

国联安信心增长债券型证券投资基金
(国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金)
2014 年年度报告
2014 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年三月三十日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

国联安信心增长债券型证券投资基金由国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而成。2014 年 5 月 19 日国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型议案》，内容包括国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金变更运作方式、投资策略、基金更名和修订基金合同等。上述基金份额持有人大会决议事项已于 2014 年 7 月 29 日在中国证监会完成备案手续，自该日起，《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效且《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效。

本报告中，原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日止，国联安信心增长债券型证券投资基金报告期自 2014 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 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.....	8
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 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）.....	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
3.1.2.1 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.....	10
3.1.2.2 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.....	11
3.1.2.3 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.....	12
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
3.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）.....	14
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	14
3.2.2 基金净值表现.....	16
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.....	16
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.....	17
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.....	19
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况.....	21
§4 管理人报告	22
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	22
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	24
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	24
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.....	25
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	26
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	26
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	27
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	27
§5 托管人报告	27
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	27
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.....	28
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.....	28
§6 审计报告	28
6.1 国联安信心增长债券型证券投资基金.....	28
6.1.1 管理层对财务报表的责任.....	28
6.1.2 注册会计师的责任.....	28

6.1.3 审计意见.....	29
6.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金.....	29
6.2.1 管理层对财务报表的责任.....	29
6.2.2 注册会计师的责任.....	30
6.2.3 审计意见.....	30
§7 年度财务报表.....	31
7.1 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）.....	31
7.1.1 资产负债表.....	31
7.1.2 利润表.....	32
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	34
7.1.4 报表附注.....	35
7.2 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）.....	65
7.2.1 资产负债表.....	65
7.2.2 利润表.....	67
7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	68
7.2.4 报表附注.....	70
§8 投资组合报告.....	94
8.1 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）.....	94
8.1.1 期末基金资产组合情况.....	94
8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	95
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.....	95
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	95
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	95
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.....	96
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.....	96
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.....	96
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.....	96
8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	96
8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	96
8.1.12 投资组合报告附注.....	97
8.2 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）.....	97
8.2.1 期末基金资产组合情况.....	97
8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	98
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.....	99
8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	99
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	101
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.....	101
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.....	102
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.....	102
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.....	102
8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	102
8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	102
8.2.12 投资组合报告附注.....	103
§9 基金份额持有人信息.....	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	103

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	104
9.3 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	104
§10 开放式基金份额变动	105
10.1 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）	105
10.2 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）	105
§11 重大事件揭示	106
11.1 基金份额持有人大会决议	106
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	106
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	106
11.4 基金投资策略的改变	106
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	107
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	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	107
11.8 其他重大事件	110
§12 影响投资者决策的其他重要信息	113
§13 备查文件目录	113
13.1 备查文件目录	113
13.2 存放地点	113
13.3 查阅方式	113

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）		
基金名称	国联安信心增长债券型证券投资基金	
基金简称	国联安信心增长债券	
基金主代码	253060	
交易代码	253060	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 7 月 29 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	232,449,771.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安信心增长债券 A	国联安信心增长债券 B
下属分级基金的交易代码	253060	253061
报告期末下属分级基金的份额总额	215,559,096.27 份	16,890,675.33 份
国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）		
基金名称	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	国联安定期开放债券	
基金主代码	253060	
交易代码	253060	
基金运作方式	契约型开放式（本基金自《基金合同》生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次）	
基金合同生效日	2012 年 2 月 22 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	333,823,276.84 份	

基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B
下属分级基金的交易代码	253060	253061
报告期末下属分级基金的份额总额	257,399,959.84 份	76,423,317.00 份

注：原基金以定期开放方式运作，其封闭期为自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。原基金的第一个封闭期为自《基金合同》生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入为期 5 个工作日的首个开放期，如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直至满足《基金合同》关于开放期的时间要求，即每次打开申购与赎回业务办理时间达到 5 个工作日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年，以此类推。

2.2 基金产品说明

国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得最大化的债券收益；并通过适当参与新股发行申购及增发新股申购等较低风险投资品种，力争获取超额收益。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积

	极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得最大化的债券收益；并通过适当参与新股发行申购及增发新股申购等较低风险投资品种，力争获取超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	方韡
	联系电话	021-38992806	010-89936330
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95558
传真		021-50151582	010-65550832
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	北京东城区朝阳门北大街8号 富华大厦C座
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	北京市东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦北座 4 层
邮政编码		200121	100027
法定代表人		虞启斌	常振明

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://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	国联安基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）

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	2014 年 7 月 29 日至 2014 年 12 月 31 日	
	国联安信心增长债券 A	国联安信心增长债券 B
本期已实现收益	6,211,439.43	968,370.17
本期利润	3,869,234.64	761,913.42
加权平均基金份额本期利润	0.0213	0.0323
本期加权平均净值利润率	2.02%	3.11%
本期基金份额净值增长率	3.01%	2.84%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	
	国联安信心增长债券 A	国联安信心增长债券 B
期末可供分配利润	5,300,933.84	247,946.92
期末可供分配基金份额利润	0.0246	0.0147
期末基金资产净值	228,626,374.81	17,744,424.85
期末基金份额净值	1.061	1.051
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	

	国联安信心增长债券 A	国联安信心增长债券 B
基金份额累计净值增长率	3.01%	2.84%

注：1、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，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。

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。

4、本基金基金合同于 2014 年 7 月 29 日生效，截止本报告期末本基金成立不满一年。

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

1. 国联安信心增长债券 A:

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	0.57%	0.40%	3.25%	0.15%	-2.68%	0.25%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金转型起至今	3.01%	0.31%	5.13%	0.12%	-2.12%	0.19%

注：1、本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未及半年；

2、本基金的业绩比较基准为中证全债指数；

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。

2. 国联安信心增长债券 B:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	0.57%	0.40%	3.25%	0.15%	-2.68%	0.25%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金转型起至今	2.84%	0.31%	5.13%	0.12%	-2.29%	0.19%

注：1、本基金由原国联安心心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满半年；

2、本基金的业绩比较基准为中证全债指数；

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

国联安心心增长债券型证券投资基金

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

(2014 年 7 月 29 日至 2014 年 12 月 31 日)

1、国联安心心增长债券 A



注：1、本基金的业绩比较基准为中证全债指数；

2、本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 年；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；

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。

2、国联安信心增长债券 B



注：1、本基金的业绩比较基准为中证全债指数；

2、本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 年；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；

