

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 年年度报告
2015 年 12 月 31 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：二〇一六年三月二十八日

§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 2016 年 3 月 24 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。

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 12 月 31 日止。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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	10
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况	12
3.2 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	13
3.2.1 主要会计数据和财务指标	13
3.2.2 基金净值表现	14
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况	17
§4 管理人报告	17
4.1 基金管理人及基金经理情况	17
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.9 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	22
§5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	23
§6 审计报告	23
6.1 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	23
6.1.1 管理层对财务报表的责任	23
6.1.2 注册会计师的责任	23
6.1.3 审计意见	24
6.2 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	24
6.2.1 管理层对财务报表的责任	24
6.2.2 注册会计师的责任	25
6.2.3 审计意见	25
§7 年度财务报表	25
7.1 国联安双力中小板综指分级证券投资基金	25
7.1.1 资产负债表	25

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 年年度报告

7.1.2	利润表	27
7.1.3	所有者权益（基金净值）变动表	29
7.1.4	报表附注	30
7.2	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	55
7.2.1	资产负债表	55
7.2.2	利润表	57
7.2.3	所有者权益（基金净值）变动表	58
7.2.4	报表附注	59
§8	投资组合报告	82
8.1	国联安双力中小板综指分级证券投资基金	82
8.1.1	期末基金资产组合情况	82
8.1.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	82
8.1.4	报告期内股票投资组合的重大变动	92
8.1.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	94
8.1.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	94
8.1.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	94
8.1.8	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	94
8.1.9	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	94
8.1.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	94
8.1.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.1.12	投资组合报告附注	94
8.2	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	95
8.2.1	期末基金资产组合情况	95
8.2.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	96
8.2.3	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	97
8.2.4	报告期内股票投资组合的重大变动	107
8.2.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	108
8.2.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	108
8.2.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	108
8.2.8	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	108
8.2.9	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	108
8.2.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	108
8.2.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	109
8.2.12	投资组合报告附注	109
§9	基金份额持有人信息	110
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	110
9.2	期末上市基金前十名持有人	111
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	113
9.4	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	113
§10	开放式基金份额变动	113
10.1	国联安双力中小板综指分级证券投资基金	113
10.2	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	114
§11	重大事件揭示	114
11.1	基金份额持有人大会决议	114
11.2	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	114

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 年年度报告

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	115
11.4 基金投资策略的改变	115
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	115
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	115
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	115
11.8 其他重大事件	119
§12 备查文件目录	128
12.1 备查文件目录	128
12.2 存放地点	128
12.3 查阅方式	128

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	12,020,101.89 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
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

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。
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。

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 年年度报告

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。		
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		虞启斌	王洪章

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 年年度报告

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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 期间数据和指标	报告期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日
	国联安双力中小板(LOF)
本期已实现收益	8,046,027.93
本期利润	932,912.20
加权平均基金份额本期利润	0.0620
本期加权平均净值利润率	3.12%
本期基金份额净值增长率	18.17%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
	国联安双力中小板(LOF)

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 年年度报告

期末可供分配利润	11,345,161.83
期末可供分配基金份额利润	0.9438
期末基金资产净值	24,541,187.92
期末基金份额净值	2.042
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
	国联安双力中小板(LOF)
基金份额累计净值增长率	18.17%

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

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
过去三个月	34.52%	1.93%	33.16%	1.96%	1.36%	-0.03%
过去六个月	-6.84%	2.98%	-3.79%	2.81%	-3.05%	0.17%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金份额转换日次日起至今	18.17%	2.92%	24.51%	2.75%	-6.34%	0.17%

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

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 年年度报告

(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) 起至报告期末未满一年;

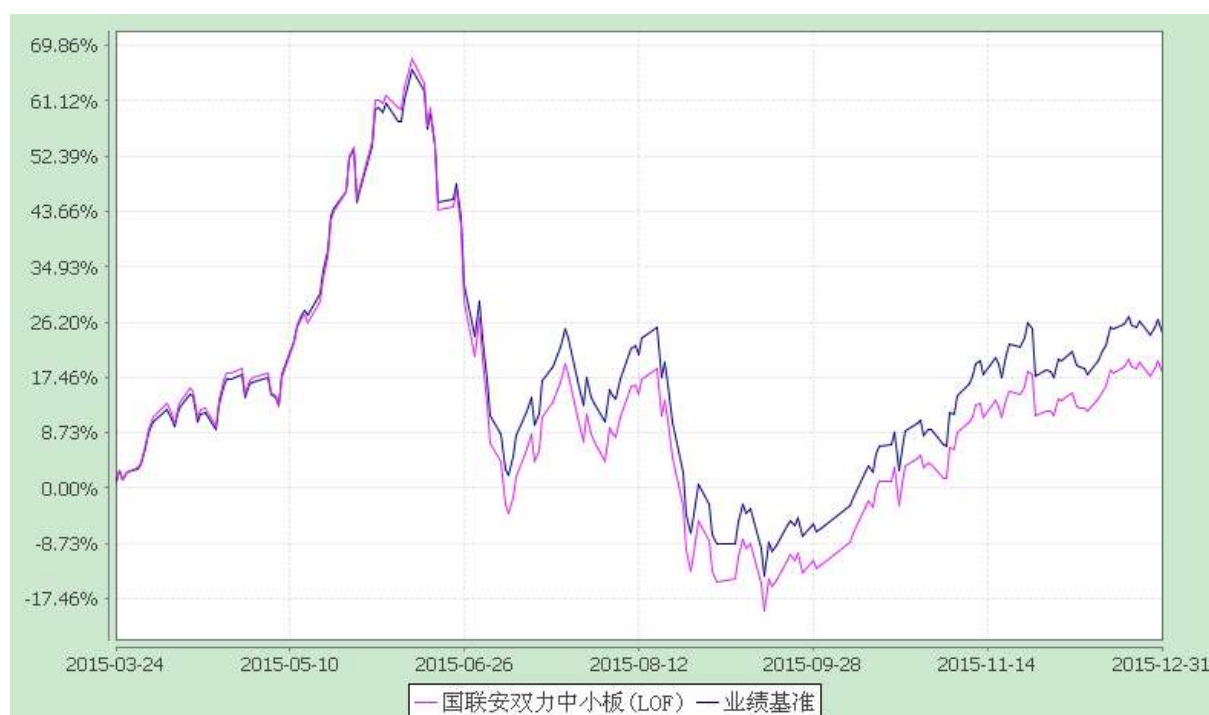
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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的历史走势对比图

(2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 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、本基金份额转换日次日 (2015 年 3 月 24 日) 起至报告期末未满一年;

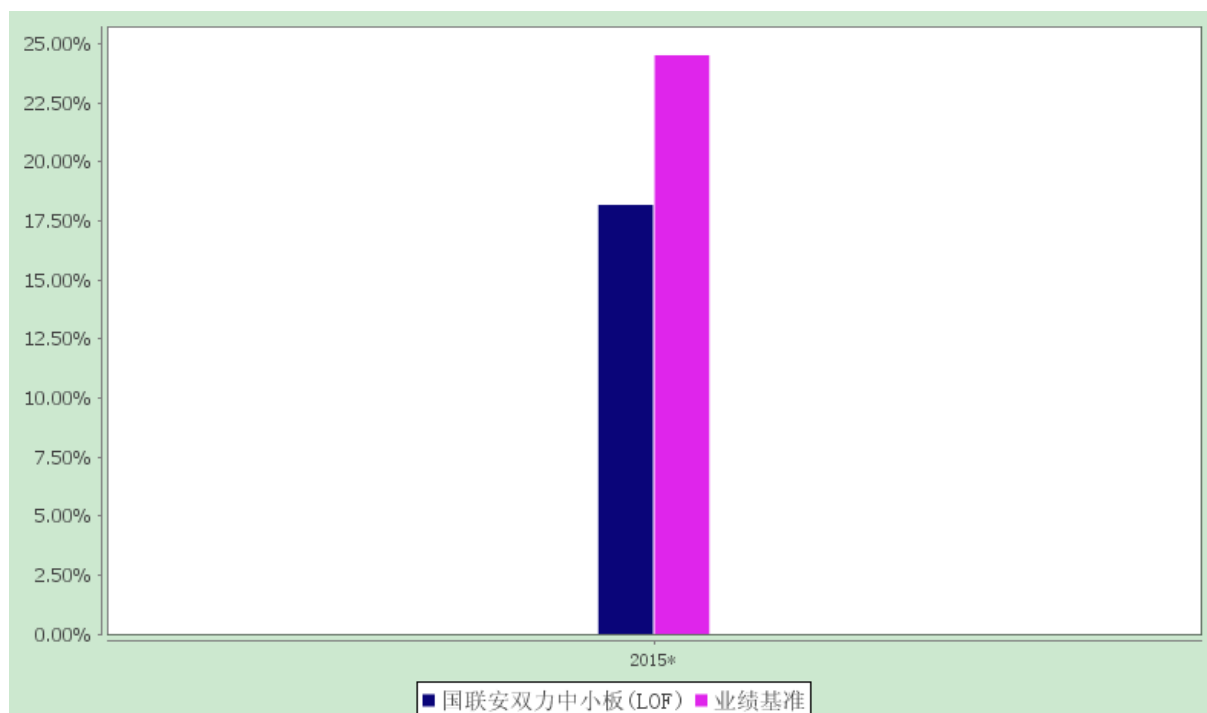
3、本基金业绩比较基准为: $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$;

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。

3.1.2.3 自基金转型以来基金每年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)
自基金转型以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



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）起至报告期末未满一年；

3、*基金转型当年按实际存续期计算的净值增长率；

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。

3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）自 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日止未进行收益分配。

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

3.2.1 期间数据和指标	2015 年 1 月 1 日-2015 年 3 月 23 日	2014 年 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日-2013 年 12 月 31 日
	国联安双力中小板综指分级	国联安双力中小板综指分级	国联安双力中小板综指分级
本期已实现收益	3,477,500.04	3,929,203.80	8,231,684.54
本期利润	9,611,963.05	7,154,630.52	23,938,272.95
加权平均基金份额本期利润	0.4304	0.2461	0.2474
本期加权平均净值利润率	30.47%	21.91%	25.53%
本期基金份额净值增长率	35.96%	24.74%	20.30%
3.2.2 期末数据和指标	2015 年 3 月 23 日	2014 年末	2013 年末
	国联安双力中小板综指分级	国联安双力中小板综指分级	国联安双力中小板综指分级
期末可供分配利润	7,632,313.90	5,203,958.50	3,153,441.50
期末可供分配基金份额利润	0.4163	0.2467	0.0851
期末基金资产	31,670,880.78	26,804,479.07	38,885,391.18

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 年年度报告

产净值			
期末基金份额净值	1.728	1.271	1.050
3.2.3 累计期末指标	2015 年 3 月 23 日	2014 年末	2013 年末
	国联安双力中小板综指分级	国联安双力中小板综指分级	国联安双力中小板综指分级
基金份额累计净值增长率	84.64%	35.81%	8.87%

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	84.64%	1.29%	106.09%	1.30%	-21.45%	-0.01%

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 年年度报告

年 4 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)						
过去五年(2010 年 4 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至基金份 额转换日(2012 年 3 月 23 日至 2015 年 3 月 23 日)	84.64%	1.28%	89.62%	1.31%	-4.98%	-0.03%

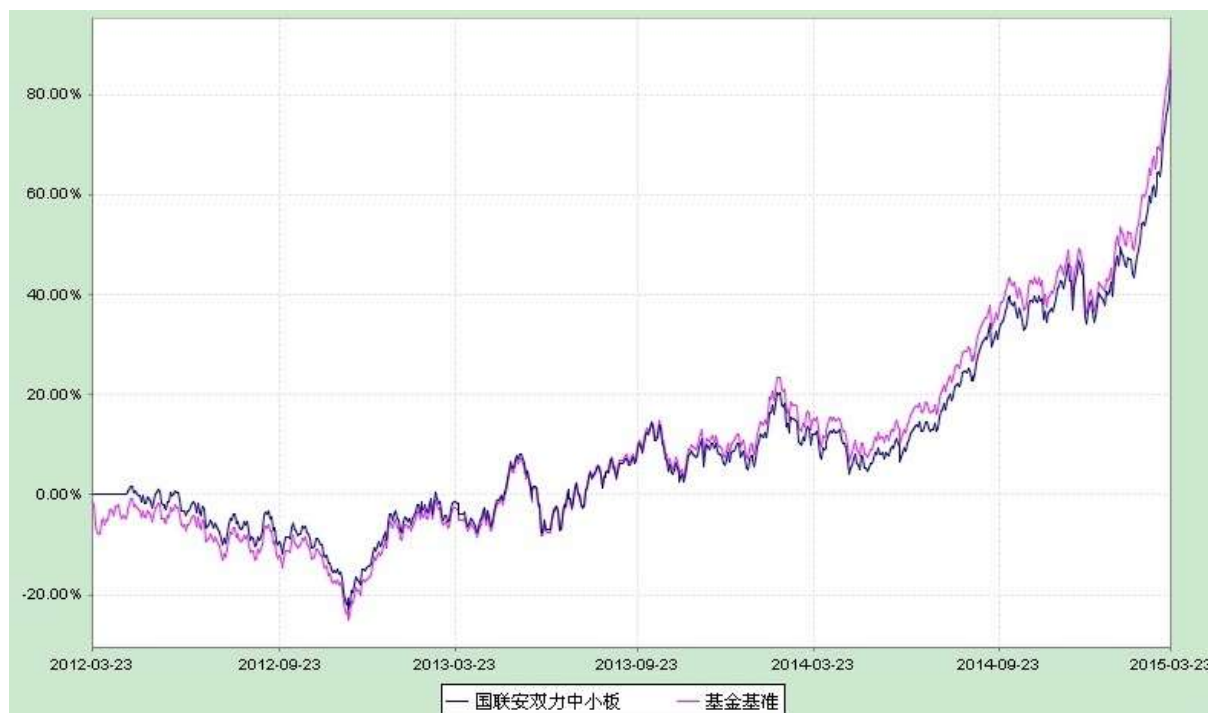
注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

