89	0.20%
198	002333	罗普斯金	4342	63306.36	0.20%
199	002612	朗姿股份	1721	63109.07	0.20%
200	002262	恩华药业	2154	63047.58	0.20%
201	002622	永大集团	2377	62824.11	0.20%
202	002035	华帝股份	4079	62612.65	0.20%
203	002392	北京利尔	3859	62554.39	0.20%
204	002293	罗莱家纺	1786	62402.84	0.20%
205	002484	江海股份	3328	61800.96	0.20%
206	002020	京新药业	2882	61530.70	0.19%
207	002277	友阿股份	3693	61488.45	0.19%
208	002511	中顺洁柔	4626	61294.50	0.19%
209	002276	万马股份	5481	61222.77	0.19%
211	002254	泰和新材	3830	61050.20	0.19%
212	002117	东港股份	2231	60906.30	0.19%
213	002069	獐子岛	4193	60882.36	0.19%
214	002013	中航机电	2185	60852.25	0.19%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

215	002393	力生制药	1531	60750.08	0.19%
216	002369	卓翼科技	4467	60706.53	0.19%
217	002628	成都路桥	9798	60649.62	0.19%
218	002086	东方海洋	3724	60626.72	0.19%
219	002025	航天电器	2483	60585.20	0.19%
220	002627	宜昌交运	3263	60528.65	0.19%
221	002502	骅威股份	2926	60158.56	0.19%
222	002302	西部建设	3566	60158.42	0.19%
223	002649	博彦科技	950	60078.00	0.19%
224	002047	宝鹰股份	6348	59861.64	0.19%
225	002554	惠博普	4503	59799.84	0.19%
226	002284	亚太股份	2651	59514.95	0.19%
227	002418	康盛股份	2817	59495.04	0.19%
228	002681	奋达科技	1218	59194.80	0.19%
229	002316	键桥通讯	5376	59189.76	0.19%
230	002332	仙琚制药	4128	59112.96	0.19%
231	002433	太安堂	3787	59001.46	0.19%
232	002138	顺络电子	2075	58909.25	0.19%
233	002014	永新股份	4907	58344.23	0.18%
234	002037	久联发展	2963	58252.58	0.18%
235	002435	长江润发	4269	57460.74	0.18%
236	002091	江苏国泰	2989	57358.91	0.18%
237	002449	国星光电	3791	57357.83	0.18%
238	002060	粤水电	6812	57357.04	0.18%
239	002096	南岭民爆	3369	57273.00	0.18%
240	002601	佰利联	1881	57201.21	0.18%
241	002516	江苏旷达	1761	57126.84	0.18%
242	002237	恒邦股份	2625	56962.50	0.18%
243	002140	东华科技	2693	56741.51	0.18%
244	002539	新都化工	2121	56397.39	0.18%
245	002534	杭锅股份	2570	56308.70	0.18%
246	002331	皖通科技	2033	56151.46	0.18%
247	002666	德联集团	1772	55286.40	0.17%
248	002454	松芝股份	2808	55036.80	0.17%
249	002168	深圳惠程	4609	54708.83	0.17%
250	002303	美盈森	2326	54707.52	0.17%
251	002358	森源电气	1182	54632.04	0.17%
252	002441	众业达	1859	54227.03	0.17%
253	002170	芭田股份	3944	54151.12	0.17%
254	002327	富安娜	3009	53951.37	0.17%
255	002062	宏润建设	7597	53938.70	0.17%
256	002521	齐峰新材	3779	53888.54	0.17%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