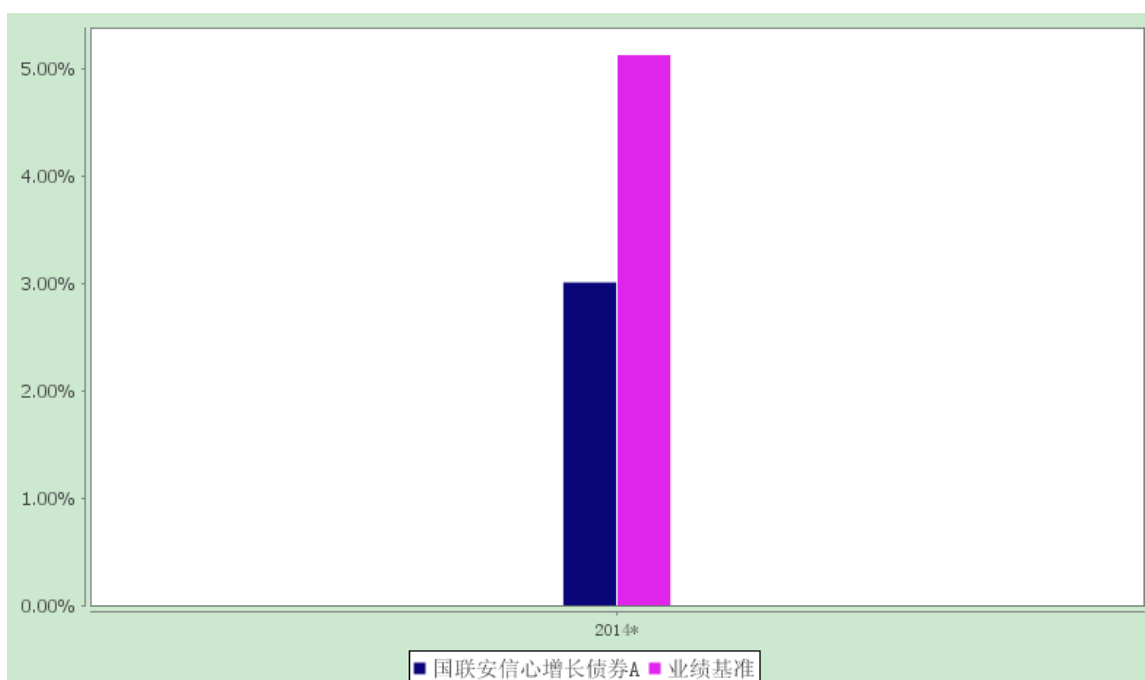
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1.2.3 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

国联安信心增长债券型证券投资基金

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

1、国联安信心增长债券 A

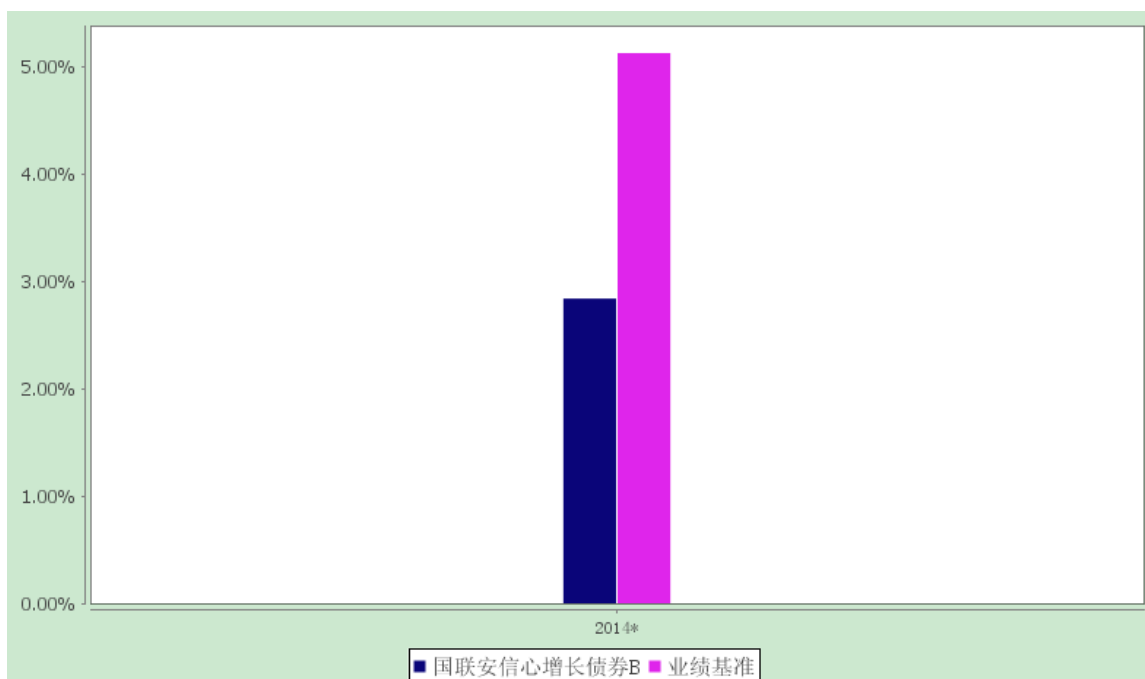


注：1、本基金由原国联安心心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 年；

2、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

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。

2、国联安心心增长债券 B



注：1、本基金由原国联安心心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 年；

2、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

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。

3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

1、国联安信心增长债券 A:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金成立至今（2014年7月29日至2014年12月31日）尚未进行利润分配。

2、国联安信心增长债券 B:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金成立至今（2014年7月29日至2014年12月31日）尚未进行利润分配。

3.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年1月1日-2014年7月28日		2013年		2012年2月22日（基金合同生效日）-2012年12月31日	
	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B
本期已实现收益	-50,749,700.67	-16,300,175.55	-14,910,876.65	-3,889,799.56	7,650,165.33	7,080,150.23

本期利润	11,626,741.73	2,880,196.57	-79,755,946.35	-23,102,805.38	10,056,643.25	9,413,308.08
加权平均基金份额本期利润	0.0192	0.0158	-0.0611	-0.0570	0.0806	0.0778
本期加权平均净值利润率	1.90%	1.57%	-5.65%	-5.29%	7.73%	7.48%
本期基金份额净值增长率	2.39%	2.20%	-2.81%	-3.10%	8.14%	7.84%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年 7 月 28 日		2013 年末		2012 年末	
	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B
期末可供分配利润	-2,370,110.19	-1,324,724.64	56,801,128.07	14,684,285.81	6,027,727.90	5,507,951.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0092	-0.0173	0.0379	0.0324	0.0483	0.0455
期末基金资产净值	265,198,370.20	78,102,665.91	1,555,796,741.21	467,896,341.29	133,237,110.81	128,779,510.69
期末基金份额净值	1.030	1.022	1.038	1.032	1.068	1.065
3.1.3 累计期末指标	2014 年 7 月 28 日		2013 年末		2012 年末	
	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B
基金份额累计净值增长率	7.62%	6.80%	5.11%	4.50%	8.14%	7.84%