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的历史走势对比图
(2012 年 3 月 23 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）”；

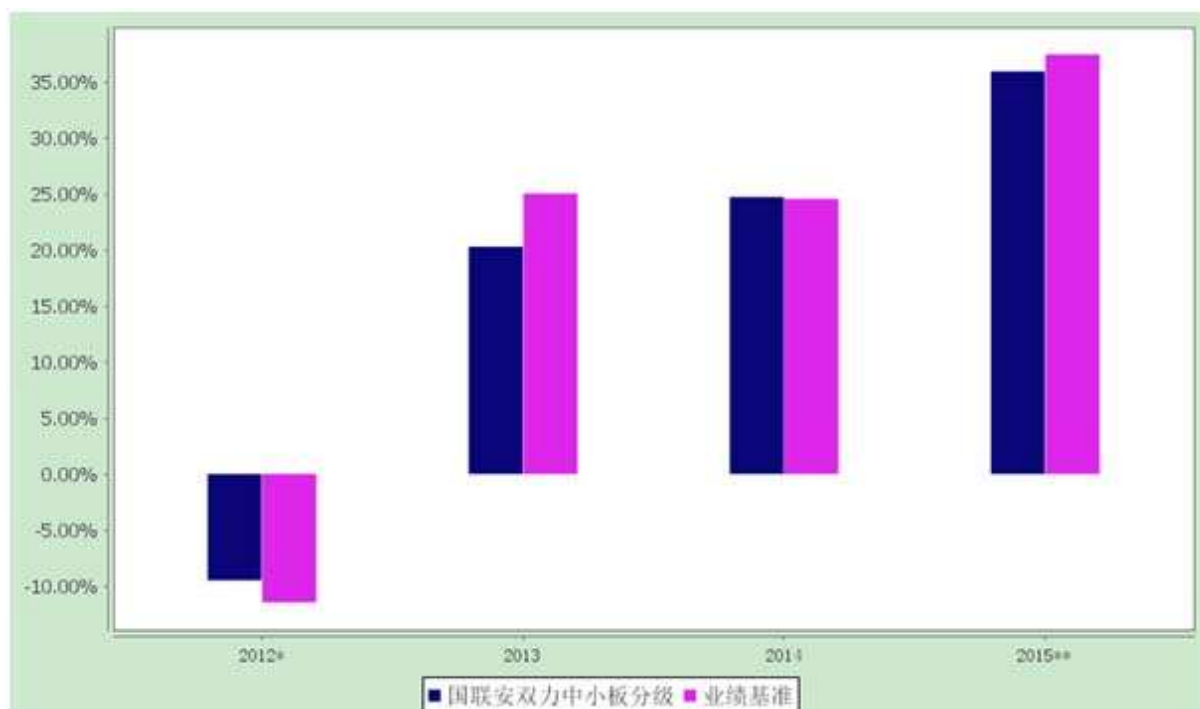
2、本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

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。

3.2.2.3 自基金合同生效以来基金每年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分级证券投资基金
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



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、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；

3、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

4、**基金转型当年按实际存续期计算的净值增长率；

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。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

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。

§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

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 年年度报告

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，公司共管理二十七只开放式基金。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的成功实践，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		
冒浩	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	2015-05-29	-	5 年（自 2010 年起）	冒浩，英国帝国理工大学硕士研究生毕业，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。
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。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	本基金基金经理助理	2015-04-02	2015-05-28	5 年（自 2010 年起）	-

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

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 公平交易制度和控制方法

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。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部定期对成交的银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。

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。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，执行了 95% 置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验，同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析，未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 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的说明

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 12 月 31 日)，本基金份额净值为 2.042 元。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 18.17%，同期业绩比较基准收益率为 24.51%。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 0.20%，符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35% 的限制；年化跟踪误差为 4.18%，不符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 4.0% 的限制，系第二季度和第三季度部分成份股长期停牌导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整所致。

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 年四季度，从宏观面来看，经济出现企稳迹象，投资稳定至 10.2%，消费从三季度 10.9% 略升至 11.2%。从经济面来看，经济数据还在低位徘徊；从政策面来看，对冲经济下行风险，化解金融系统性风险是重点，财政、货币政策继续积极。预计在资金面总体宽松、十三五规划展开、改革陆续推进的背景下，A 股市场仍维持结构性慢牛行情。

“十三五”开局之年，转型创新的新兴行业大概率更优，而我们判断 A 股明显的小市值公司效应也将继续延续，同时优秀的中小公司也将在这轮泡沫清洗以后继续享受政策红利，为投资人带来良好的绝对收益和相对收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在内部监察工作中本着一切合法合规运作的指导思想、以保障基金份额持有人利益为宗旨，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司的经营管理、基金的投资运作及员工的行为规范等方面进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门进行整改，并定期制作监察报告报公司管理层。具体来说，报告期内基金管理人的内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 随着相关法律法规的相继公布和实施，监管机构对基金行业的管理也日趋细化和深化。公司对合规经营和风险防范十分重视，为此，公司密切关注监管部门所颁布的各项最新的法律法规，紧跟监管机构的步伐，组织相应部门学习并贯彻落实相应法规。除及时对新进员工进行合规培训外，还在新的法律法规出台时安排了相关法律培训，使员工加深对法律法规及公司规范的理解，力求加强员工的合规意识。

(2) 报告期内，中国证监会进一步加强日常监管和自律监管，始终保持对资管行业违法行为的高压态势，查处大案、要案，且从依靠内部举报、突击检查，变为依靠大数据等更高效的技术手段，并将专户业务特别是子公司业务的风险管控作为了监管重点，强调了证券期货经营机构资产管理业务“八条底线”原则。公司在监管机构的指导下，进一步推动合规经营和风险防范，高度重视“八条底线”，多次通过邮件和培训等多种形式对投研人员加强教育、引导和监督，并加大了各项稽核力度。

(3) 通过组织各部门认真贯彻落实法规政策、定期自查、监察部门的定期/不定期的抽查，对公司业务的各个方面进行监督检查，包括基金投资、运作、销售以及信息披露等领域，以实现公司的合法合规经营，维护基金份额持有人、公司股东和公司的合法权益。

(4) 加强与托管行相关监督部门的日常联系。监察部门分别与托管银行的基金日常监督部门加强联系，确定了日常监督的工作方式、业务合作等，并完善日常监督方面的沟通与联系。

基金管理人将继续致力于维护一个有效率、效果的内部控制体系，以风险防范为核心，提高内

部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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，本基金本报告期末进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.9 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、2015 年 6 月 18 日-2015 年 9 月 30 日、2015 年 10 月 8 日-2015 年 12 月 31 日本基金资产净值低于 5000 万元。

基金管理人拟加大营销力度，并视市场情况考虑基金转型等方式以提升基金规模。

§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 审计报告

6.1 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

毕马威华振审字第 1600371 号

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)(以下简称“国联安双力基金(LOF)”)财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2015 年 3 月 24 日(转型后首日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是国联安双力基金(LOF)管理人国联安基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.1.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但

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 年年度报告

目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价国联安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.1.3 审计意见

我们认为，国联安双力基金(LOF)财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 7.2.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了国联安双力基金(LOF)2015 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2015 年 3 月 24 日(转型后首日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。

毕马威华振会计师事务所 中国注册会计师

王国蓓 张楠

上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼-

2016 年 3 月 25 日

6.2 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

毕马威华振审字第 1600370 号

国联安双力中小板综指分级证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称“国联安双力基金”)财务报表，包括 2015 年 3 月 23 日(分级运作期届满日)的资产负债表、自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日(分级运作期届满日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.2.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是国联安双力基金管理人国联安基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价国联安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.2.3 审计意见

我们认为，国联安双力基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 7.1.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了国联安双力基金 2015 年 3 月 23 日(分级运作期届满日)的财务状况以及自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日(分级运作期届满日)止期间的经营成果及基金净值变动情况。

毕马威华振会计师事务所 中国注册会计师
王国蓓 张楠
上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼-
2016 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

7.1.1 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

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 年年度报告

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	7.1.4.7.1	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	7.1.4.7.2	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	7.1.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-	-
应收证券清算款		882,009.39	832,405.72
应收利息	7.1.4.7.5	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	7.1.4.7.6	4,608.23	-
资产总计		32,164,257.27	27,705,014.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 3 月 23 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

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 年年度报告

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	7.1.4.7.7	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	7.1.4.7.8	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	7.1.4.7.9	17,150,609.79	19,730,852.65
未分配利润	7.1.4.7.10	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。

7.1.2 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-2015 年 3 月 23 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		9,800,698.55	7,938,344.74
1.利息收入		5,866.46	16,355.14

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 年年度报告

其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	5,866.46	16,355.14
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	4,643,896.07
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	3,620,570.89	4,358,644.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.1.4.7.14	-	-
股利收益	7.1.4.7.15	3,184.45	285,251.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.16	6,134,463.01	3,225,426.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.17	36,613.74	52,666.81
减：二、费用		188,735.50	783,714.22
1. 管理人报酬		70,146.59	327,817.42
2. 托管费		15,432.29	72,119.81
3. 销售服务费			
4. 交易费用	7.1.4.7.18	23,578.17	37,430.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.1.4.7.19	79,578.45	346,346.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,611,963.05	7,154,630.52-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,611,963.05	7,154,630.52

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 年年度报告

7.1.3 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 12 月 31 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）	35,731,949.68	3,153,441.50	38,885,391.18

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 年年度报告

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,154,630.52	7,154,630.52
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）	-16,001,097.03	-3,234,445.60	-19,235,542.63
其中：1.基金申购款	18,737,108.10	7,062,461.01	25,799,569.11
2.基金赎回款	-34,738,205.13	-10,296,906.61	-45,035,111.74
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）	19,730,852.65	7,073,626.42	26,804,479.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 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，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

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 年年度报告

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: $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

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封闭期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》, 本基金于 2015 年 3 月 23 日三年分级运作期届满, 自 2015 年 3 月 24 日起转换为上市开放式基金(LOF), 基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。

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。

7.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求, 同时亦按照中国证监会颁布的《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》编制财务报表。

本基金自 2015 年 3 月 24 日起转型为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”, 存续期为不定期, 因此本基金的财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的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(分级运作期届满日)的财务状况、自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日(分级运作期届满日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

7.1.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日(分级运作期届满日)止。

7.1.4.4.2 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。

7.1.4.4.3 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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券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。

7.1.4.4.4 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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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。

7.1.4.4.5 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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.1.4.4.6 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。

7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。因基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。因申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的，实收基金减少。

7.1.4.4.8 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)”。

7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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/(损失)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。

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、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。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

分级运作期内，本基金(包括双力 A 份额、双力 B 份额、双力中小板份额)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。

7.1.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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》，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。

7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.1.4.6 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[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (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

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 年年度报告

得税。

7.1.4.7重要财务报表项目的说明

7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015年3月23日	2014年12月31日
活期存款	1,456,596.02	1,220,850.88
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,456,596.02	1,220,850.88

7.1.4.7.2 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	-	-
	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
项目	上年度末		

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 年年度报告

		2014 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		18,284,035.62	25,615,228.54	7,331,192.92
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		18,284,035.62	25,615,228.54	7,331,192.92

7.1.4.7.3 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。（2014 年：零）

7.1.4.7.4 买入返售金融资产

7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2015 年 3 月 23 日）本基金未持有买入返售金融资产。（2014 年：零）

7.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2015 年 3 月 23 日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。（2014 年：零）

7.1.4.7.5 应收利息

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

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 年年度报告

应收活期存款利息	100.53	402.03
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	1.21
合计	461.06	403.24

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息。

7.1.4.7.6 其他资产

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
其他应收款	-	-
待摊费用	4,608.23	-
合计	4,608.23	-

注：上年末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有其他资产。

7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 3 月 23 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	12,203.88	4,711.22
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	12,203.88	4,711.22