257	002567	唐人神	4777	53645.71	0.17%
258	002477	雏鹰农牧	4751	53638.79	0.17%
259	002233	塔牌集团	4732	53566.24	0.17%
260	002121	科陆电子	2334	53495.28	0.17%
261	002430	杭氧股份	4984	53478.32	0.17%
262	002518	科士达	2352	53366.88	0.17%
263	002339	积成电子	2665	53353.30	0.17%
264	002689	博林特	3692	53164.80	0.17%
265	002115	三维通信	4219	52906.26	0.17%
266	002495	佳隆股份	5026	52873.52	0.17%
267	002328	新朋股份	4711	52857.42	0.17%
268	002133	广宇集团	7352	52713.84	0.17%
269	002635	安洁科技	1324	52152.36	0.16%
270	002220	天宝股份	4492	52152.12	0.16%
271	002012	凯恩股份	6230	51958.20	0.16%
272	002032	苏泊尔	2555	51738.75	0.16%
273	002016	世荣兆业	3990	51670.50	0.16%
274	002548	金新农	4761	51609.24	0.16%
275	002386	天原集团	4765	51557.30	0.16%
276	002394	联发股份	3708	51318.72	0.16%
277	002042	华孚色纺	7039	51314.31	0.16%
278	002313	日海通讯	2904	51313.68	0.16%
279	002087	新野纺织	7919	51235.93	0.16%
280	002157	正邦科技	4514	51233.90	0.16%
281	002053	云南盐化	2373	51209.34	0.16%
282	002314	雅致股份	6960	51156.00	0.16%
283	002088	鲁阳股份	3572	51115.32	0.16%
284	002074	东源电器	2007	51017.94	0.16%
285	002527	新时达	1883	50765.68	0.16%
286	002206	海利得	4922	50696.60	0.16%
287	002077	大港股份	3810	50673.00	0.16%
288	002629	仁智油服	4546	50460.60	0.16%
289	002590	万安科技	2593	50356.06	0.16%
290	002165	红宝丽	5896	50233.92	0.16%
291	002377	国创高新	5466	50232.54	0.16%
292	002322	理工监测	2771	50182.81	0.16%
293	002630	华西能源	2447	50139.03	0.16%
294	002305	南国置业	6197	50071.76	0.16%
295	002600	江粉磁材	3277	49908.71	0.16%
296	002300	太阳电缆	5430	49630.20	0.16%
297	002398	建研集团	2467	49340.00	0.16%
298	002003	伟星股份	3964	48995.04	0.15%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

299	002147	方圆支承	3899	48932.45	0.15%
300	002682	龙洲股份	3984	48684.48	0.15%
301	002184	海得控制	1394	48664.54	0.15%
302	002071	长城影视	1951	48618.92	0.15%
303	002109	兴化股份	6065	48580.65	0.15%
304	002010	传化股份	5344	48470.08	0.15%
305	002018	华信国际	2896	48305.28	0.15%
306	002201	九鼎新材	3400	48212.00	0.15%
307	002546	新联电子	2856	47923.68	0.15%
308	002283	天润曲轴	3445	47609.90	0.15%
309	002176	江特电机	3015	47486.25	0.15%
310	002431	棕榈园林	1863	47301.57	0.15%
311	002101	广东鸿图	1995	47301.45	0.15%
312	002347	泰尔重工	3148	46653.36	0.15%
313	002402	和而泰	1506	46460.10	0.15%
314	002141	蓉胜超微	2699	46368.82	0.15%
315	002052	同洲电子	3641	46167.88	0.15%
316	002186	全聚德	2110	46124.60	0.15%
317	002578	闽发铝业	1879	45847.60	0.14%
318	002404	嘉欣丝绸	2419	45815.86	0.14%
319	002167	东方锆业	2758	45286.36	0.14%
320	002685	华东重机	1636	44826.40	0.14%
321	002541	鸿路钢构	2554	44184.20	0.14%
322	002664	信质电机	926	44133.16	0.14%
323	002295	精艺股份	3385	43937.30	0.14%
324	002317	众生药业	1789	43812.61	0.14%
325	002417	三元达	3986	42690.06	0.13%
326	002457	青龙管业	3442	42611.96	0.13%
327	002099	海翔药业	3184	42060.64	0.13%
328	002211	宏达新材	4699	41962.07	0.13%
329	002238	天威视讯	2092	41819.08	0.13%
330	002533	金杯电工	4416	41775.36	0.13%
331	002343	禾欣股份	2143	41488.48	0.13%
332	002144	宏达高科	1738	41486.06	0.13%
333	002528	英飞拓	2343	40651.05	0.13%
334	002123	荣信股份	4370	40291.40	0.13%
335	002596	海南瑞泽	3044	38993.64	0.12%
336	002135	东南网架	4206	38989.62	0.12%
337	002320	海峡股份	2433	38636.04	0.12%
338	002381	双箭股份	2127	38626.32	0.12%
339	002576	通达动力	1438	38020.72	0.12%
340	002662	京威股份	2315	37989.15	0.12%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