注：1、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，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。

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。

4、本报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日（合同失效前日）止。

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

1. 国联安定期开放债券 A:

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	-	-	-	-	-	-
过去六个月(自 2014 年 7 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日)	0.59%	0.06%	0.23%	0.01%	0.36%	0.05%
过去一年(自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日)	2.39%	0.09%	1.72%	0.01%	0.67%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自原基金合同生效起至原基金合同终止日(自 2012 年 2 月 22 日至 2014 年 7 月 28 日)	7.62%	0.16%	7.46%	0.01%	0.16%	0.15%

注：1、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效；

2、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率；

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。

2. 国联安定期开放债券 B:

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	-	-	-	-	-	-
过去六个月(自 2014 年 7 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日)	0.59%	0.06%	0.23%	0.01%	0.36%	0.05%
过去一年(自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日)	2.20%	0.09%	1.72%	0.01%	0.48%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自原基金合同生效起至原基金合同终止日(自 2012 年 2 月 22 日至 2014 年 7 月 28 日)	6.80%	0.16%	7.46%	0.01%	-0.66%	0.15%

注：1、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效；

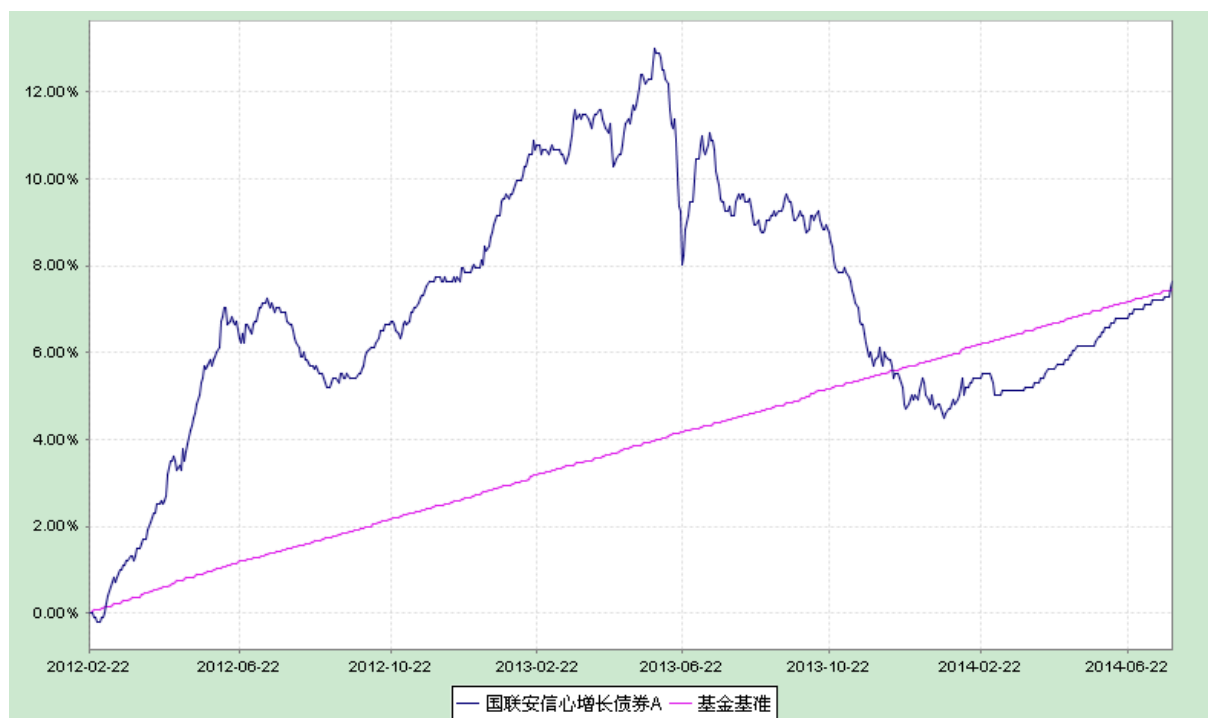
2、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率；

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。

3.2.2.2 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

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金
 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 2 月 22 日至 2014 年 7 月 28 日)

1、国联安定期开放债券 A



注：1、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效；

2、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率；

3、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的基金合同于 2012 年 2 月 22 日生效，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。

2、国联安定期开放债券 B



注：1、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效；

2、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率；

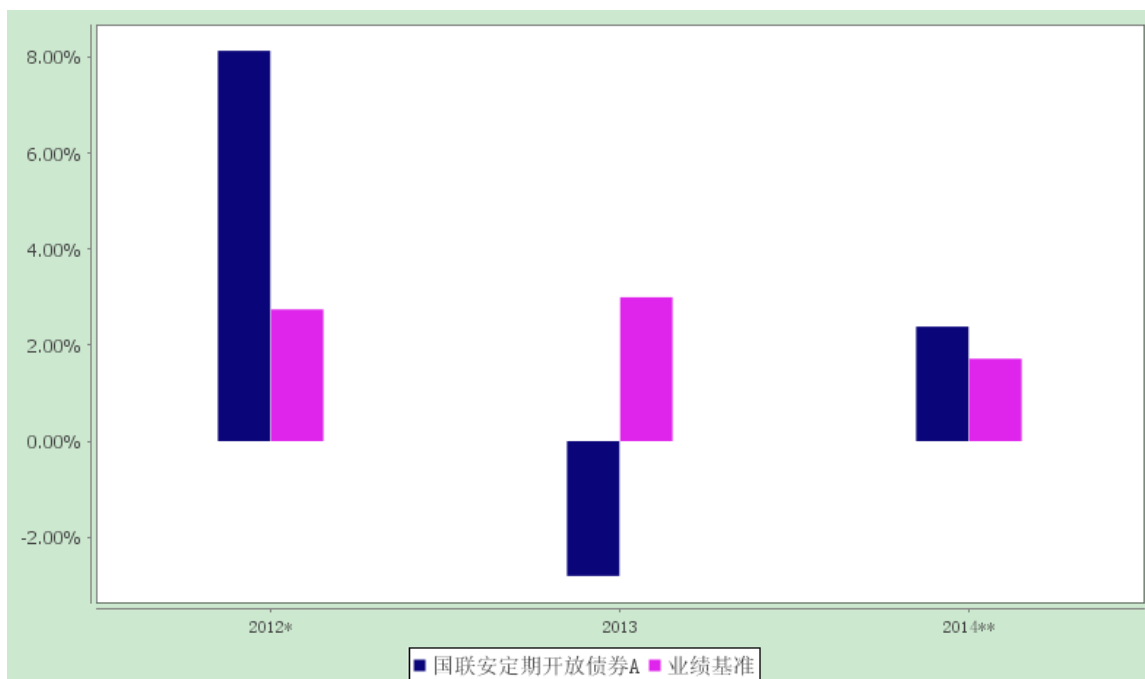
3、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的基金合同于 2012 年 2 月 22 日生效，建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金
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