7.1.4.7.8 其他负债

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 年年度报告

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,149.83	2,869.50
预提信息披露费	6,739.58	30,000.00
审计费	67,355.76	55,000.00
指数使用费	1,402.94	1,609.69
合计	76,648.11	89,479.19

7.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月23日	
	基金份额	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		
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。

7.1.4.7.10 未分配利润

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 年年度报告
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

7.1.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,444.99	16,291.76
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	63.38
合计	5,866.46	16,355.14

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。

7.1.4.7.12 股票投资收益

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 12 月 31 日
卖出股票成交总额	9,786,671.81	18,715,368.31
减：卖出股票成本总额	6,166,100.92	14,356,723.55
买卖股票差价收入	3,620,570.89	4,358,644.76

7.1.4.7.13 债券投资收益

7.1.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.1.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益买卖债券差价收入。

7.1.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.1.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.1.4.7.15 股利收益

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12月31日
股票投资产生的股利收益	3,184.45	285,251.31
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,184.45	285,251.31

7.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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12月31日
1.交易性金融资产	6,134,463.01	3,225,426.72
——股票投资	6,134,463.01	3,225,426.72
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-

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 年年度报告

——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	6,134,463.01	3,225,426.72

7.1.4.7.17 其他收入

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12月31日
基金赎回费收入	36,456.03	51,962.45
转换费收入	157.71	704.36
合计	36,613.74	52,666.81

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

7.1.4.7.18 交易费用

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12月31日
交易所市场交易费用	23,578.17	37,430.86
银行间市场交易费用	0.00	-
合计	23,578.17	37,430.86

7.1.4.7.19 其他费用

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12月31日
审计费用	12,355.76	55,000.00

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 年年度报告

信息披露费	6,739.58	30,000.00
银行划款费用	298.09	1,998.00
上市费	15,000.00	60,000.00
指数使用费	45,185.02	199,348.13
合计	79,578.45	346,346.13

7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.1.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.1.4.9 关联方关系

7.1.4.9.1 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。

7.1.4.9.2 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

7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

7.1.4.10.1.1 股票交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

7.1.4.10.1.2 权证交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

7.1.4.10.1.3 债券交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

7.1.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

7.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内与上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

7.1.4.10.2 关联方报酬

7.1.4.10.2.1 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12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	70,146.59	327,817.42
其中：支付销售机构的客户维护费	5,555.34	24,372.47

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。

7.1.4.10.2.2 基金托管费

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12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,432.29	72,119.81

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

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 年年度报告

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。

7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，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。

7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

7.1.4.10.4.2 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

国联安双力 A 中小板综指

份额单位：份

关联方名称	国联安双力 A 中小板综指 本期末 2015 年 3 月 23 日		国联安双力 A 中小板综指 上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安	-	-	500,000.00	6.14%

注：本期末，其他关联方均未投资本基金。

7.1.4.10.5 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 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12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,456,596.02	5,444.99	1,220,850.88	16,291.76

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。

7.1.4.10.6 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。

7.1.4.11 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。

7.1.4.12 期末（2015 年 3 月 23 日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.12.1 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 3 月 23 日）未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.1.4.12.2 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	-
002225	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	-

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 年年度报告

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	-
002316	键桥通讯	2015-02-17	重大事项停牌	11.01	2015-10-15	12.10	5,376.00	39,066.89	59,189.76	-
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	2015-12-08	14.56	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	-

7.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.12.3.1 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。

7.1.4.12.3.2 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。

7.1.4.13 金融工具风险及管理

7.1.4.13.1 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。

7.1.4.13.2 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。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。

7.1.4.13.2.1 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）”。

7.1.4.13.2.2 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）”。

7.1.4.13.3 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。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 7.1.4.12 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，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。

7.1.4.13.4 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。

7.1.4.13.4.1 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。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。

7.1.4.13.4.1.1 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	145659 6.02	-	-	-	-	-	-	-	-	1456 596.0 2
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
存出保证金	3847.4 8	-	-	-	-	-	-	-	-	3847. 48
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	-	-	-	29588 092.96	2958 8092. 96
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	88200 9.39	8820 09.39
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	461.06	461.0 6
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	22864 2.13	2286 42.13
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	4608.2 3	4608. 23
资产总计	146044 3.50	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	30703 813.77	3216 4257. 27
负债										
应付证券清	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 年年度报告

算款										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	38112 0.47	3811 20.47
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	19183. 62	1918 3.62
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4220.4 1	4220. 41
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	-	-	12203. 88	1220 3.88
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	76648. 11	7664 8.11
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	49337 6.49	4933 76.49
利率敏感度 缺口	146044 3.50	-	-	-	-	-	-	-	30210 437.28	3167 0880. 78
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	1,220,8 50.88	-	-	-	-	-	-	-	-	1,220 ,850. 88
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,387.8 4	-	-	-	-	-	-	-	-	2,387 .84
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	-	-	-	25,615 ,228.5 4	25,61 5,228 .54
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	832,40 5.72	832,4 05.72
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	403.24	403.2 4
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	33,738 .29	33,73 8.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	122323 8.72	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26481 775.79	2770 5014. 51

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 年年度报告

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

7.1.4.13.4.1.2 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)”。

7.1.4.13.4.2 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。

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。

7.1.4.13.4.3 其他价格风险

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 年年度报告

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：

7.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 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	29,588,092.96	93.42	25,615,228.54	95.56

7.1.4.13.4.3.2 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 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)

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 年年度报告

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) ”。

7.2 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

7.2.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-
银行存款	7.2.4.7.1	3,188,795.19
结算备付金		17,731.87
存出保证金		12,473.07
交易性金融资产	7.2.4.7.2	21,511,754.38
其中：股票投资		21,511,754.38
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	7.2.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.2.4.7.5	631.05
应收股利		-
应收申购款		1,587.28
递延所得税资产		-
其他资产	7.2.4.7.6	-
资产总计		24,732,972.84

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 年年度报告

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
负 债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		89.03
应付赎回款		65,279.46
应付管理人报酬		15,728.37
应付托管费		4,613.66
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.2.4.7.7	9,604.57
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.2.4.7.8	96,469.83
负债合计		191,784.92
所有者权益:		-
实收基金	7.2.4.7.9	11,245,301.70
未分配利润	7.2.4.7.10	13,295,886.22
所有者权益合计		24,541,187.92
负债和所有者权益总计		24,732,972.84

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.042 元，基金份额总额 12,020,101.89 份。

2、本基金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 12 月 31 日，无上年度数据（下同）。

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 年年度报告

7.2.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		1,510,117.97
1.利息收入		19,119.48
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	19,119.48
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）		8537147.90
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	8,385,892.54
基金投资收益		-
债券投资收益	7.2.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.2.4.7.14	-
股利收益	7.2.4.7.15	151,255.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	-7,113,115.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	66,966.32
减：二、费用		577205.77
1. 管理人报酬		173,067.78
2. 托管费		50,766.55
3. 销售服务费		-

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 年年度报告

4. 交易费用	7.2.4.7.18	80,748.06
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.2.4.7.19	272,623.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		932,912.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		932,912.20

7.2.3 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证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 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）	-	932,912.20	932,912.20
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）	-5,905,308.09	-2,157,296.97	-8,062,605.06
其中：1.基金申购款	18,568,203.28	28,602,482.23	47,170,685.51
2.基金赎回款	-24,473,511.37	-30,759,779.20	-55,233,290.57
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）	-	-	-

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 年年度报告

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	11,245,301.70	13,295,886.22	24,541,187.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 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”)由国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而成。国联安双力中小板综指分级证券投资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。根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》及《国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》，国联安双力中小板综指分级证券投资基金于 2015 年 3 月 23 日三年分级运作期届满，自 2015 年 3 月 24 日起转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金 LOF”。于基金分级运作期届满日 2015 年 3 月 23 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、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额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。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，转型后首日基金规模为 18,332,807.68 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证券投资基金(LOF)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

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 年年度报告

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)。

经深圳证券交易所深证上[2015] 207 号文件审核同意,本基金 11,000,077.00 份基金份额于 2015 年 5 月 20 日在深圳证券交易所上市交易。

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。

7.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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》编制财务报表。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况、自 2015 年 3 月 24 日(转型后首日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为自 2015 年 3 月 24 日(转型后首日)至 2015 年 12 月 31 日止。

7.2.4.4.2 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。

7.2.4.4.3 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、持有至到期投资、可供出

售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券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。

7.2.4.4.4 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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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：

—所转移金融资产的账面价值

—因转移而收到的对价

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。

7.2.4.4.5 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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交

易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.2.4.4.6 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。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。因基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。因申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的，实收基金减少。

7.2.4.4.8 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)”。

7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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/(损失)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。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

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。

7.2.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金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》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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》,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。

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、深圳证券交易所及银行间同业市场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。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

根据估值处理标准,本基金自 2015 年 3 月 26 日起,对本基金所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%。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.2.4.6 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[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (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。

7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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 年年度报告

活期存款	3,188,795.19
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,188,795.19

7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		15,159,214.18	21,511,754.38	6,352,540.20
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		15,159,214.18	21,511,754.38	6,352,540.20

7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2015 年 12 月 31 日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.2.4.7.4 买入返售金融资产

7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2015 年 12 月 31 日）本基金未持有买入返售金融资产。

7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2015 年 12 月 31 日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	616.08
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	8.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.16
合计	631.05

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息。

7.2.4.7.6 其他资产

本报告期末（2015 年 12 月 31 日）本基金未持有其他资产。

7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	9,604.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,604.57

7.2.4.7.8 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 年年度报告

	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	246.02
预提信息披露费	30,000.00
指数使用费	1,223.81
预提审计费	65,000.00
合计	96,469.83

7.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015年3月24日至2015年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	18,332,807.68	17,150,609.79
本期申购	19,847,082.74	18,568,203.28
本期赎回（以“-”号填列）	-26,159,788.53	-24,473,511.37
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	12,020,101.89	11,245,301.70

7.2.4.7.10 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
基金合同生效日	7,632,313.90	6,887,957.09	14,520,270.99
本期利润	8046027.93	-7,113,115.73	932,912.20
本期基金份额交易产生的变动数	-4,333,180.00	2,175,883.03	-2,157,296.97

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 年年度报告

其中：基金申购款	14,218,873.15	14,383,609.08	28,602,482.23
基金赎回款	-18,552,053.15	-12,207,726.05	-30,759,779.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,345,161.83	1,950,724.39	13,295,886.22

7.2.4.7.11 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 12 月 31 日
活期存款利息收入	18,725.64
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	275.46
其他	118.38
合计	19,119.48

注：此处其他列示的是基金申购款滞留利息及结算保证金利息收入。

7.2.4.7.12 股票投资收益

7.2.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,385,892.54
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	8,385,892.54

7.2.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	30,032,078.48
减：卖出股票成本总额	21,646,185.94
买卖股票差价收入	8,385,892.54

7.2.4.7.13 债券投资收益

7.2.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本期无债券投资收益。

7.2.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本期无债券投资收益买卖债券差价收入。

7.2.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期无债券投资收益赎回差价收入。

7.2.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本期无债券投资收益申购差价收入。

7.2.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.2.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	151,255.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	151,255.36

7.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-7,113,115.73
——股票投资	-7,113,115.73
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

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 年年度报告

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-7,113,115.73

7.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
基金赎回费收入	66,847.19
转换费收入	119.13
合计	66,966.32

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

7.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	80,748.06
银行间市场交易费用	0.00
合计	80,748.06

7.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
审计费用	52,644.24
信息披露费	23,260.42
银行划款费用	2,289.62
上市费	40,000.00

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 年年度报告

指数使用费	154,429.10
合计	272,623.38

7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.2.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.2.4.9 关联方关系

7.2.4.9.1 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。

7.2.4.9.2 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

7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

7.2.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

7.2.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

7.2.4.10.1.3 债券交易

本报告期内，本基金与关联方无债券交易。

7.2.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期，本基金与关联方无债券回购交易。

7.2.4.10.1.5 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。

7.2.4.10.2 关联方报酬

7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年3月24日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	173,067.78
其中：支付销售机构的客户维护费	40,311.95-

注：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。

7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年3月24日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	50,766.55

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。

7.2.4.10.3 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，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。

7.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1 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，基金管理人未投资本基金。

7.2.4.10.4.2 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，其他关联方均未投资本基金。

7.2.4.10.5 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 2015年3月24日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,188,795.19	18,725.64

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。

7.2.4.10.6 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，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.1.4.11 利润分配情况

本基金在自 2015 年 3 月 24 日(转型后首日)至 2015 年 12 月 31 日止期间未进行过利润分配。

7.2.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1 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 12 月 31 日）未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.2.4.12.2 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