341	002389	南洋科技	2600	37804.00	0.12%
342	002356	浩宁达	834	37796.88	0.12%
343	002218	拓日新能	2954	37663.50	0.12%
344	002513	蓝丰生化	3083	37335.13	0.12%
345	002472	双环传动	2191	37225.09	0.12%
346	002231	奥维通信	2856	37070.88	0.12%
347	002182	云海金属	2618	36966.16	0.12%
348	002139	拓邦股份	1989	36577.71	0.12%
349	002054	德美化工	3101	36033.62	0.11%
350	002209	达意隆	2719	36026.75	0.11%
351	002451	摩恩电气	3315	35437.35	0.11%
352	002045	国光电器	3773	34824.79	0.11%
353	002452	长高集团	1819	34561.00	0.11%
354	002180	艾派克	1457	34254.07	0.11%
355	002212	南洋股份	3671	34140.30	0.11%
356	002360	同德化工	3601	33813.39	0.11%
357	002504	东光微电	1722	33785.64	0.11%
358	002406	远东传动	2518	33690.84	0.11%
359	002082	栋梁新材	2883	33529.29	0.11%
360	002112	三变科技	2367	32806.62	0.10%
361	002124	天邦股份	1956	32782.56	0.10%
362	002350	北京科锐	2276	32728.88	0.10%
363	002620	瑞和股份	1416	32426.40	0.10%
364	002584	西陇化工	1234	30874.68	0.10%
365	002255	海陆重工	2111	30525.06	0.10%
366	002593	日上集团	1882	30431.94	0.10%
367	002695	煌上煌	853	29735.58	0.09%
368	002674	兴业科技	1681	29720.08	0.09%
369	002143	印纪传媒	1346	29625.46	0.09%
370	002654	万润科技	1481	29501.52	0.09%
371	002365	永安药业	1786	29111.80	0.09%
372	002647	宏磊股份	1632	27874.56	0.09%
373	002545	东方铁塔	1396	26607.76	0.08%
374	002668	奥马电器	1104	25855.68	0.08%
375	002494	华斯股份	1323	25242.84	0.08%
376	002455	百川股份	2070	25191.90	0.08%
377	002193	山东如意	1684	23744.40	0.07%
378	002667	鞍重股份	593	23690.35	0.07%
379	002580	圣阳股份	863	22636.49	0.07%
380	002694	顾地科技	1630	20407.60	0.06%
381	002692	远程电缆	1251	20303.73	0.06%
382	002660	茂硕电源	2011	19184.94	0.06%

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

383	002617	露笑科技	818	19149.38	0.06%
384	002536	西泵股份	596	18952.80	0.06%
385	002636	金安国纪	1180	18042.20	0.06%
386	002661	克明面业	430	17376.30	0.05%
387	002696	百洋股份	1061	15946.83	0.05%
388	002676	顺威股份	653	15306.32	0.05%

7.2.3.2. 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.4. 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1. 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002241	歌尔声学	314,845.00	1.17
2	002736	国信证券	234,118.00	0.87
3	002557	洽洽食品	145,075.00	0.54
4	002415	海康威视	134,310.14	0.50
5	002304	洋河股份	102,192.00	0.38
6	002031	巨轮股份	101,042.00	0.38
7	002187	广百股份	90,564.00	0.34
8	002089	新海宜	84,881.00	0.32
9	002095	生意宝	69,842.00	0.26
10	002594	比亚迪	67,923.00	0.25
11	002565	上海绿新	67,665.00	0.25
12	002252	上海莱士	65,608.00	0.24
13	002024	苏宁云商	58,497.00	0.22
14	002142	宁波银行	57,355.00	0.21
15	002605	姚记扑克	57,063.96	0.21
16	002543	万和电气	55,088.00	0.21
17	002649	博彦科技	53,911.00	0.20
18	002433	太安堂	53,040.00	0.20
19	002195	二三四五	53,016.00	0.20
20	002520	日发精机	50,455.00	0.19