1、国联安定期开放债券 A



注：1、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效；

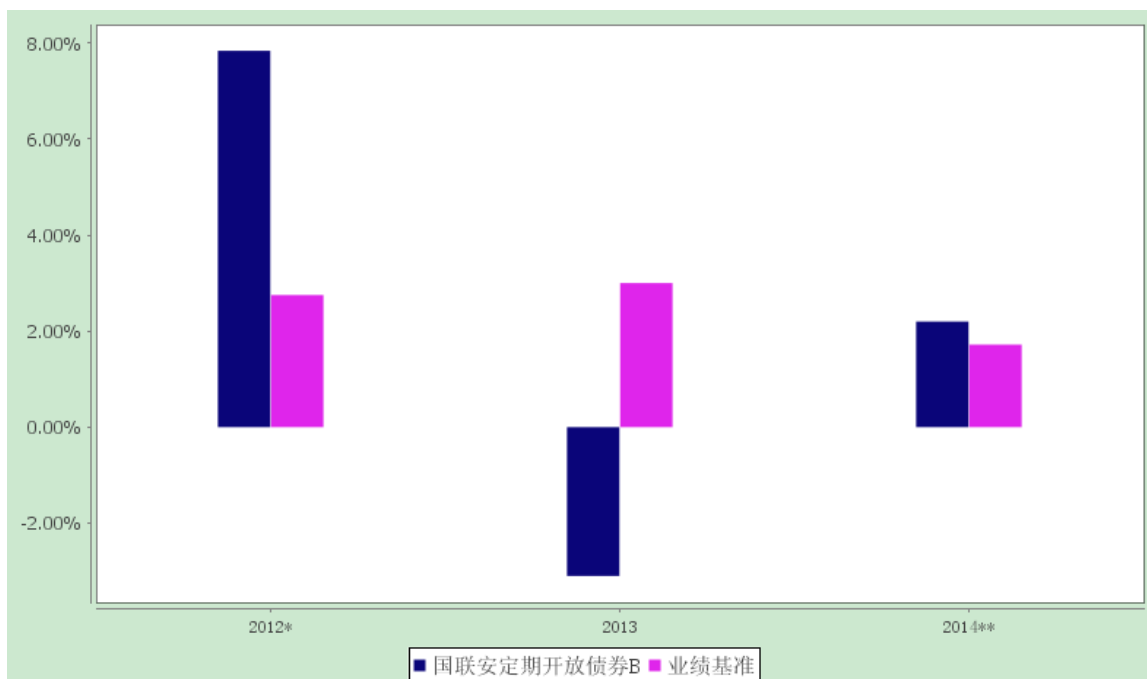
2、原国联安心增长定期开放债券型证券投资基金的基金合同于 2012 年 2 月 22 日生效；

3、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

4、**基金合同失效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。

2、国联安定期开放债券 B



注：1、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效；

2、原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的基金合同于 2012 年 2 月 22 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、**基金合同失效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

1、国联安定期开放债券 A：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	0.320	47,967,860.00	-	47,967,860.00	-
2013	-	-	-	-	-
2012	0.130	1,622,437.43	-	1,622,437.43	-
合计	0.450	49,590,297.43	-	49,590,297.43	-

2、国联安定期开放债券 B：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	0.320	14,502,786.68	-	14,502,786.68	-
2013	-	-	-	-	-
2012	0.130	1,572,198.69	-	1,572,198.69	-
合计	0.450	16,074,985.37	-	16,074,985.37	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理二十三只开放式基金。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		
袁新钊	本基金基金经理、兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、国联安保本混合型证券投资基金基金经理、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2012-03-31	2014-12-08	7年（自2007年起）	袁新钊先生，北京大学经济学硕士。曾任法国巴黎银行(中国)有限公司固定收益产品研究员；国泰君安证券股份有限公司研究员助理、研究员。2011年4月起加入国联安基金管理有限公司，曾担任基金经理助理。2012年3月至2014年12月担任本基金基金经理。2012年6月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理，2013年4月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理，2014年6月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基

					金基金经理助理。
李广瑜	本基金基金经理、兼任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理助理、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2013-12-25	-	5 年（自 2009 年起）	李广瑜先生，硕士研究生，注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)。曾任晨星资讯有限公司分析师，渣打银行有限责任公司国际管理培训生，海富通基金管理有限公司债券投资经理，太平资产管理有限公司债券投资经理。2013 年 6 月起加入国联安基金管理有限公司，2013 年 6 月起担任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理助理，2013 年 11 月起兼任国联安德盛增利债券型证券投资基金基金经理，2013 年 12 月起兼任本基金基金经理、2014 年 7 月起兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2014-12-08	-	13 年（自 2001 年起）	冯俊先生，复旦大学经济学博士。曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管，光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员，长盛基金管理有限公司基金经理助理，泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理。2008 年 10 月起加入国联安基金管理有限公司，现任债券组合管理部总监。2009 年 3 月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理，2010 年 6 月至 2013 年 7 月兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理，2013 年 7 月起兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理，2014 年 6 月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2014 年 12 月起兼任本基金基金经理。

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》、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》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。

本报告期内,本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超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 2 次,一次是两个投资组合根据不同的投资策略进行的调仓操作,一次是其中一个投资组合即将到期进行的清仓操作。

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

2014 年债券市场整体先扬后抑,由于上半年基本面利好债券市场,在降低社会融资成本的大方向指导下,资金面保持相对宽松的局面,因此债券行情上半年稳步下行,10 年期国债收益率从年初 4.65%逐步下降到 3.6%附近,造就了一段债券大牛市。3 季度波动加大,利率出现一定回升后继续下行。到了 4 季度末,由于债券收益率处于较低水平,另外巨额 IPO 申购及年关效应造就了债券市场资金极度紧张的大背景,叠加的中证登质押率新规事件引发债券市场大调整,债券短期强烈的避险卖出要求使得债券收益率快速反弹。