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 年年度报告

002006	精工科技	2015-12-11	重大事 项停牌	14.70	-	-	3,298.00	52,207.34	48,480.60	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事 项停牌	16.72	2016-02-22	15.05	2,644.00	26,825.00	44,207.68	-
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	2015-12-29	重大事 项停牌	33.55	2016-01-20	30.20	1,382.00	8,353.70	46,366.10	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事 项停牌	17.40	-	-	1,659.00	14,994.12	28,866.60	-
002053	云南盐化	2015-11-19	重大事 项停牌	25.84	2016-03-14	23.26	1,573.00	14,900.37	40,646.32	-
002065	东华软件	2015-12-22	重大事 项停牌	25.10	-	-	4,700.00	98,413.85	117,970.00	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大事 项停牌	13.89	2016-01-21	21.21	12,180.00	294,930.00	169,180.20	-
002109	兴化股份	2015-05-08	重大事 项停牌	8.54	2016-01-04	9.39	3,465.00	26,919.50	29,591.10	-
002143	印纪传媒	2015-12-09	重大事 项停牌	40.55	2016-01-05	36.50	1,000.00	22,040.00	40,550.00	-
002147	方圆支承	2015-06-01	重大事 项停牌	17.90	2016-01-12	16.11	2,699.00	19,290.67	48,312.10	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事 项停牌	84.39	2016-02-15	80.58	700.00	71,400.00	59,073.00	-
002201	九鼎新材	2015-11-17	重大事 项停牌	16.01	-	-	1,900.00	10,996.98	30,419.00	-
002209	达意隆	2015-11-24	重大事 项停牌	22.91	-	-	1,300.00	19,058.00	29,783.00	-
002211	恒康医药	2015-07-07	重大事	18.18	-	-	7,212.00	52,758.48	131,114.16	-

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 年年度报告

9	疗	-08	项停牌							
002228	合兴包装	2015-08-04	重大事 项停牌	16.88	2016-02-02	15.21	2,523.00	34,023.74	42,588.24	-
002231	奥维通信	2015-12-03	重大事 项停牌	16.36	2016-03-17	16.00	1,600.00	19,264.00	26,176.00	-
002240	威华股份	2015-12-28	重大事 项停牌	13.68	2016-01-22	12.31	2,429.00	21,818.97	33,228.72	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事 项停牌	22.68	2016-01-11	20.41	2,400.00	57,600.00	54,432.00	-
002320	海峡股份	2015-06-26	重大事 项停牌	27.43	2016-01-07	24.69	2,433.00	23,308.14	66,737.19	-
002340	格林美	2015-12-29	重大事 项停牌	15.20	2016-01-06	14.35	1,000.00	11,384.47	15,200.00	-
002360	同德化工	2015-12-03	重大事 项停牌	12.32	2016-01-05	11.09	1,901.00	7,517.17	23,420.32	-
002371	七星电子	2015-10-08	重大事 项停牌	19.28	2016-01-11	21.21	2,300.00	129,030.00	44,344.00	-
002435	长江润发	2015-07-08	重大事 项停牌	10.06	2016-01-27	11.07	2,769.00	19,963.46	27,856.14	-
002465	海格通信	2015-12-30	重大事 项停牌	16.69	2016-02-04	15.02	6,174.00	141,847.65	103,044.06	-
002481	双塔食品	2015-07-07	重大事 项停牌	13.88	2016-01-04	12.49	5,000.00	82,000.00	69,400.00	-
002483	润邦股份	2015-09-30	重大事 项停牌	11.53	2016-03-11	10.38	3,587.00	89,316.30	41,358.11	-
002485	希努尔	2015-09-08	重大事 项停牌	15.14	-	-	3,025.00	34,543.09	45,798.50	-
002502	骅威股份	2015-08-20	重大事 项停牌	32.02	2016-01-14	23.35	1,526.00	40,859.09	48,862.52	-

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 年年度报告

002537	海立美达	2015-08-17	重大事件停牌	16.59	2016-02-18	18.25	3,452.00	23,912.84	57,268.68	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大事件停牌	29.65	-	-	2,126.00	33,080.12	63,035.90	-
002567	唐人神	2015-11-24	重大事件停牌	12.84	2016-02-25	11.56	3,277.00	27,250.10	42,076.68	-
002612	朗姿股份	2015-12-23	重大事件停牌	75.46	-	-	721.00	22,092.06	54,406.66	-
002622	永大集团	2015-07-02	重大事件停牌	25.28	2016-01-08	27.81	1,677.00	8,568.33	42,394.56	-
002631	德尔未来	2015-11-27	重大事件停牌	29.07	-	-	1,928.00	6,920.20	56,046.96	-
002638	勤上光电	2015-08-31	重大事件停牌	15.32	2016-01-19	16.85	2,599.00	44,992.52	39,816.68	-
002647	宏磊股份	2015-11-17	重大事件停牌	23.84	-	-	1,032.00	7,922.66	24,602.88	-
002664	信质电机	2015-12-30	重大事件停牌	31.77	2016-03-08	28.59	1,452.00	37,796.55	46,130.04	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事件停牌	17.21	2016-01-19	15.49	3,382.00	67,403.26	58,204.22	-
002696	百洋股份	2015-12-02	重大事件停牌	24.97	-	-	1,061.00	11,845.65	26,493.17	-

7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

7.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末（2015 年 12 月 31 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。

7.2.4.13 金融工具风险及管理

7.2.4.13.1 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。

7.2.4.13.2 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。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，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。

7.2.4.13.2.1 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）起至报告期末未满一年。

7.2.4.13.2.2 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）起至报告期末未满一年。

7.2.4.13.3 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。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 7.2.4.12 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，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。

7.2.4.13.4 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。

7.2.4.13.4.1 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。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。

7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

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 年年度报告

2015 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	3188795.19	-	-	-	-	-	3188795.19
结算备付金	17731.87	-	-	-	-	-	17731.87
结算保证金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	12473.07	-	-	-	-	-	12473.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	21511754.38	21511754.38
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	631.05	631.05
应收申购款	-	-	-	-	-	1587.28	1587.28
资产总计	3219000.13	-	-	-	-	21513972.71	24732972.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	65,279.46	65,279.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,728.37	15,728.37
应付托管费	-	-	-	-	-	4,613.66	4,613.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,604.57	9,604.57
其他负债	-	-	-	-	-	96,469.83	96,469.83
应付证券清算款	-	-	-	-	-	89.03	89.03
负债总计	-	-	-	-	-	191,784.92	191,784.92
利率敏感度缺口	3219000.13	0.00	0.00	0.00	0.00	21322187.79	24541187.92

7.2.4.13.4.1.2 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）起至报告期末未满一年。

7.2.4.13.4.2 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。

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。

7.2.4.13.4.3 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。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 87.66%，无债券投资和衍生金融资产。于 2015 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	21,511,754.38	87.66
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	21,511,754.38	87.66

7.2.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 1,298,439.10
	业绩比较基准下降 5%	减少 1,298,439.10

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 年年度报告

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）起至报告期末未满一年。

§8 投资组合报告

8.1 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

8.1.1 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	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

8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)

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 年年度报告

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

8.1.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.1.3 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

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	18,003	537,389.55	1.70
2	002304	洋河股份	5,103	404,259.66	1.28
3	002024	苏宁云商	28,228	366,117.16	1.16
4	002252	上海莱士	5,688	302,032.80	0.95

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 年年度报告

5	002081	金螳螂	10,340	299,446.40	0.95
6	002142	宁波银行	16,475	297,209.00	0.94
7	002065	东华软件	8,300	274,066.00	0.87
8	002500	山西证券	14,250	240,397.50	0.76
9	002241	歌尔声学	7,055	227,876.50	0.72
10	002594	比亚迪	4,114	218,494.54	0.69
11	002152	广电运通	5,400	205,524.00	0.65
12	002450	康得新	5,497	203,553.91	0.64
13	002183	怡亚通	6,158	199,642.36	0.63
14	002202	金风科技	12,327	199,450.86	0.63
15	002673	西部证券	4,490	197,829.40	0.62
16	002146	荣盛发展	10,330	195,030.40	0.62
17	002399	海普瑞	5,226	182,910.00	0.58
18	002736	国信证券	7,836	178,190.64	0.56
19	002230	科大讯飞	3,679	176,592.00	0.56
20	002051	中工国际	4,993	170,810.53	0.54
21	002187	广百股份	10,235	164,783.50	0.52
22	002405	四维图新	4,058	155,583.72	0.49
23	002285	世联行	4,702	153,896.46	0.49
24	002007	华兰生物	3,556	150,418.80	0.47
25	002236	大华股份	4,172	148,773.52	0.47
26	002344	海宁皮城	6,793	147,951.54	0.47
27	002385	大北农	6,006	144,144.00	0.46
28	002520	日发精机	3,787	143,300.08	0.45
29	002353	杰瑞股份	3,685	141,872.50	0.45
30	002129	中环股份	4,531	141,729.68	0.45
31	002030	达安基因	3,464	138,040.40	0.44
32	002470	金正大	3,649	137,932.20	0.44
33	002445	中南重工	4,557	131,469.45	0.42
34	002031	巨轮股份	7,591	130,413.38	0.41
35	002153	石基信息	1,065	130,249.50	0.41
36	002557	洽洽食品	5,135	127,039.90	0.40
37	002367	康力电梯	8,012	125,948.64	0.40
38	002311	海大集团	6,983	124,995.70	0.39
39	002375	亚厦股份	4,502	122,769.54	0.39
40	002038	双鹭药业	2,330	121,346.40	0.38
41	002279	久其软件	2,128	120,657.60	0.38
42	002008	大族激光	6,062	119,785.12	0.38
43	002171	精诚铜业	6,609	118,895.91	0.38
44	002219	恒康医疗	3,714	118,476.60	0.37
45	002001	新和成	6,609	116,582.76	0.37
46	002095	生意宝	1,308	116,098.08	0.37
47	002416	爱施德	6,315	115,627.65	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 年年度报告

48	002429	兆驰股份	10,358	115,595.28	0.36
49	002570	贝因美	5,837	115,455.86	0.36
50	002564	天沃科技	9,063	110,387.34	0.35
51	002223	鱼跃医疗	3,234	108,403.68	0.34
52	002055	得润电子	4,383	107,821.80	0.34
53	002456	欧菲光	4,183	107,670.42	0.34
54	002544	杰赛科技	3,326	106,598.30	0.34
55	002474	榕基软件	6,285	106,593.60	0.34
56	002540	亚太科技	3,469	106,151.40	0.34
57	002299	圣农发展	6,476	106,012.12	0.33
58	002400	省广股份	3,143	105,604.80	0.33
59	002372	伟星新材	5,646	103,604.10	0.33
60	002588	史丹利	1,970	101,258.00	0.32
61	002440	闰土股份	3,593	100,208.77	0.32
62	002203	海亮股份	9,549	99,787.05	0.32
63	002267	陕天然气	6,640	98,670.40	0.31
64	002177	御银股份	7,992	98,541.36	0.31
65	002269	美邦服饰	6,190	96,997.30	0.31
66	002128	露天煤业	8,663	95,986.04	0.30
67	002244	滨江集团	8,260	94,659.60	0.30
68	002004	华邦颖泰	3,176	94,644.80	0.30
69	002292	奥飞动漫	2,056	94,473.20	0.30
70	002444	巨星科技	5,906	94,259.76	0.30
71	002208	合肥城建	5,529	93,716.55	0.30
72	002190	成飞集成	2,126	92,714.86	0.29
73	002574	明牌珠宝	6,096	92,354.40	0.29
74	002232	启明信息	5,707	92,168.05	0.29
75	002108	沧州明珠	4,294	91,891.60	0.29
76	002565	上海绿新	9,288	91,858.32	0.29
77	002650	加加食品	6,366	91,415.76	0.29
78	002191	劲嘉股份	4,192	90,924.48	0.29
79	002179	中航光电	2,901	89,437.83	0.28
80	002063	远光软件	2,927	89,244.23	0.28
81	002204	大连重工	5,997	88,575.69	0.28
82	002422	科伦药业	2,273	88,487.89	0.28
83	002396	星网锐捷	2,242	88,200.28	0.28
84	002631	德尔家居	3,514	88,166.26	0.28
85	002085	万丰奥威	2,235	87,612.00	0.28
86	002301	齐心集团	5,322	87,546.90	0.28
87	002364	中恒电气	2,126	87,314.82	0.28
88	002436	兴森科技	2,044	86,870.00	0.27
89	002156	通富微电	7,067	86,853.43	0.27
90	002039	黔源电力	5,272	86,566.24	0.27