7.2.4.2. 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	284,785.38	1.06

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

2	002304	洋河股份	220,389.87	0.82
3	002024	苏宁云商	175,468.49	0.65
4	002252	上海莱士	136,478.92	0.51
5	002142	宁波银行	122,004.66	0.46
6	002557	洽洽食品	106,749.99	0.40
7	002241	歌尔声学	105,367.05	0.39
8	002500	山西证券	103,947.92	0.39
9	002081	金螳螂	99,508.16	0.37
10	002594	比亚迪	96,014.26	0.36
11	002450	康得新	89,284.02	0.33
12	002195	二三四五	89,281.00	0.33
13	002202	金风科技	87,352.00	0.33
14	002001	新和成	85,081.34	0.32
15	002649	博彦科技	84,838.00	0.32
16	002051	中工国际	84,705.14	0.32
17	002065	东华软件	80,512.34	0.30
18	002363	隆基机械	76,573.73	0.29
19	002496	辉丰股份	74,065.50	0.28
20	002303	美盈森	72,643.08	0.27

7.2.4.3. 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,004,502.33
卖出股票的收入（成交）总额	9,786,671.81

注：不考虑相关交易费用。

7.2.5. 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.6. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.7. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.2.8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.2.9. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.2.10.2. 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

7.2.10.3. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.10.4. 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.2.10.5. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.2.10.6. 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.2.11. 投资组合报告附注

7.2.11.1. 本报告期内，双力分级投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.2.11.2. 双力分级投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.2.11.3. 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,847.48
2	应收证券清算款	882,009.39
3	应收股利	-
4	应收利息	461.06
5	应收申购款	228,642.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	4,608.23
8	其他	-
9	合计	1,119,568.29

7.2.11.4. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.2.11.5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.2.11.5.1. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.2.11.5.2. 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8. 基金份额持有人信息

8.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

(报告期: 2015年3月24日-2015年6月30日)

8.1.1. 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额 比例	持有份额	占总份 额 比例
1,258	13,930.27	3,622,098.00	20.67%	13,902,186.29	79.33%

8.1.2. 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司 —传统保险产品	2796973	15.96%
2	郑淑女	964651	5.50%
3	杨震	772344	4.41%
4	徐步云	459306	2.62%
5	李锦山	409644	2.34%
6	朱洪宏	348595	1.99%
7	吴才云	324603	1.85%
8	杨楚杰	309328	1.77%
9	贵州省农村信用社 联合社企业年金计 划—中国银行股份 有限公司	233121	1.33%
10	司明辉	216259	1.23%

注: 以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

(报告期: 2015年1月1日-2015年3月23日)

8.2.1. 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

份额	持有人	户均持有的基	持有人结构
----	-----	--------	-------

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

级别	户数 (户)	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
国联 安双 力 A 中小 板综 指 (场 内简 称: 双力 A)	219	30,798.75	4,206,355.00	62.36%	2,538,571.00	37.64%
国联 安双 力 B 中小 板综 指 (场 内简 称: 双力 B)	398	16,947.05	293,930.00	4.36%	6,450,997.00	95.64%
国联 安双 力中 小板 综指 (场 内简 称: 国安 双 力)	617	7,849.20	1,228,277.00	25.36%	3,614,677.68	74.64%
合计	1,234	14,856.41	5,728,562.00	31.25%	12,604,245.68	68.75%