本基金在上半年从封闭式基金转型到开放式基金,为了保持流动性,配置短久期品种;下半年,由于收益率下行较多,策略偏谨慎,维持中性久期及仓位,中证登质押率新规事件发生后,及时调整仓位,但因为本次事件引发的短期赎回规模较大,整体杠杆水平被动抬升,影响了组合业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内(自 2014 年 7 月 29 日起至 2014 年 12 月 31 日止),国联安信心增长债券 A 的份额净值增长率为 3.01%,同期业绩比较基准收益率为 5.13%;国联安信心增长债券 B 的份额净值增长率为 2.84%,同期业绩比较基准收益率为 5.13%。

截至 2014 年 7 月 28 日(原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的基金合同失效日前

日), 本报告期内(自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 7 月 28 日止), 国联安定期开放债券 A 的份额净值增长率为 2.39%, 同期业绩比较基准收益率为 1.72%; 国联安定期开放债券 B 的份额净值增长率为 2.20%, 同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年,大宗商品价格处于温和低位, 通胀无忧;债券供需情况有所改善,年初机构有配置压力;高收益债仍有较强配置需求;货币政策仍有放松空间;社会融资成本仍处于高位, 实际利率需要实质性回落才能看到经济复苏, 信用债绝对收益率水平仍有下行空间, 因此整体上看, 债券资产仍有较好的配置价值。但是债券市场目前还有诸多不确定因素, 比如今年增加的 IPO 是否会给资金面带来大的扰动, 政府对城投债的态度, 央行能否有效的引导社会融资利率下行以及资金面能否进一步宽松。

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、要案尤其是“老鼠仓”案件的速度和数量达到空前, 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, 强调了八个“不得”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, 高度重视投研“三条底线”和八个“不得”原则。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, 本基金对本报告期内利润分配情况如下, 符合本基金基金合同的相关规定。

本基金以截止至 2013 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准, 于 2014 年 1 月 13 日实施分红, 向截止至 2014 年 1 月 10 日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人, 按每 10 份基金份额 (A 类) 0.320 元派发红利, 按每 10 份基金份额 (B 类) 0.320 元派发红利。共发放红利 62,470,646.68 元。

本基金以截止至 2014 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准, 于 2015 年 1 月 23 日实施分红, 向截止至 2015 年 1 月 22 日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人, 按每 10 份基金份额 (A 类) 0.200 元派发红利, 按每 10 份基金份额 (B 类) 0.120 元派发红利。共发放红利 4,290,957.09 元。

§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

本报告期内, 作为本基金的托管人, 中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律

法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——国联安基金管理有限责任公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金于本报告年度进行了 1 次分红，经本托管人复核，符合合同相关要求，不存在损害持有人利益的情况。

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

由基金管理人——国联安基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 国联安信心增长债券型证券投资基金

毕马威华振审字第 1500274 号

国联安信心增长债券型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信心增长债券型证券投资基金(以下简称“国联安信心增长基金”)财务报表,包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2014 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 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信心增长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，国联安信心增长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，公允反映了国联安信心增长基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2014 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 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 注册会计师 石海云、张楠

上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼

2015-03-26

6.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金

毕马威华振审字第 1500275 号

国联安信心增长定期开放债券型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信心增长定期开放债券型证券投资基金(以下简称“国联安定期开放基金”)财务报表，包括 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)的资产负债表、自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)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定期开放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定期开放基金管理人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，国联安定期开放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，公允反映了国联安定期开放基金 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)的财务状况以及自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)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 注册会计师 石海云、张楠

上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼

2015-03-26

§7 年度财务报表

7.1 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）

7.1.1 资产负债表

会计主体：国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 7 月 28 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 7 月 28 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.1.4.7.1	4,467,530.96	21,677,745.51
结算备付金		525,111.46	92,381,693.35
存出保证金		240,932.54	520,053.42
交易性金融资产	7.1.4.7.2	309,054,176.12	1,936,196,089.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		309,054,176.12	1,936,196,089.00
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	26,000,000.00	374,031,281.05
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.1.4.7.5	3,885,593.06	51,506,698.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.1.4.7.6	-	-
资产总计		344,173,344.14	2,476,313,561.27
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2014 年 7 月 28 日	2013 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		-	430,000,000.00
应付证券清算款		-	20,271,659.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		183,561.00	1,206,419.36
应付托管费		52,445.99	344,691.24
应付销售服务费		17,899.23	119,555.76
应付交易费用	7.1.4.7.7	2,839.70	9,072.87
应交税费		357,692.90	357,576.90
应付利息		-	51,503.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.1.4.7.8	257,869.21	260,000.00
负债合计		872,308.03	452,620,478.77
所有者权益:		-	-
实收基金	7.1.4.7.9	333,823,276.84	1,952,207,668.62
未分配利润	7.1.4.7.10	9,477,759.27	71,485,413.88
所有者权益合计		343,301,036.11	2,023,693,082.50
负债和所有者权益总计		344,173,344.14	2,476,313,561.27

注：报告截止日 2014 年 7 月 28 日（基金合同失效前日），国联安定期开放债券 A 基金份额净值 1.030 元，国联安定期开放债券 B 基金份额净值 1.022 元。基金份额总额 333,823,276.84 份，其中国联安定期开放债券 A 基金份额 257,399,959.84 份，国联安定期开放债券 B 基金份额 76,423,317.00 份。

7.1.2 利润表

会计主体：国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日-2014 年 7 月 28 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		20,351,230.38	-38,433,114.86
1.利息收入		21,697,514.17	132,687,847.32
其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	508,651.74	1,404,670.41
债券利息收入		12,551,017.55	130,157,115.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,637,844.88	1,126,061.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-83,078,346.94	-87,080,978.12
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	-	3,013,051.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-83,078,346.94	-90,094,029.67
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.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.16	81,556,814.52	-84,058,075.52
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	175,248.63	18,091.46
减：二、费用		5,844,292.08	64,425,636.87
1. 管理人报酬		3,327,313.59	12,711,674.51
2. 托管费		950,660.95	3,631,906.95
3. 销售服务费		328,421.48	1,292,143.65
4. 交易费用	7.1.4.7.18	16,878.75	301,416.27

5. 利息支出		1,012,517.39	46,146,887.03
其中：卖出回购金融资产支出		1,012,517.39	46,146,887.03
6. 其他费用	7.1.4.7.19	208,499.92	341,608.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,506,938.30	-102,858,751.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,506,938.30	-102,858,751.73

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 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）	1,952,207,668.62	71,485,413.88	2,023,693,082.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,506,938.30	14,506,938.30
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）	-1,618,384,391.78	-14,043,946.23	-1,632,428,338.01
其中：1.基金申购款	247,993,848.93	1,008,201.41	249,002,050.34
2.基金赎回款	-1,866,378,240.71	-15,052,147.64	-1,881,430,388.35
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）	-	-62,470,646.68	-62,470,646.68