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 年年度报告

91	002050	三花股份	4,711	86,211.30	0.27
92	002340	格林美	4,920	86,001.60	0.27
93	002462	嘉事堂	2,023	85,977.50	0.27
94	002522	浙江众成	2,594	85,083.20	0.27
95	002618	丹邦科技	2,274	84,933.90	0.27
96	002310	东方园林	3,624	84,149.28	0.27
97	002503	搜于特	3,228	83,928.00	0.27
98	002489	浙江永强	4,480	83,820.80	0.26
99	002556	辉隆股份	5,168	83,773.28	0.26
100	002478	常宝股份	5,620	83,738.00	0.26
101	002492	恒基达鑫	6,368	83,675.52	0.26
102	002308	威创股份	5,456	83,258.56	0.26
103	002294	信立泰	1,874	82,980.72	0.26
104	002701	奥瑞金	2,439	82,804.05	0.26
105	002228	合兴包装	4,723	82,558.04	0.26
106	002432	九安医疗	2,291	82,315.63	0.26
107	002092	中泰化学	8,113	81,454.52	0.26
108	002073	软控股份	4,455	81,348.30	0.26
109	002510	天汽模	6,743	81,320.58	0.26
110	002641	永高股份	5,130	81,054.00	0.26
111	002488	金固股份	1,370	80,693.00	0.25
112	002537	海立美达	2,726	80,117.14	0.25
113	002362	汉王科技	2,472	80,092.80	0.25
114	002605	姚记扑克	3,393	79,973.01	0.25
115	002110	三钢闽光	9,276	78,938.76	0.25
116	002298	鑫龙电器	6,388	78,827.92	0.25
117	002439	启明星辰	1,742	78,564.20	0.25
118	002185	华天科技	4,550	78,487.50	0.25
119	002041	登海种业	2,155	78,355.80	0.25
120	002097	山河智能	5,951	78,196.14	0.25
121	002287	奇正藏药	2,651	78,177.99	0.25
122	002240	威华股份	4,229	78,151.92	0.25
123	002419	天虹商场	5,225	77,748.00	0.25
124	002104	恒宝股份	3,559	77,550.61	0.24
125	002646	青青稞酒	2,787	77,367.12	0.24
126	002011	盾安环境	5,172	76,855.92	0.24
127	002221	东华能源	2,768	76,728.96	0.24
128	002056	横店东磁	2,683	76,706.97	0.24
129	002022	科华生物	2,482	75,998.84	0.24
130	002155	辰州矿业	6,505	75,848.30	0.24
131	002089	新海宜	4,158	75,550.86	0.24
132	002325	洪涛股份	3,755	75,325.30	0.24
133	002266	浙富控股	7,098	75,238.80	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 年年度报告

134	002083	孚日股份	11,413	75,097.54	0.24
135	002428	云南锗业	4,134	74,825.40	0.24
136	002080	中材科技	4,474	74,805.28	0.24
137	002005	德豪润达	7,611	74,663.91	0.24
138	002226	江南化工	5,206	74,289.62	0.23
139	002029	七匹狼	5,786	74,176.52	0.23
140	002665	首航节能	1,337	73,789.03	0.23
141	002479	富春环保	5,266	73,671.34	0.23
142	002366	丹甫股份	1,496	73,588.24	0.23
143	002122	天马股份	9,120	72,960.00	0.23
144	002271	东方雨虹	1,699	72,887.10	0.23
145	002482	广田股份	3,266	72,766.48	0.23
146	002626	金达威	2,168	72,649.68	0.23
147	002543	万和电气	5,074	72,405.98	0.23
148	002280	联络互动	521	72,366.90	0.23
149	002443	金洲管道	7,346	71,990.80	0.23
150	002384	东山精密	5,133	71,810.67	0.23
151	002461	珠江啤酒	4,442	71,782.72	0.23
152	002242	九阳股份	4,969	71,752.36	0.23
153	002345	潮宏基	5,434	71,728.80	0.23
154	002275	桂林三金	3,249	71,413.02	0.23
155	002154	报喜鸟	4,542	71,127.72	0.22
156	002118	紫鑫药业	3,927	71,117.97	0.22
157	002064	华峰氨纶	5,107	71,038.37	0.22
158	002093	国脉科技	5,253	70,915.50	0.22
159	002251	步步高	3,350	70,886.00	0.22
160	002224	三力士	5,885	70,620.00	0.22
161	002535	林州重机	6,462	70,048.08	0.22
162	002602	世纪华通	2,611	69,400.38	0.22
163	002675	东诚药业	2,867	69,324.06	0.22
164	002531	天顺风能	3,693	69,206.82	0.22
165	002485	希努尔	4,325	69,113.50	0.22
166	002078	太阳纸业	12,908	69,057.80	0.22
167	002195	二三四五	1,090	67,961.50	0.21
168	002079	苏州固锝	6,104	67,937.52	0.21
169	002523	天桥起重	7,600	67,716.00	0.21
170	002382	蓝帆医疗	2,736	67,524.48	0.21
171	002100	天康生物	4,418	67,507.04	0.21
172	002501	利源精制	2,102	66,885.64	0.21
173	002550	千红制药	2,208	66,681.60	0.21
174	002463	沪电股份	10,927	66,436.16	0.21
175	002559	亚威股份	2,350	66,387.50	0.21
176	002023	海特高新	2,055	66,376.50	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 年年度报告

177	002273	水晶光电	2,608	66,347.52	0.21
178	002106	莱宝高科	4,158	66,320.10	0.21
179	002309	中利科技	2,342	66,278.60	0.21
180	002597	金禾实业	3,139	65,919.00	0.21
181	002216	三全食品	2,521	65,672.05	0.21
182	002321	华英农业	6,554	65,671.08	0.21
183	002307	北新路桥	4,269	65,401.08	0.21
184	002642	荣之联	1,087	65,220.00	0.21
185	002028	思源电气	4,005	65,201.40	0.21
186	002048	宁波华翔	3,859	65,178.51	0.21
187	002161	远望谷	4,289	64,678.12	0.20
188	002107	沃华医药	1,969	64,484.75	0.20
189	002335	科华恒盛	1,908	64,433.16	0.20
190	002663	普邦园林	2,828	64,308.72	0.20
191	002638	勤上光电	3,757	64,207.13	0.20
192	002256	彩虹精化	3,512	64,129.12	0.20
193	002250	联化科技	3,427	63,879.28	0.20
194	002363	隆基机械	1,712	63,652.16	0.20
195	002614	蒙发利	3,093	63,623.01	0.20
196	002589	瑞康医药	1,112	63,395.12	0.20
197	002581	万昌科技	1,111	63,315.89	0.20
198	002333	罗普斯金	4,342	63,306.36	0.20
199	002612	朗姿股份	1,721	63,109.07	0.20
200	002262	恩华药业	2,154	63,047.58	0.20
201	002622	永大集团	2,377	62,824.11	0.20
202	002035	华帝股份	4,079	62,612.65	0.20
203	002392	北京利尔	3,859	62,554.39	0.20
204	002293	罗莱家纺	1,786	62,402.84	0.20
205	002484	江海股份	3,328	61,800.96	0.20
206	002020	京新药业	2,882	61,530.70	0.19
207	002277	友阿股份	3,693	61,488.45	0.19
208	002511	中顺洁柔	4,626	61,294.50	0.19
209	002276	万马股份	5,481	61,222.77	0.19
211	002254	泰和新材	3,830	61,050.20	0.19
212	002117	东港股份	2,231	60,906.30	0.19
213	002069	獐子岛	4,193	60,882.36	0.19
214	002013	中航机电	2,185	60,852.25	0.19
215	002393	力生制药	1,531	60,750.08	0.19
216	002369	卓翼科技	4,467	60,706.53	0.19
217	002628	成都路桥	9,798	60,649.62	0.19
218	002086	东方海洋	3,724	60,626.72	0.19
219	002025	航天电器	2,483	60,585.20	0.19
220	002627	宜昌交运	3,263	60,528.65	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 年年度报告

221	002502	骅威股份	2,926	60,158.56	0.19
222	002302	西部建设	3,566	60,158.42	0.19
223	002649	博彦科技	950	60,078.00	0.19
224	002047	宝鹰股份	6,348	59,861.64	0.19
225	002554	惠博普	4,503	59,799.84	0.19
226	002284	亚太股份	2,651	59,514.95	0.19
227	002418	康盛股份	2,817	59,495.04	0.19
228	002681	奋达科技	1,218	59,194.80	0.19
229	002316	键桥通讯	5,376	59,189.76	0.19
230	002332	仙琚制药	4,128	59,112.96	0.19
231	002433	太安堂	3,787	59,001.46	0.19
232	002138	顺络电子	2,075	58,909.25	0.19
233	002014	永新股份	4,907	58,344.23	0.18
234	002037	久联发展	2,963	58,252.58	0.18
235	002435	长江润发	4,269	57,460.74	0.18
236	002091	江苏国泰	2,989	57,358.91	0.18
237	002449	国星光电	3,791	57,357.83	0.18
238	002060	粤水电	6,812	57,357.04	0.18
239	002096	南岭民爆	3,369	57,273.00	0.18
240	002601	佰利联	1,881	57,201.21	0.18
241	002516	江苏旷达	1,761	57,126.84	0.18
242	002237	恒邦股份	2,625	56,962.50	0.18
243	002140	东华科技	2,693	56,741.51	0.18
244	002539	新都化工	2,121	56,397.39	0.18
245	002534	杭锅股份	2,570	56,308.70	0.18
246	002331	皖通科技	2,033	56,151.46	0.18
247	002666	德联集团	1,772	55,286.40	0.17
248	002454	松芝股份	2,808	55,036.80	0.17
249	002168	深圳惠程	4,609	54,708.83	0.17
250	002303	美盈森	2,326	54,707.52	0.17
251	002358	森源电气	1,182	54,632.04	0.17
252	002441	众业达	1,859	54,227.03	0.17
253	002170	芭田股份	3,944	54,151.12	0.17
254	002327	富安娜	3,009	53,951.37	0.17
255	002062	宏润建设	7,597	53,938.70	0.17
256	002521	齐峰新材	3,779	53,888.54	0.17
257	002567	唐人神	4,777	53,645.71	0.17
258	002477	雏鹰农牧	4,751	53,638.79	0.17
259	002233	塔牌集团	4,732	53,566.24	0.17
260	002121	科陆电子	2,334	53,495.28	0.17
261	002430	杭氧股份	4,984	53,478.32	0.17
262	002518	科士达	2,352	53,366.88	0.17
263	002339	积成电子	2,665	53,353.30	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 年年度报告

264	002689	博林特	3,692	53,164.80	0.17
265	002115	三维通信	4,219	52,906.26	0.17
266	002495	佳隆股份	5,026	52,873.52	0.17
267	002328	新朋股份	4,711	52,857.42	0.17
268	002133	广宇集团	7,352	52,713.84	0.17
269	002635	安洁科技	1,324	52,152.36	0.16
270	002220	天宝股份	4,492	52,152.12	0.16
271	002012	凯恩股份	6,230	51,958.20	0.16
272	002032	苏泊尔	2,555	51,738.75	0.16
273	002016	世荣兆业	3,990	51,670.50	0.16
274	002548	金新农	4,761	51,609.24	0.16
275	002386	天原集团	4,765	51,557.30	0.16
276	002394	联发股份	3,708	51,318.72	0.16
277	002042	华孚色纺	7,039	51,314.31	0.16
278	002313	日海通讯	2,904	51,313.68	0.16
279	002087	新野纺织	7,919	51,235.93	0.16
280	002157	正邦科技	4,514	51,233.90	0.16
281	002053	云南盐化	2,373	51,209.34	0.16
282	002314	雅致股份	6,960	51,156.00	0.16
283	002088	鲁阳股份	3,572	51,115.32	0.16
284	002074	东源电器	2,007	51,017.94	0.16
285	002527	新时达	1,883	50,765.68	0.16
286	002206	海利得	4,922	50,696.60	0.16
287	002077	大港股份	3,810	50,673.00	0.16
288	002629	仁智油服	4,546	50,460.60	0.16
289	002590	万安科技	2,593	50,356.06	0.16
290	002165	红宝丽	5,896	50,233.92	0.16
291	002377	国创高新	5,466	50,232.54	0.16
292	002322	理工监测	2,771	50,182.81	0.16
293	002630	华西能源	2,447	50,139.03	0.16
294	002305	南国置业	6,197	50,071.76	0.16
295	002600	江粉磁材	3,277	49,908.71	0.16
296	002300	太阳电缆	5,430	49,630.20	0.16
297	002398	建研集团	2,467	49,340.00	0.16
298	002003	伟星股份	3,964	48,995.04	0.15
299	002147	方圆支承	3,899	48,932.45	0.15
300	002682	龙洲股份	3,984	48,684.48	0.15
301	002184	海得控制	1,394	48,664.54	0.15
302	002071	长城影视	1,951	48,618.92	0.15
303	002109	兴化股份	6,065	48,580.65	0.15
304	002010	传化股份	5,344	48,470.08	0.15
305	002018	华信国际	2,896	48,305.28	0.15
306	002201	九鼎新材	3,400	48,212.00	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 年年度报告