8.2.2. 期末上市基金前十名持有人

国联安双力A中小板综指 (场内简称: 双力A)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司	3706355	54.95%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	—传统保险产品		
2	郑淑女	500053	7.41%
3	国泰君安证券股份 有限公司	500000	7.41%
4	方向	222119	3.29%
5	杨楚杰	150012	2.22%
6	黄乐平	100010	1.48%
7	肖瑞华	100010	1.48%
8	张兰华	98700	1.46%
9	李荣	68600	1.02%
10	金关妹	50012	0.74%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双力B中小板综指（场内简称：双力B）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	周昭玲	763894	11.33%
2	郑淑女	424553	6.29%
3	杨凯	300027	4.45%
4	杨震	290000	4.30%
5	朱洪宏	252000	3.74%
6	中国对外经济贸易 信托有限公司—外 贸信托·或然赋利1 期证券	193730	2.87%
7	陈波	174200	2.58%
8	刘升喜	158600	2.35%
9	杨楚杰	150012	2.22%
10	刘丽丽	138700	2.06%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双力中小板综指（场内简称：国安双力）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司 —传统保险产品	511318	10.56%
2	贵州省农村信用社 联合社企业年金计 划—中国股份有 限公司	233121	4.81%
3	杨克艳	200752	4.15%
4	余胜义	158760	3.28%
5	李国伟	148963	3.08%
6	郑礼贞	110611	2.28%

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

7	李伟	106000	2.19%
8	杜焯	105807	2.18%
9	中国化学工程集团公司企业年金计划—中信银行股份有限公司	91121	1.88%
10	川渝中烟工业有限责任公司企业年金计划—招商银行	90223	1.86%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	2,914.86	0.02%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9. 开放式基金份额变动

9.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

（报告期：2015年3月24日-2015年6月30日）

单位：份

基金合同生效日（2015年3月24日）基金份额总额	18,332,807.68
本报告期基金总申购份额	14,247,312.14
减：本报告期基金总赎回份额	15,055,835.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,524,284.29

9.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

（报告期：2015年1月1日-2015年3月23日）

单位：份

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015 年半年度报告

项目	国联安双力 A 中小板综指 (场内简称: 双力 A)	国联安双力 B 中小板综指 (场内简称: 双力 B)	国联安双力中小板综指 (场内简称: 国安双力)
基金合同生效日(2012年3月23日)基金份额总额	179,140,090.00	179,140,091.00	450,829,005.27
本报告期初基金份额总额	8,144,124.00	8,144,125.00	4,805,198.46
本报告期基金总申购份额	-	-	18,174,486.62
减: 本报告期基金总赎回份额	-	-	20,935,126.40
本报告期基金拆分变动份额	-1,399,198.00	-1,399,198.00	2,798,396.00
本报告期末基金份额总额	6,744,926.00	6,744,927.00	4,842,954.68

注: 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

10. 重大事件揭示

10.1. 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2. 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2015年5月29日,基金管理人发布《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》。增聘冒浩先生担任本基金的基金经理。

2. 2015年6月4日,基金管理人发布《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》。黄志钢先生不再担任本基金的基金经理。

3. 2015年6月6日,基金管理人发布关于《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起谭晓雨女士担任我司总经理一职。公司董事长庾启斌先生不再代为履行总经理职责。上述事项已经2015年4月7日召开的国联安基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议审议通过。

4. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4. 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5. 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6. 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7. 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1. 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	8,452,657.11	100.00%	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。
- F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量;
- B 研究报告被基金采纳的情况;
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;
- E 由基金管理人提出课题, 证券经营机构提供的研究论文质量;
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名, 同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留, 并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单, 基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构, 租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求, 基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

10.7.2. 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8. 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于旗下基	中国证券报、上海	2015-01-08

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

	金所持万达信息 (300168) 和宏源证券 (000562) 估值调整的公告	证券报、证券时报、公司网站	
2	国联安双力中小板综指分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-01-21
3	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持东方财富 (300059) 和泰格医药 (300347) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-01-23
4	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持哈药股份 (600664) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-01-24
5	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持银座股份 (600858) 和三花股份 (002050) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-01-28
6	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和讯网申购、定投、转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-02-05
7	国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期到期的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-07
8	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华侨城 A (000069) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-07
9	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持久其软件 (002279) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-13
10	国联安基金管理有限公司关于网上直销平台调整相关费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-17
11	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持东方财富 (300059) 和硕贝德 (300322) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-17
12	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持鹏博士 (600804) 估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-25
13	国联安基金管理有限公司关于增加长量基金为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投、转换及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-02-27
14	国联安基金管理有限公司旗下部分基金参加数米基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-03-02
15	国联安双力中小板综指分级证券投资	中国证券报、上海	2015-03-05