五、期末所有者权益(基金净值)	333,823,276.84	9,477,759.27	343,301,036.11
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	245,741,306.29	16,275,315.21	262,016,621.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-102,858,751.73	-102,858,751.73
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)	1,706,466,362.33	158,068,850.40	1,864,535,212.73
其中：1.基金申购款	1,853,659,188.54	171,598,293.41	2,025,257,481.95
2.基金赎回款	-147,192,826.21	-13,529,443.01	-160,722,269.22
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)	1,952,207,668.62	71,485,413.88	2,023,693,082.50

注：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：虞启斌，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

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金(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”)《关于核准国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011] 1945 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《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2012 年 2 月 22 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 245,741,306.29 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, 基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%, 但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内, 基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股, 并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证等, 以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产, 本基金将在其上市交易或流通受限解除后的 180 个交易日之内卖出。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产。本基金投资于非固定收益类资产(不含现金)的比例不超过基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会于 2014 年 5 月 19 日审议通过《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型议案》, 并于 2014 年 7 月 29 日在中国证监会完成备案手续, 《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》自 2014 年 7 月 29 日起失效, 《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》于当日生效。

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公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

经向中国证监会备案，基金管理人国联安基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为国联安信心增长债券型证券投资基金，存续期为不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

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 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)的财务状况、自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日(基金合同失效前日)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、应收款项和其他金融负债。

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

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

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。

—应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

—其他金融负债

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

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

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

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

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

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

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。

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。由于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。由于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

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

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

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

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

根据《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率逐日计提。

根据《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率逐日计提。

根据《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额按前一日 B 类基金份额资产净值 0.3% 的年费率逐日计提销售服务费。

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。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，但本基金同一类别内的每一基金份额享有同等收益分配权。封闭期间(指基金红利发放日处于封闭期)，基金收益分配采用现金方式；开放期间(指基金红利发放日处于开放期)，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，如投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，最多 12 次，每次分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 80%，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。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。

7.1.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值

业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

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

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

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

本基金于 2014 年 7 月 1 日起执行下述财政部新颁布/修订的企业会计准则：

- (i) 《企业会计准则第 2 号—长期股权投资》(以下简称“准则 2 号(2014)”))
- (ii) 《企业会计准则第 9 号—职工薪酬》(以下简称“准则 9 号(2014)”))
- (iii) 《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》(以下简称“准则 30(2014)”))
- (iv) 《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》(以下简称“准则 33(2014)”))
- (v) 《企业会计准则第 39 号—公允价值计量》(以下简称“准则 39 号”))
- (vi) 《企业会计准则第 40 号—合营安排》(以下简称“准则 40 号”))
- (vii) 《企业会计准则第 41 号—在其他主体中权益的披露》(以下简称“准则 41 号”))

同时，本基金于 2014 年 3 月 17 日开始执行财政部颁布的《金融负债与权益工具的区分及相关会计处理规定》(“财会[2014]13 号文”) 以及在 2014 年度财务报告中开始执行财政部修订的《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“准则 37 号(2014)”))。

采用上述企业会计准则后的主要会计政策已在附注 7.4.4.4 列示。采用上述企业会计准则对本基金本报告期无重大影响。

7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过会计差错。

7.1.4.6 税项

1、主要税项说明

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

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

2、应交税费

债券利息收入所得税 2014 年 07 月 28 日：357,692.90 元，

2013 年 12 月 31 日：357,576.90 元。

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

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
	2014 年 7 月 28 日	2013 年 12 月 31 日
活期存款	4,467,530.96	21,677,745.51
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	4,467,530.96	21,677,745.51

7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2014 年 7 月 28 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	56,428,578.23	57,850,176.12	1,421,597.89
	银行间市场	250,387,223.12	251,204,000.00	816,776.88
	合计	306,815,801.35	309,054,176.12	2,238,374.77
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	306,815,801.35	309,054,176.12	2,238,374.77	
项目	上年度末			
	2013 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,152,095,456.28	1,110,926,089.00	-41,169,367.28
	银行间市场	863,419,072.47	825,270,000.00	-38,149,072.47
	合计	2,015,514,528.75	1,936,196,089.00	-79,318,439.75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,015,514,528.75	1,936,196,089.00	-79,318,439.75

7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2014 年 7 月 28 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），本基金均未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 7 月 28 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	26,000,000.00	-
合计	26,000,000.00	-
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	374,031,281.05	-
合计	374,031,281.05	-

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（2014 年 7 月 28 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），本基金均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 7 月 28 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	16,137.79	8,609.02
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	1,077.57	45,728.87
应收债券利息	3,843,143.75	50,715,023.09
应收买入返售证券利息	24,811.86	737,080.56
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	422.09	257.40
合计	3,885,593.06	51,506,698.94

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

7.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2014 年 7 月 28 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日）均未持有其他资产。

7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 7 月 28 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	2,839.70	9,072.87
合计	2,839.70	9,072.87

7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2014 年 7 月 28 日	2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
信息披露费用	214,923.89	185,000.00
审计费用	42,945.32	75,000.00
合计	257,869.21	260,000.00

7.1.4.7.9 实收基金

国联安定期开放债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年7月28日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,498,995,613.14	1,498,995,613.14
本期申购	197,854,503.14	197,854,503.14
本期赎回（以“-”号填列）	-1,439,450,156.44	-1,439,450,156.44
本期末	257,399,959.84	257,399,959.84

国联安定期开放债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年7月28日	
	基金份额	账面金额
上年度末	453,212,055.48	453,212,055.48
本期申购	50,139,345.79	50,139,345.79
本期赎回（以“-”号填列）	-426,928,084.27	-426,928,084.27
本期末	76,423,317.00	76,423,317.00

7.1.4.7.10 未分配利润

国联安定期开放债券 A

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	89,119,968.34	-32,318,840.27	56,801,128.07

本期利润	-50,749,700.67	62,376,442.40	11,626,741.73
本期基金份额交易产生的变动数	7,227,482.14	-19,889,081.58	-12,661,599.44
其中：基金申购款	-4,347,966.11	5,456,313.31	1,108,347.20
基金赎回款	11,575,448.25	-25,345,394.89	-13,769,946.64
本期已分配利润	-47,967,860.00	-	-47,967,860.00
本期末	-2,370,110.19	10,168,520.55	7,798,410.36