307	002546	新联电子	2,856	47,923.68	0.15
308	002283	天润曲轴	3,445	47,609.90	0.15
309	002176	江特电机	3,015	47,486.25	0.15
310	002431	棕榈园林	1,863	47,301.57	0.15
311	002101	广东鸿图	1,995	47,301.45	0.15
312	002347	泰尔重工	3,148	46,653.36	0.15
313	002402	和而泰	1,506	46,460.10	0.15
314	002141	蓉胜超微	2,699	46,368.82	0.15
315	002052	同洲电子	3,641	46,167.88	0.15
316	002186	全聚德	2,110	46,124.60	0.15
317	002578	闽发铝业	1,879	45,847.60	0.14
318	002404	嘉欣丝绸	2,419	45,815.86	0.14
319	002167	东方锆业	2,758	45,286.36	0.14
320	002685	华东重机	1,636	44,826.40	0.14
341	002389	南洋科技	2,600	37,804.00	0.12
342	002356	浩宁达	834	37,796.88	0.12
343	002218	拓日新能	2,954	37,663.50	0.12
344	002513	蓝丰生化	3,083	37,335.13	0.12
345	002472	双环传动	2,191	37,225.09	0.12
346	002231	奥维通信	2,856	37,070.88	0.12
347	002182	云海金属	2,618	36,966.16	0.12
348	002139	拓邦股份	1,989	36,577.71	0.12
349	002054	德美化工	3,101	36,033.62	0.11
350	002209	达意隆	2,719	36,026.75	0.11
351	002451	摩恩电气	3,315	35,437.35	0.11
352	002045	国光电器	3,773	34,824.79	0.11
353	002452	长高集团	1,819	34,561.00	0.11
354	002180	艾派克	1,457	34,254.07	0.11
355	002212	南洋股份	3,671	34,140.30	0.11
356	002360	同德化工	3,601	33,813.39	0.11
357	002504	东光微电	1,722	33,785.64	0.11
358	002406	远东传动	2,518	33,690.84	0.11
359	002082	栋梁新材	2,883	33,529.29	0.11
360	002112	三变科技	2,367	32,806.62	0.10
361	002124	天邦股份	1,956	32,782.56	0.10
362	002350	北京科锐	2,276	32,728.88	0.10
363	002620	瑞和股份	1,416	32,426.40	0.10
364	002584	西陇化工	1,234	30,874.68	0.10
365	002255	海陆重工	2,111	30,525.06	0.10
366	002593	日上集团	1,882	30,431.94	0.10
367	002695	煌上煌	853	29,735.58	0.09
368	002674	兴业科技	1,681	29,720.08	0.09
369	002143	印纪传媒	1,346	29,625.46	0.09

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 年年度报告

370	002654	万润科技	1,481	29,501.52	0.09
371	002365	永安药业	1,786	29,111.80	0.09
372	002647	宏磊股份	1,632	27,874.56	0.09
373	002545	东方铁塔	1,396	26,607.76	0.08
374	002668	奥马电器	1,104	25,855.68	0.08
375	002494	华斯股份	1,323	25,242.84	0.08
376	002455	百川股份	2,070	25,191.90	0.08
377	002193	山东如意	1,684	23,744.40	0.07
378	002667	鞍重股份	593	23,690.35	0.07
379	002580	圣阳股份	863	22,636.49	0.07
380	002694	顾地科技	1,630	20,407.60	0.06
381	002692	远程电缆	1,251	20,303.73	0.06
382	002660	茂硕电源	2,011	19,184.94	0.06
383	002617	露笑科技	818	19,149.38	0.06
384	002536	西泵股份	596	18,952.80	0.06
385	002636	金安国纪	1,180	18,042.20	0.06
386	002661	克明面业	430	17,376.30	0.05
387	002696	百洋股份	1,061	15,946.83	0.05
388	002676	顺威股份	653	15,306.32	0.05

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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	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

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 年年度报告

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

8.1.4.2 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	284,785.38	1.06
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

8.1.4.3 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	4,004,502.33
卖出股票的收入（成交）总额	9,786,671.81

8.1.5 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。

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.1.8 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。

8.1.9 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。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 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。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1 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。

8.1.11.2 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。

8.1.11.3 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。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

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 年年度报告

8.1.12.2 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。

8.1.12.3 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	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

8.1.12.4 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。

8.1.12.5 期末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。

8.2 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

8.2.1 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	21,511,754.38	86.98
	其中：股票	21,511,754.38	86.98
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

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 年年度报告

	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	3,206,527.06	12.96
7	其他各项资产	14,691.40	0.06
8	合计	24,732,972.84	100.00

8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	301,590.55	1.23
B	采矿业	142,413.75	0.58
C	制造业	15,683,677.10	63.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,377.80	0.49
E	建筑业	812,048.69	3.31
F	批发和零售业	678,214.32	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	166,635.02	0.68
H	住宿和餐饮业	70,426.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,582,009.45	6.45
J	金融业	615,859.86	2.51
K	房地产业	401,928.58	1.64
L	租赁和商务服务业	692,191.65	2.82
M	科学研究和技术服务业	77,511.60	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	84,239.76	0.34

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 年年度报告

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	82,630.25	0.34
S	综合	-	-
	合计	21,511,754.38	87.66

8.2.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.2.3 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

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	002344	海宁皮城	23,593	361,916.62	1.47
2	002415	海康威视	9,919	341,114.41	1.39
3	002304	洋河股份	3,962	271,555.48	1.11
4	002673	西部证券	7,465	245,673.15	1.00
5	002024	苏宁云商	15,600	209,820.00	0.85
6	002602	世纪华通	5,222	177,809.10	0.72
7	002075	沙钢股份	12,180	169,180.20	0.69
8	002450	康得新	4,413	168,135.30	0.69
9	002202	金风科技	7,321	166,845.59	0.68
10	002142	宁波银行	10,596	164,343.96	0.67
11	002594	比亚迪	2,454	158,037.60	0.64
12	002183	怡亚通	3,258	150,063.48	0.61
13	002241	歌尔声学	4,136	143,105.60	0.58
14	002219	恒康医疗	7,212	131,114.16	0.53
15	002500	山西证券	7,850	119,634.00	0.49
16	002475	立讯精密	3,742	119,556.90	0.49
17	002292	奥飞动漫	2,312	119,553.52	0.49
18	002065	东华软件	4,700	117,970.00	0.48
19	002230	科大讯飞	3,057	113,261.85	0.46
20	002146	荣盛发展	11,183	106,573.99	0.43
21	002081	金螳螂	5,651	105,560.68	0.43
22	002465	海格通信	6,174	103,044.06	0.42
23	002493	荣盛石化	6,482	100,471.00	0.41
24	002018	华信国际	2,196	96,799.68	0.39
25	002008	大族激光	3,618	93,670.02	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 年年度报告

26	002152	广电运通	2,999	92,939.01	0.38
27	002405	四维图新	2,358	91,490.40	0.37
28	002276	万马股份	2,981	89,728.10	0.37
29	002399	海普瑞	2,526	89,344.62	0.36
30	002498	汉缆股份	11,740	87,345.60	0.36
31	002456	欧菲光	2,808	87,104.16	0.35
32	002085	万丰奥威	2,705	87,046.90	0.35
33	002736	国信证券	4,365	86,208.75	0.35
34	002563	森马服饰	6,886	85,386.40	0.35
35	002153	石基信息	565	85,315.00	0.35
36	002376	新北洋	4,592	84,860.16	0.35
37	002573	清新环境	3,754	84,239.76	0.34
38	002474	榕基软件	3,485	83,465.75	0.34
39	002179	中航光电	2,191	83,170.36	0.34
40	002491	通鼎互联	4,248	82,326.24	0.34
41	002470	金正大	4,024	81,848.16	0.33
42	002031	巨轮智能	4,878	81,072.36	0.33
43	002236	大华股份	2,189	80,774.10	0.33
44	002311	海大集团	5,681	79,363.57	0.32
45	002384	东山精密	3,833	76,736.66	0.31
46	002129	中环股份	6,248	76,350.56	0.31
47	002051	中工国际	2,993	75,812.69	0.31
48	002285	世联行	4,579	74,317.17	0.30
49	002080	中材科技	2,774	73,843.88	0.30
50	002372	伟星新材	4,106	73,415.28	0.30
51	002268	卫士通	1,300	73,073.00	0.30
52	002520	日发精机	2,756	72,896.20	0.30
53	002007	华兰生物	1,656	72,864.00	0.30
54	002444	巨星科技	3,506	72,574.20	0.30
55	002038	双鹭药业	2,156	72,226.00	0.29
56	002489	浙江永强	6,651	72,096.84	0.29
57	002400	省广股份	2,864	72,029.60	0.29
58	002186	全聚德	3,062	70,426.00	0.29
59	002299	圣农发展	3,170	69,708.30	0.28
60	002437	誉衡药业	2,300	69,575.00	0.28
61	002481	双塔食品	5,000	69,400.00	0.28
62	002574	明牌珠宝	3,196	67,883.04	0.28
63	002181	粤传媒	4,267	67,631.95	0.28
64	002508	老板电器	1,500	67,425.00	0.27
65	002320	海峡股份	2,433	66,737.19	0.27
66	002429	兆驰股份	5,202	66,013.38	0.27
67	002095	生意宝	890	65,495.10	0.27
68	002308	威创股份	2,656	65,470.40	0.27

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 年年度报告

69	002385	大北农	5,344	65,250.24	0.27
70	002224	三力士	2,985	64,834.20	0.26
71	002089	新海宜	2,861	64,401.11	0.26
72	002176	江特电机	3,653	64,292.80	0.26
73	002004	华邦健康	4,523	64,000.45	0.26
74	002232	启明信息	3,007	63,988.96	0.26
75	002423	中原特钢	4,558	63,766.42	0.26
76	002353	杰瑞股份	2,485	63,069.30	0.26
77	002544	杰赛科技	2,126	63,035.90	0.26
78	002223	鱼跃医疗	1,637	62,942.65	0.26
79	002618	丹邦科技	1,291	62,820.06	0.26
80	002195	二三四五	1,690	62,530.00	0.25
81	002191	劲嘉股份	3,984	61,194.24	0.25
82	002367	康力电梯	3,642	61,076.34	0.25
83	002626	金达威	3,136	60,869.76	0.25
84	002701	奥瑞金	2,142	60,532.92	0.25
85	002287	奇正藏药	1,451	60,332.58	0.25
86	002050	三花股份	5,574	59,363.10	0.24
87	002097	山河智能	5,476	59,359.84	0.24
88	002244	滨江集团	7,456	59,349.76	0.24
89	002177	御银股份	5,451	59,143.35	0.24
90	002174	游族网络	700	59,073.00	0.24
91	002104	恒宝股份	2,459	58,991.41	0.24
92	002667	鞍重股份	786	58,792.80	0.24
93	002685	华东重机	5,628	58,362.36	0.24
94	002284	亚太股份	2,817	58,255.56	0.24
95	002678	珠江钢琴	3,382	58,204.22	0.24
96	002556	辉隆股份	3,142	58,095.58	0.24
97	002055	得润电子	1,500	57,990.00	0.24
98	002001	新和成	3,309	57,708.96	0.24
99	002665	首航节能	1,892	57,706.00	0.24
100	002629	仁智油服	4,119	57,542.43	0.23
101	002681	奋达科技	1,312	57,334.40	0.23
102	002537	海立美达	3,452	57,268.68	0.23
103	002528	英飞拓	4,214	57,226.12	0.23
104	002439	启明星辰	1,784	57,088.00	0.23
105	002099	海翔药业	2,384	56,858.40	0.23
106	002410	广联达	3,100	56,358.00	0.23
107	002170	芭田股份	4,289	56,271.68	0.23
108	002631	德尔未来	1,928	56,046.96	0.23
109	002375	亚厦股份	3,553	56,030.81	0.23
110	002603	以岭药业	3,065	55,568.45	0.23
111	002650	加加食品	6,741	54,736.92	0.22

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 年年度报告

112	002269	美邦服饰	8,139	54,612.69	0.22
113	002187	广百股份	3,335	54,560.60	0.22
114	002242	九阳股份	2,400	54,432.00	0.22
115	002612	朗姿股份	721	54,406.66	0.22
116	002416	爱施德	3,100	54,250.00	0.22
117	002424	贵州百灵	2,100	53,886.00	0.22
118	002256	彩虹精化	2,012	53,780.76	0.22
119	002503	搜于特	3,395	53,776.80	0.22
120	002570	贝因美	3,600	53,748.00	0.22
121	002649	博彦科技	950	53,466.00	0.22
122	002030	达安基因	1,297	53,410.46	0.22
123	002203	海亮股份	4,849	53,339.00	0.22
124	002389	南洋科技	2,600	52,988.00	0.22
125	002609	捷顺科技	2,500	52,150.00	0.21
126	002117	东港股份	1,131	52,048.62	0.21
127	002433	太安堂	3,487	51,816.82	0.21
128	002462	嘉事堂	1,023	51,784.26	0.21
129	002482	广田股份	1,766	51,655.50	0.21
130	002565	上海绿新	4,319	51,612.05	0.21
131	002577	雷柏科技	900	51,498.00	0.21
132	002093	国脉科技	3,453	51,380.64	0.21
133	002492	恒基达鑫	3,168	51,321.60	0.21
134	002557	洽洽食品	2,736	51,217.92	0.21
135	002550	千红制药	2,316	51,183.60	0.21
136	002294	信立泰	1,698	51,143.76	0.21
137	002641	永高股份	5,137	51,061.78	0.21
138	002086	东方海洋	1,724	51,030.40	0.21
139	002496	辉丰股份	1,800	50,940.00	0.21
140	002662	京威股份	2,315	50,930.00	0.21
141	002445	中南重工	1,814	50,882.70	0.21
142	002190	成飞集成	1,161	50,805.36	0.21
143	002301	齐心集团	2,322	50,666.04	0.21
144	002261	拓维信息	1,295	50,375.50	0.21
145	002596	海南瑞泽	1,144	50,050.00	0.20
146	002488	金固股份	1,725	50,025.00	0.20
147	002047	宝鹰股份	4,392	49,366.08	0.20
148	002279	久其软件	728	49,285.60	0.20
149	002267	陕天然气	3,908	49,240.80	0.20
150	002273	水晶光电	1,208	49,044.80	0.20
151	002041	登海种业	2,905	48,949.25	0.20
152	002502	骅威股份	1,526	48,862.52	0.20
153	002501	利源精制	3,874	48,734.92	0.20
154	002630	华西能源	3,294	48,652.38	0.20