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

	基金分级运作期届满与基金份额转换的公告	证券报、证券时报、公司网站	
16	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持众生药业（002317）估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-06
17	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持精诚铜业（002171）估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-07
18	关于国联安基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-09
19	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持永泰能源和城投控股估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-10
20	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持信邦制药估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-12
21	国联安双力中小板综指分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-13
22	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长安汽车估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-14
23	关于国联安基金管理有限公司旗下基金参与好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-03-16
24	关于国联安基金管理有限公司旗下基金参与和讯网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-03-16
25	关于国联安基金管理有限公司旗下基金参与数米基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-03-16
26	关于国联安基金管理有限公司旗下基金参与众禄基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-03-16
27	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华宇软件（300271）估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-14
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中科金财和华仁药业估值调整	中国证券报、上海证券报、证券时	2015-03-18

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

	的公告	报、公司网站	
29	国联安双力中小板综指分级证券投资基金之国安双力、双力 A、双力 B 暂停办理转托管业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-18
30	国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力 A、双力 B 终止上市的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-18
31	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中科金财和华仁药业估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-18
32	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中山证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-03-19
33	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持皖通科技估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-20
34	国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力 A、双力 B 终止上市的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-20
35	国联安基金管理有限公司关于调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-25
36	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持鑫龙电器估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-25
37	国联安双力中小板综指分级证券投资基金份额转换结果的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-26
38	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-27
39	国联安双力中小板综指分级证券投资基金 2014 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-30
40	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-04-01
41	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持桑德环境和传化股份估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-01
42	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华润双鹤估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时	2015-04-02

国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金) 2015 年半年度报告

		报、公司网站	
43	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持恒宝股份、宏达新材、久联发展及键桥通讯估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-03
44	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持黄河旋风、中国国旅估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-04
45	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持航天信息、三元达估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-04
46	国联安基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投、转换及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-07
47	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长电科技、阳光电源、金新农、艾派克、鼎立股份估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-09
48	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持招商地产、招商银行估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-10
49	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持银之杰估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-11
50	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华昌达、佳讯飞鸿、三诺生物、红日药业估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-15
51	国联安双力中小板综指分级证券投资基金 2015 年度 1 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-20
52	国联安基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-04-21
53	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宝鹰股份估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-23
54	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三钢闽光和金达威估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-25
55	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持蓝丰生化估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-04-25
56	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公	中国证券报、上海证券报、证券时	2015-04-30

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	司费率优惠活动的公告	报、证券日报、公司网站	
57	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持新开普估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-04
58	国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-06
59	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持江西长运和中源协和估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-09
60	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华平股份估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-09
61	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持昆仑万维、国脉科技、华西能源估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-13
62	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持雷曼光电、远望谷、海陆重工、海南瑞泽估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-14
63	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持一心堂估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-15
64	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-15
65	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融有限公司为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-05-19
66	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持延华智能(002178)估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-20
67	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-20
68	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-21
69	国联安基金管理有限公司关于调整网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-21
70	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持奥飞动漫、科陆电子估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时	2015-05-22

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015年半年度报告

	公告	报、公司网站	
71	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中国南车等股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-23
72	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持金螳螂和西部建设估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-23
73	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持北新建材、兆驰股份等股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-27
74	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持首开股份等股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-28
75	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-29
76	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三安光电股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-30
77	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持腾邦国际等股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-05-30
78	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海钢联、探路者、新华医疗股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-03
79	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持电广传媒等股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-04
80	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-04
81	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浩宁达股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-05
82	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持海亮股份股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-06
83	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-06-06
84	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浦发银行股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-10

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金)2015 年半年度报告

85	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-13
86	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三泰控股等股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-18
87	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持仁和药业股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-19
88	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-23
89	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长荣股份、华东医药股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-06-27
90	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-06-30

11. 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同约定，本基金于 2015 年 3 月 23 日(基金合同生效后三年期届满日)转换为上市开放式基金(LOF)。在转换日日终，双力 A、双力 B 的基金份额将以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。

12. 备查文件目录

12.1. 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)发行及募集的文件
- 2、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2. 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

12.3. 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一五年八月二十八日