国联安定期开放债券 B

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	24,370,899.19	-9,686,613.38	14,684,285.81
本期利润	-16,300,175.55	19,180,372.12	2,880,196.57
本期基金份额交易产生的变动数	5,107,338.40	-6,489,685.19	-1,382,346.79
其中：基金申购款	-1,537,953.36	1,437,807.57	-100,145.79
基金赎回款	6,645,291.76	-7,927,492.76	-1,282,201.00
本期已分配利润	-14,502,786.68	-	-14,502,786.68
本期末	-1,324,724.64	3,004,073.55	1,679,348.91

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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	214,241.44	403,156.62
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	290,820.08	995,317.28
其他	3,590.22	6,196.51

合计	508,651.74	1,404,670.41
----	------------	--------------

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

7.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年7 月28日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12 月31日
卖出股票成交总额	-	122,437,291.59
减：卖出股票成本总额	-	119,424,240.04
买卖股票差价收入	-	3,013,051.55

注：本基金本报告期间没有股票投资收益。

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

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年7 月28日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12 月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-83,078,346.94	-90,094,029.67
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-83,078,346.94	-90,094,029.67

7.1.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年7 月28日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,305,360,748.59	4,535,413,366.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,327,557,060.97	4,522,617,750.48
减：应收利息总额	60,882,034.56	102,889,645.81
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-83,078,346.94	-90,094,029.67

7.1.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.1.4.7.13.3 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内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投资收益。

7.1.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

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
	2014年1月1日至2014年7月28日	2013年1月1日至2013年12月31日
1.交易性金融资产	81,556,814.52	-84,058,075.52
——股票投资	-	-
——债券投资	81,556,814.52	-84,058,075.52
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	81,556,814.52	-84,058,075.52

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

	2014年1月1日至2014年7月28日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	175,248.63	11,297.49
其他	-	6,793.97
合计	175,248.63	18,091.46

注：1、本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

2、其他收入为本基金上交所及深交所的证管费返还。

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
	2014年1月1日至2014年7月28日	2013年1月1日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	3,878.75	274,941.27
银行间市场交易费用	13,000.00	26,475.00
合计	16,878.75	301,416.27

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
	2014年1月1日至2014年7月28日	2013年1月1日至2013年12月31日
审计费用	42,945.32	75,000.00
信息披露费	129,923.89	185,000.00
其他	35,630.71	81,608.46
合计	208,499.92	341,608.46

注：其他费用为账户维护费、划款手续费及数字证书费。

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，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.1.4.8.2 资产负债表日后事项

原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 7 月 29 日起

失效,《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》于同日起生效,同时本基金更名为国联安信心增长债券型证券投资基金。

7.1.4.9 关联方关系

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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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

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。

本基金于 2014 年 7 月 29 日转型,本报告期为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日(下同)。

7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年7月28日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
国泰君安	-	-	122,437,291.59	100.00%

注:本基金本报告期与关联方无股票交易。

7.1.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

7.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年7月28日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券 比例	成交金额	占当期债券 比例

		券成交总 额的比例		券成交总 额的比例
国泰君安	1,060,839,868.09	92.77%	6,340,189,319.02	87.09%

7.1.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年7月28日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例
国泰君安	24,700,900,000.00	99.46%	140,400,100,000.00	92.71%

7.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 28 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	0.00	0.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	111,467.12	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券及权证交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

2、本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年7月28日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,327,313.59	12,711,674.51
其中：支付销售机构的客户维护费	777,778.44	3,535,655.01

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提，逐日累计至每月月末，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×0.7%/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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年7月28日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	950,660.95	3,631,906.95

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.2%/当年天数。

7.1.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2014年1月1日至2014年7月28日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B	合计
国联安基金管理有限 公司	-	60,991.60	60,991.60
国泰君安	-	20,613.34	20,613.34
中信银行	-	212,386.15	212,386.15
合计	-	293,991.09	293,991.09
获得销售服务费的各	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B	合计
国联安基金管理有限 公司	-	11,547.34	11,547.34
国泰君安	-	103,400.29	103,400.29
中信银行	-	1,032,656.17	1,032,656.17
合计	-	1,147,603.80	1,147,603.80

注：1、国联安定期开放债券 A 基金份额：不收取销售服务费；

2、国联安定期开放债券 B 基金份额：收取销售服务费：

(1) 计算标准

支付基金销售机构的国联安定期开放债券 B 基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.3% 年费率计提，每日计提，按月支付。

(2) 计算方式

B 类基金份额每日应计提的销售服务费 = B 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.3% / 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

单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年7月28日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安证 券股份有限 公司	-	60,676,143. 43	-	-	69,000,000.00	45,398.84
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安证 券股份有限 公司	-	111,851,299 .46	-	-	-	-

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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年7月28日		2013年1月1日至2013年12月31日	
	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	48,595,775.12	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	48,595,775.12	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.88%	-	-	-

注：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

国联安定期开放债券 A

份额单位：份

关联方名称	国联安定期开放债券 A 本期末 2014 年 7 月 28 日		国联安定期开放债券 A 上年度末 2013 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

		例		
国泰君安证券股份有限公司	99,501,492.54	38.66%		
中德安联人寿保险有限公司	-	-	19,998,727.78	1.02%

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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年7月28日		2013年1月1日至2013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
中信银行	4,467,530.96	214,241.44	21,677,745.51	403,156.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计算。

本基金通过“中信银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2014 年 7 月 28 日的相关余额为人民币 525,111.46 元（2013 年 12 月 31 日：人民币 92,381,693.35 元）。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.1.4.11 利润分配情况

国联安定期开放债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2014-01-10		2014-01-10	0.320	47,967,860.00	0.00	47,967,860.00	-

合计			0.320	47,967,860.0 0	-	47,967,860.0 0	-
----	--	--	-------	-------------------	---	-------------------	---

国联安定期开放债券 B

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2014-01-10		2014- 01-10	0.320	14,502,786.6 8	-	14,502,786.6 8	-
合计				0.320	14,502,786.6 8	-	14,502,786.6 8	-

7.1.4.12 期末（2014 年 7 月 28 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

金额单位：人民币元

7.1.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11002 8	冠城 转债	2014-0 7-23	2014-0 8-01	新债 网下 发行	100.00	99.98	12,650 .00	1,264, 800.37	1,264, 800.37	-

注：本基金本报告期末未持有其他因认购首发或增发而受上述规定约束的流通受限的股票、权证或其他类别的证券。

7.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2014 年 7 月 28 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 2014 年 7 月 28 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为 0 元。

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

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金(以下简称“增长定期开放”)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

增长定期开放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。

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

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

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。增长定期开放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。增长定期开放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%，且增长定期开放与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

增长定期开放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；增长定期开放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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年7月28日 (基金合同失效前日)	上年末 2013年12月31日
A-1	200,511,000.00	109,813,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	200,511,000.00	109,813,000.00