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 年年度报告

155	002627	宜昌交运	1,663	48,576.23	0.20
156	002006	精工科技	3,298	48,480.60	0.20
157	002147	方圆支承	2,699	48,312.10	0.20
158	002310	东方园林	1,824	48,263.04	0.20
159	002171	楚江新材	2,009	48,175.82	0.20
160	002077	大港股份	2,410	48,079.50	0.20
161	002019	亿帆鑫富	1,200	48,000.00	0.20
162	002739	万达院线	400	48,000.00	0.20
163	002657	中科金财	600	47,994.00	0.20
164	002564	天沃科技	3,918	47,721.24	0.19
165	002250	联化科技	2,527	47,684.49	0.19
166	002208	合肥城建	1,945	47,652.50	0.19
167	002646	青青裸酒	2,087	47,625.34	0.19
168	002597	金禾实业	4,322	47,542.00	0.19
169	002062	宏润建设	4,895	47,481.50	0.19
170	002312	三泰控股	1,700	47,260.00	0.19
171	002540	亚太科技	4,730	47,205.40	0.19
172	002331	皖通科技	1,740	47,119.20	0.19
173	002590	万安科技	1,886	46,961.40	0.19
174	002271	东方雨虹	2,398	46,832.94	0.19
175	002131	利欧股份	2,400	46,800.00	0.19
176	002157	正邦科技	2,314	46,511.40	0.19
177	002020	京新药业	1,382	46,366.10	0.19
178	002115	三维通信	2,919	46,324.53	0.19
179	002396	星网锐捷	1,913	46,198.95	0.19
180	002316	键桥通讯	2,276	46,180.04	0.19
181	002463	沪电股份	7,148	46,176.08	0.19
182	002664	信质电机	1,452	46,130.04	0.19
183	002032	苏泊尔	1,655	46,042.10	0.19
184	002226	江南化工	5,092	45,980.76	0.19
185	002318	久立特材	3,000	45,900.00	0.19
186	002485	希努尔	3,025	45,798.50	0.19
187	002427	尤夫股份	2,500	45,700.00	0.19
188	002642	荣之联	787	45,559.43	0.19
189	002422	科伦药业	2,446	45,495.60	0.19
190	002358	森源电气	2,464	45,460.80	0.19
191	002121	科陆电子	1,534	45,406.40	0.19
192	002293	罗莱生活	2,465	44,961.60	0.18
193	002045	国光电器	2,362	44,641.80	0.18
194	002693	双成药业	3,000	44,550.00	0.18
195	002345	潮宏基	2,634	44,461.92	0.18
196	002371	七星电子	2,300	44,344.00	0.18
197	002011	盾安环境	2,644	44,207.68	0.18

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 年年度报告

198	002518	科士达	1,252	44,195.60	0.18
199	002333	罗普斯金	2,042	44,188.88	0.18
200	002156	通富微电	2,314	44,174.26	0.18
201	002362	汉王科技	1,372	43,972.60	0.18
202	002204	大连重工	4,397	43,970.00	0.18
203	002185	华天科技	2,450	43,928.50	0.18
204	002363	隆基机械	1,912	43,689.20	0.18
205	002494	华斯股份	1,646	43,619.00	0.18
206	002335	科华恒盛	908	43,584.00	0.18
207	002037	久联发展	1,563	43,388.88	0.18
208	002014	永新股份	2,207	43,345.48	0.18
209	002428	云南锗业	2,134	43,277.52	0.18
210	002303	美盈森	3,152	43,024.80	0.18
211	002394	联发股份	2,308	42,998.04	0.18
212	002233	塔牌集团	2,932	42,953.80	0.18
213	002123	荣信股份	1,670	42,835.50	0.17
214	002101	广东鸿图	1,295	42,735.00	0.17
215	002078	太阳纸业	7,581	42,681.03	0.17
216	002228	合兴包装	2,523	42,588.24	0.17
217	002122	天马股份	5,099	42,474.67	0.17
218	002622	永大集团	1,677	42,394.56	0.17
219	002138	顺络电子	2,950	42,332.50	0.17
220	002079	苏州固锴	3,874	42,265.34	0.17
221	002083	孚日股份	5,282	42,256.00	0.17
222	002531	天顺风能	3,073	42,253.75	0.17
223	002069	獐子岛	3,093	42,250.38	0.17
224	002064	华峰氨纶	6,510	42,249.90	0.17
225	002215	诺普信	2,200	42,196.00	0.17
226	002029	七匹狼	3,086	42,185.62	0.17
227	002601	佰利联	1,081	42,115.76	0.17
228	002449	国星光电	2,491	42,097.90	0.17
229	002663	普邦园林	5,300	42,082.00	0.17
230	002567	唐人神	3,277	42,076.68	0.17
231	002694	顾地科技	2,500	42,000.00	0.17
232	002511	中顺洁柔	3,551	41,475.68	0.17
233	002392	北京利尔	5,318	41,374.04	0.17
234	002584	西陇科学	834	41,366.40	0.17
235	002483	润邦股份	3,587	41,358.11	0.17
236	002221	东华能源	1,768	41,335.84	0.17
237	002025	航天电器	1,588	41,272.12	0.17
238	002605	姚记扑克	1,593	41,115.33	0.17
239	002178	延华智能	3,100	41,106.00	0.17
240	002060	粤水电	4,429	40,835.38	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 年年度报告

241	002275	桂林三金	1,749	40,751.70	0.17
242	002053	云南盐化	1,573	40,646.32	0.17
243	002143	印纪传媒	1,000	40,550.00	0.17
244	002476	宝莫股份	4,059	40,508.82	0.17
245	002302	西部建设	2,266	40,380.12	0.16
246	002589	瑞康医药	1,124	40,362.84	0.16
247	002588	史丹利	1,240	40,337.20	0.16
248	002140	东华科技	1,893	40,320.90	0.16
249	002348	高乐股份	2,300	40,319.00	0.16
250	002012	凯恩股份	4,088	40,225.92	0.16
251	002022	科华生物	1,382	40,216.20	0.16
252	002527	新时达	1,824	40,109.76	0.16
253	002638	勤上光电	2,599	39,816.68	0.16
254	002332	仙琚制药	2,628	39,814.20	0.16
255	002073	软控股份	2,355	39,799.50	0.16
256	002100	天康生物	3,936	39,596.16	0.16
257	002039	黔源电力	2,000	39,580.00	0.16
258	002484	江海股份	1,528	39,575.20	0.16
259	002366	台海核电	596	39,306.20	0.16
260	002628	成都路桥	5,268	39,246.60	0.16
261	002063	远光软件	1,852	39,151.28	0.16
262	002283	天润曲轴	1,745	38,948.40	0.16
263	002461	珠江啤酒	2,548	38,907.96	0.16
264	002281	光迅科技	600	38,898.00	0.16
265	002056	横店东磁	1,383	38,876.13	0.16
266	002023	海特高新	2,110	38,697.40	0.16
267	002328	新朋股份	2,811	38,566.92	0.16
268	002184	海得控制	894	38,450.94	0.16
269	002108	沧州明珠	2,171	38,361.57	0.16
270	002436	兴森科技	1,988	38,269.00	0.16
271	002155	湖南黄金	4,253	38,234.47	0.16
272	002096	南岭民爆	1,469	38,208.69	0.16
273	002325	洪涛股份	2,444	38,199.72	0.16
274	002419	天虹商场	2,825	38,137.50	0.16
275	002369	卓翼科技	2,867	38,131.10	0.16
276	002266	浙富控股	4,669	38,005.66	0.15
277	002314	南山控股	4,482	37,962.54	0.15
278	002168	深圳惠程	3,209	37,962.47	0.15
279	002546	新联电子	1,156	37,766.52	0.15
280	002430	杭氧股份	3,284	37,766.00	0.15
281	002005	德豪润达	3,711	37,629.54	0.15
282	002262	恩华药业	1,285	37,611.95	0.15
283	002614	蒙发利	1,939	37,597.21	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 年年度报告

284	002118	紫鑫药业	1,927	37,595.77	0.15
285	002074	国轩高科	1,007	37,359.70	0.15
286	002675	东诚药业	667	37,358.67	0.15
287	002382	蓝帆医疗	1,336	37,354.56	0.15
288	002068	黑猫股份	4,248	37,127.52	0.15
289	002689	远大智能	3,305	37,115.15	0.15
290	002220	天宝股份	2,292	37,015.80	0.15
291	002280	联络互动	602	36,962.80	0.15
292	002216	三全食品	3,242	36,926.38	0.15
293	002364	中恒电气	1,300	36,673.00	0.15
294	002454	松芝股份	1,908	36,614.52	0.15
295	002559	亚威股份	2,299	36,577.09	0.15
296	002148	北纬通信	1,600	36,496.00	0.15
297	002398	建研集团	2,167	36,405.60	0.15
298	002010	传化股份	1,544	36,361.20	0.15
299	002535	林州重机	2,962	36,343.74	0.15
300	002237	恒邦股份	3,635	36,277.30	0.15
301	002617	露笑科技	1,636	36,155.60	0.15
302	002440	闰土股份	1,893	36,061.65	0.15
303	002539	新都化工	2,252	36,032.00	0.15
304	002593	日上集团	982	36,029.58	0.15
305	002406	远东传动	2,836	35,847.04	0.15
306	002339	积成电子	1,465	35,746.00	0.15
307	002418	康盛股份	1,017	35,605.17	0.15
308	002581	未名医药	1,022	35,534.94	0.14
309	002107	沃华医药	1,369	35,498.17	0.14
310	002417	*ST 元达	1,786	35,416.38	0.14
311	002092	中泰化学	4,013	35,314.40	0.14
312	002003	伟星股份	1,977	35,032.44	0.14
313	002676	顺威股份	853	35,015.65	0.14
314	002377	国创高新	3,366	34,770.78	0.14
315	002402	和而泰	1,220	34,635.80	0.14
316	002071	长城影视	1,951	34,630.25	0.14
317	002277	友阿股份	2,493	34,627.77	0.14
318	002321	华英农业	2,605	34,412.05	0.14
319	002254	泰和新材	2,156	34,258.84	0.14
320	002305	南国置业	5,312	33,943.68	0.14
321	002238	天威视讯	1,520	33,744.00	0.14
322	002441	众业达	1,518	33,623.70	0.14
323	002674	兴业科技	1,681	33,367.85	0.14
324	002635	安洁科技	1,200	33,360.00	0.14
325	002240	威华股份	2,429	33,228.72	0.14
326	002378	章源钨业	2,758	33,206.32	0.14

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 年年度报告

327	002523	天桥起重	3,502	33,093.90	0.13
328	002054	德美化工	2,331	32,867.10	0.13
329	002404	嘉欣丝绸	3,038	32,780.02	0.13
330	002408	齐翔腾达	2,462	32,769.22	0.13
331	002251	步步高	2,005	32,681.50	0.13
332	002420	毅昌股份	2,800	32,536.00	0.13
333	002218	拓日新能	2,954	32,464.46	0.13
334	002042	华孚色纺	2,690	32,414.50	0.13
335	002548	金新农	1,881	32,127.48	0.13
336	002620	瑞和股份	816	32,085.12	0.13
337	002016	世荣兆业	2,366	32,011.98	0.13
338	002432	九安医疗	1,291	31,887.70	0.13
339	002521	齐峰新材	2,534	31,675.00	0.13
340	002035	华帝股份	1,779	31,630.62	0.13
341	002141	蓉胜超微	999	31,568.40	0.13
342	002479	富春环保	2,355	31,557.00	0.13
343	002317	众生药业	2,378	31,484.72	0.13
344	002472	双环传动	1,179	31,479.30	0.13
345	002106	莱宝高科	2,358	31,455.72	0.13
346	002124	天邦股份	1,156	31,420.08	0.13
347	002431	棕榈园林	1,163	31,214.92	0.13
348	002356	浩宁达	1,102	30,867.02	0.13
349	002513	蓝丰生化	1,583	30,852.67	0.13
350	002309	中利科技	1,642	30,836.76	0.13
351	002206	海利得	1,922	30,559.80	0.12
352	002393	力生制药	631	30,477.30	0.12
353	002167	东方锆业	2,537	30,444.00	0.12
354	002201	九鼎新材	1,900	30,419.00	0.12
355	002534	杭锅股份	1,570	30,332.40	0.12
356	002180	艾派克	657	30,320.55	0.12
357	002386	天原集团	3,797	30,110.21	0.12
358	002052	同洲电子	2,041	29,900.65	0.12
359	002327	富安娜	2,482	29,858.46	0.12
360	002209	达意隆	1,300	29,783.00	0.12
361	002109	兴化股份	3,465	29,591.10	0.12
362	002087	新野纺织	3,455	29,402.05	0.12
363	002091	江苏国泰	1,089	28,934.73	0.12
364	002048	宁波华翔	1,659	28,866.60	0.12
365	002636	金安国纪	1,268	28,808.96	0.12
366	002477	雏鹰农牧	1,700	28,747.00	0.12
367	002298	中电鑫龙	1,488	28,584.48	0.12
368	002543	万和电气	1,568	28,553.28	0.12
369	002013	中航机电	1,231	27,894.46	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 年年度报告

370	002435	长江润发	2,769	27,856.14	0.11
371	002578	闽发铝业	2,697	27,401.52	0.11
372	002516	旷达科技	1,900	27,360.00	0.11
373	002347	泰尔重工	1,148	27,127.24	0.11
374	002478	常宝股份	1,900	27,075.00	0.11
375	002374	丽鹏股份	1,600	27,040.00	0.11
376	002661	克明面业	500	26,850.00	0.11
377	002696	百洋股份	1,061	26,493.17	0.11
378	002451	摩恩电气	1,815	26,408.25	0.11
379	002135	东南网架	2,171	26,290.81	0.11
380	002154	报喜鸟	3,443	26,201.23	0.11
381	002600	江粉磁材	2,254	26,191.48	0.11
382	002165	红宝丽	2,966	26,189.78	0.11
383	002231	奥维通信	1,600	26,176.00	0.11
384	002128	露天煤业	3,053	25,797.85	0.11
385	002656	卡奴迪路	900	25,749.00	0.10
386	002211	宏达新材	1,999	25,587.20	0.10
387	002545	东方铁塔	2,295	24,923.70	0.10
388	002504	弘高创意	822	24,824.40	0.10
389	002307	北新路桥	2,200	24,816.00	0.10
390	002139	拓邦股份	989	24,635.99	0.10
391	002647	宏磊股份	1,032	24,602.88	0.10
392	002028	思源电气	1,505	23,914.45	0.10
393	002522	浙江众成	1,288	23,866.64	0.10
394	002360	同德化工	1,901	23,420.32	0.10
395	002533	金杯电工	2,369	23,334.65	0.10
396	002295	精艺股份	985	23,236.15	0.09
397	002495	佳隆股份	2,700	23,193.00	0.09
398	002300	太阳电缆	1,930	23,160.00	0.09
399	002255	海陆重工	2,222	23,131.02	0.09
400	002182	云海金属	1,418	22,858.16	0.09
401	002455	百川股份	2,040	22,623.60	0.09
402	002391	长青股份	1,200	21,384.00	0.09
403	002160	常铝股份	1,600	20,976.00	0.09
404	002554	惠博普	1,603	20,839.00	0.08
405	002322	理工监测	771	19,483.17	0.08
406	002365	永安药业	886	19,155.32	0.08
407	002459	天业通联	800	15,712.00	0.06
408	002340	格林美	1,000	15,200.00	0.06
409	002580	圣阳股份	753	15,060.00	0.06
410	002695	煌上煌	353	13,128.07	0.05

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 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	002236	大华股份	1,114,230.00	4.54
2	002344	海宁皮城	853,882.00	3.48
3	002673	西部证券	410,742.00	1.67
4	002415	海康威视	367,534.00	1.50
5	002594	比亚迪	353,250.00	1.44
6	002493	荣盛石化	335,805.00	1.37
7	002304	洋河股份	310,926.00	1.27
8	002075	沙钢股份	294,930.00	1.20
9	002475	立讯精密	253,980.00	1.03
10	002465	海格通信	252,725.00	1.03
11	002024	苏宁云商	247,475.00	1.01
12	002312	三泰控股	247,285.00	1.01
13	002410	广联达	242,410.00	0.99
14	002142	宁波银行	235,446.00	0.96
15	002659	中泰桥梁	231,544.00	0.94
16	002049	同方国芯	231,024.00	0.94
17	002563	森马服饰	228,972.00	0.93
18	002186	全聚德	213,885.00	0.87
19	002500	山西证券	209,393.70	0.85
20	002491	通鼎互联	208,361.65	0.85

8.2.4.2 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	002236	大华股份	1,190,215.54	4.85
2	002344	海宁皮城	626,434.10	2.55
3	002415	海康威视	584,720.40	2.38
4	002252	上海莱士	529,157.08	2.16
5	002304	洋河股份	486,550.10	1.98
6	002594	比亚迪	397,404.00	1.62

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 年年度报告

7	002024	苏宁云商	390,657.63	1.59
8	002673	西部证券	384,521.05	1.57
9	002142	宁波银行	344,534.54	1.40
10	002472	双环传动	273,617.17	1.11
11	002055	得润电子	265,211.95	1.08
12	002500	山西证券	256,591.00	1.05
13	002445	中南重工	254,085.00	1.04
14	002202	金风科技	241,396.04	0.98
15	002450	康得新	227,561.23	0.93
16	002065	东华软件	213,579.00	0.87
17	002241	歌尔声学	197,580.42	0.81
18	002187	广百股份	188,515.00	0.77
19	002736	国信证券	181,044.03	0.74
20	002146	荣盛发展	170,129.52	0.69

8.2.4.3 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	20,682,963.09
卖出股票的收入（成交）总额	30,032,078.48

8.2.5 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。

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.2.8 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。

8.2.9 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。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.10.1 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。

8.2.10.2 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。

8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.11.1 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。

8.2.11.2 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。

8.2.11.3 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。

8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 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。

8.2.12.2 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

8.2.12.3 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	12,473.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	631.05
5	应收申购款	1,587.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,691.40

8.2.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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 年年度报告

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002075	沙钢股份	169,180.20	0.69	重大事项停牌

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

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
886	13,566.71	2,935,582.00	24.42%	9,084,519.89	75.58%

9.1.2 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

份额单位：份

份额级别	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
国联安双力A中小板综指	219	30,798.75	4,206,355.00	62.36%	2,538,571.00	37.64%

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 年年度报告

(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)	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%

9.2 期末上市基金前十名持有人

9.2.1 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

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	2,796,973.00	23.27%
2	郑淑女	932,651.00	7.76%
3	李锦山	409,644.00	3.41%
4	朱洪宏	348,595.00	2.90%
5	王慧娟	269,888.63	2.25%
6	司明辉	216,258.78	1.80%
7	黄乐平	213,816.00	1.78%
8	宗祥芬	213,423.32	1.78%
9	杨克艳	200,751.68	1.67%

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 年年度报告

10	陈春宁	191,669.00	1.59%
----	-----	------------	-------

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。

9.2.2 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)

国联安双力 A 中小板综指

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	3,706,355.00	54.95%
2	郑淑女	500,053.00	7.41%
3	国泰君安证券股份有限公司	500,000.00	7.41%
4	方向	222,119.00	3.29%
5	杨楚杰	150,012.00	2.22%
6	黄乐平	100,010.00	1.48%
7	肖瑞华	100,010.00	1.48%
8	张兰华	98,700.00	1.46%
9	李荣	68,600.00	1.02%
10	金关妹	50,012.00	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

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	周昭玲	763,894.00	11.33%
2	郑淑女	424,553.00	6.29%
3	杨凯	300,027.00	4.45%
4	杨震	290,000.00	4.30%
5	朱洪宏	252,000.00	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	193,730.00	2.87%
7	陈波	174,200.00	2.58%
8	刘升喜	158,600.00	2.35%
9	杨楚杰	150,012.00	2.22%
10	刘丽丽	138,700.00	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 年年度报告

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—中国银行股份有限公司	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%
7	李伟	106000	2.19%
8	杜烨	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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安双力中小板 (LOF)	934.16	0.01%
	合计	934.16	0.01%

9.4 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、基金投资和研发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。

§10 开放式基金份额变动

10.1 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）

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 年年度报告

单位：份

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

10.2 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12月31日)

单位：份

转型后首日(2015年3月24日)基金份额总额	18,332,807.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,847,082.74
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	26,159,788.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,020,101.89

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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6月6日,基金管理人发布《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。

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 年年度报告

2. 2015 年 8 月 22 日, 基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。经国联安基金管理有限公司第四届董事会第十七次会议审议通过, 自该日起周浩先生不再担任公司督察长一职, 由公司总经理谭晓雨女士代为履行督察长职责。

3. 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。

4. 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。

5. 本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知, 聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知, 解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。

本基金本报告期末支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 6.5 万元人民币, 目前该事务所已向本基金提供连续 4 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

11.7.1.1 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	
东北证券股份有限公司	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 年年度报告

第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	50,715,041.57	100.00%	45,266.46	100.00%	-

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。

11.7.1.2 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	-	-	-	-	-	-

11.7.2 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

11.7.2.1 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	
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	8,452,657.11	100.00%	45,266.46	100.00%	-

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：

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 年年度报告

- 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
- 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。

11.7.2.2 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	-	-	-	-	-	-

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 年年度报告

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	-	-	-	-	-	-

11.8 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金所持万达信息（300168）和宏源证券（000562）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	2015-01-08
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	中国证券报、上海证券	2015-02-25

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 年年度报告

	鹏博士（600804）估值调整的公告	报、证券时报、公司网站	
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基金分级运作期届满与基金份额转换的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-05
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

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 年年度报告

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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-03-18
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

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 年年度报告

		站	
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、证券时报、公司网站	2015-04-02
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	中国证券报、上海证券	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 年年度报告

	参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	报、证券时报、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、证券时报、公司网站	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 年年度报告

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
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	2015-06-13

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 年年度报告

		站	
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
91	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持科达洁能、保千里和海南海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	2015-07-01
92	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持鱼跃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	2015-07-03
93	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长江电力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	2015-07-04
94	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持得润电子、利欧股份和博彦科技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	2015-07-04
95	国联安基金管理有限公司关于公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-07-07
96	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华录百纳（300291）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	2015-07-08
97	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持黄河旋风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	2015-07-09
98	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持科华生物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	2015-07-10
99	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持丽珠集团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	2015-07-11
100	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持	中国证券报、上海证券	2015-07-11

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 年年度报告

	美克美家等股票估值调整的公告	报、证券时报、公司网站	
101	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金开展赎回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	2015-07-14
102	国联安基金管理有限公司关于增加和讯信息科技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	2015-07-15
103	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持通富微电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	2015-07-15
104	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持游族网络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	2015-07-16
105	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持恒康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	2015-07-18
106	国联安双力中小板综指分级证券投资基金 2015 年度 2 季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-07-21
107	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持禾欣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	2015-07-29
108	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持国投电力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	2015-07-30
109	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司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	2015-08-19
110	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持通富微电（002156）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	2015-08-22
111	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	2015-08-22
112	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长电科技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	2015-08-22
113	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加天天基金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	2015-08-25
114	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持鼎汉技术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	2015-08-27

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 年年度报告

115	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持 骅威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	2015-08-28
116	国联安双力中小板综指分级证券投资基金 2015 年度半年报	中国证券报、上海证券 报、证券时报、公司网 站	2015-08-28
117	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持 新嘉联、中国高科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	2015-08-29
118	国联安基金管理有限公司关于调整旗下开放 式基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券 报、证券时报、证券日 报、公司网站	2015-09-10
119	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金 参加华宝证券有限责任公司相关费率优惠活 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	2015-09-16
120	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持 爱康科技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	2015-09-17
121	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加 上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的 公告	中国证券报、上海证券 报、证券时报、证券日 报、公司网站	2015-09-18
122	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金 在平安证券有限责任公司开通定期定额投资 业务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、公司网 站	2015-09-24
123	国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 2015 年 3 季度报告	中国证券报、上海证券 报、证券时报、公司网 站	2015-10-26
124	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加 浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活 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	2015-11-05
125	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持 道博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	2015-11-07
126	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持 超图软件、北京银行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	2015-11-07
127	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加 长量基金、利得基金及和讯网等费率优惠活 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	2015-11-13
128	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持 国药一致、立讯精密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	2015-11-27
129	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金 增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机	中国证券报、上海证券 报、证券时报、证券日	2015-11-30

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 年年度报告

	构的公告	报、公司网站	
130	国联安基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015-12-16
131	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长电科技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	2015-12-18
132	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2015-12-31
133	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	2015-12-31

§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分级证券投资基金（现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

二〇一六年三月二十八日