注：本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

7.1.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014年7月28日 (基金合同失效前日)	上年末 2013年12月31日
AAA	8,187,569.80	400,435,335.10
AAA 以下	100,355,606.32	1,425,947,753.90
未评级	-	-
合计	108,543,176.12	1,826,383,089.00

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资；

2、根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件

的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级；

3、本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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。增长定期开放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。增长定期开放所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可用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，增长定期开放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。

增长定期开放的基金管理人每日预测增长定期开放的流动性需求，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。增长定期开放的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。增长定期开放的基金管理人每日对增长定期开放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 2014 年 7 月 28 日 (基金 合同失	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
---	------------	-----------	------------	--------------	--------------	-----------	-------	-----------	-----	----

效前日)										
资产										
银行存款	4,467,530.96	-	-	-	-	-	-	-	-	4,467,530.96
结算备付金	525,111.46	-	-	-	-	-	-	-	-	525,111.46
存出保证金	240,932.54	-	-	-	-	-	-	-	-	240,932.54
交易性金融资产	52,831,961.50	59,991,000.00	-	118,067,296.97	-	-	47,877,065.35	30,286,852.30	-	309,054,176.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	26,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	26,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	3,885,593.06	3,885,593.06
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	84,065,536.46	59,991,000.00	-	118,067,296.97	-	-	47,877,065.35	30,286,852.30	3,885,593.06	344,173,344.14
负债										
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	183,561.00	183,561.00
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	52,445.99	52,445.99
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-	-	17,899.23	17,899.23

费											
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	2,839.70	2,839.70	
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	357,692.90	357,692.90	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	257,869.21	257,869.21	
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	872,308.03	872,308.03	
利率敏感度缺口	84,065,536.46	59,991,000.00	-	118,067,296.97	0.00	0.00	47,877,065.35	30,286,852.30	3,013,285.03	343,301,036.11	
上年度末 2013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	21,677,745.51	-	-	-	-	-	-	-	-	21,677,745.51	
结算备付金	92,381,693.35	-	-	-	-	-	-	-	-	92,381,693.35	
存出保证金	520,053.42	-	-	-	-	-	-	-	-	520,053.42	
交易性金融资产	21,100,000.00	220,902,797.30	-	378,655,854.50	-	-	805,376,084.40	510,161,352.80	-	1,936,196,089.00	
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
买入返售金融资产	374,031,281.05	-	-	-	-	-	-	-	-	374,031,281.05	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	51,506,698.94	51,506,698.94	
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	509,710,773.33	220,902,797.30	-	378,655,854.50	-	-	805,376,084.40	510,161,352.80	51,506,698.94	2,476,313,561.27
负债										
卖出回购金融资产款	430,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	430,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	20,271,659.60	20,271,659.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	1,206,419.36	1,206,419.36
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	344,691.24	344,691.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	119,555.76	119,555.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	9,072.87	9,072.87
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	357,576.90	357,576.90
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	51,503.04	51,503.04
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	260,000.00	260,000.00
负债总计	430,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	22,620,478.77	452,620,478.77
利率敏感度缺口	79,710,773.33	220,902,797.30	-	378,655,854.50	-	-	805,376,084.40	510,161,352.80	28,886,220.17	2,023,693,082.50

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

7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2014 年 7 月 28 日 (基金合同失效前日)	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加 752,362.79	增加 10,949,139.70
	市场利率上升 25 个基点	减少 752,362.79	减少 10,949,139.70

注：本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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。

增长定期开放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

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。增长定期开放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。增长定期开放通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且增长定期开放的基金管理人每日对增长定期开放所持有的证券价格实施监控。

增长定期开放的投资组合中债券投资为 90.02%，无股票投资和衍生金融资产。于 2014 年 7 月 28 日，增长定期开放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 2014 年 7 月 28 日 (基金合同失效前日)		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金资产

		产净值比 例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	309,054,176.12	90.02	1,936,196,089 .00	95.68
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	309,054,176.12	90.02	1,936,196,089 .00	95.68

7.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金自 2014 年 7 月 29 日起，由《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

于 2014 年 7 月 28 日(原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金的基金合同失效前日)，增长定期开放未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于增长定期开放的资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

上年度末，增长定期开放未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于增长定期开放的资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

7.2 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）

7.2.1 资产负债表

会计主体：国联安信心增长债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.2.4.7.1	4,622,890.63

结算备付金		9,087,753.00
存出保证金		41,796.48
交易性金融资产	7.2.4.7.2	341,866,854.14
其中：股票投资		6,549,636.00
基金投资		-
债券投资		335,317,218.14
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		6,266,460.22
应收利息	7.2.4.7.5	9,753,720.41
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.2.4.7.6	-
资产总计		371,639,474.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.2.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		118,799,561.80
应付证券清算款		5,475,964.96
应付赎回款		5,235.30
应付管理人报酬		150,319.63
应付托管费		42,948.45
应付销售服务费		4,627.66

应付交易费用	7.2.4.7.7	136,648.90
应交税费		357,706.70
应付利息		15,661.82
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.2.4.7.8	280,000.00
负债合计		125,268,675.22
所有者权益：		-
实收基金	7.2.4.7.9	232,449,771.60
未分配利润	7.2.4.7.10	13,921,028.06
所有者权益合计		246,370,799.66
负债和所有者权益总计		371,639,474.88

注：1、报告截止日 2014 年 12 月 31 日，国联安信心增长债券 A 基金份额净值 1.061 元，国联安信心增长债券 B 基金份额净值 1.051 元。基金份额总额 232,449,771.60 份，其中国联安信心增长债券 A 基金份额 215,559,096.27 份，国联安信心增长债券 B 基金份额 16,890,675.33 份；

2、本基金于 2014 年 7 月 29 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2014 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日（下同）。

7.2.2 利润表

会计主体：国联安信心增长债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 7 月 29 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2014 年 7 月 29 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		7,862,758.30
1.利息收入		5,603,218.80
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	88,494.10
债券利息收入		5,504,238.02
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		10,486.68

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,807,548.74
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	-874,837.94
基金投资收益		-
债券投资收益	7.2.4.7.13	5,682,386.68
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	-2,548,661.54
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	652.30
减：二、费用		3,231,610.24
1. 管理人报酬		636,423.10
2. 托管费		181,835.13
3. 销售服务费		31,156.55
4. 交易费用	7.2.4.7.18	236,688.50
5. 利息支出		2,019,282.19
其中：卖出回购金融资产支出		2,019,282.19
6. 其他费用	7.2.4.7.19	126,224.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,631,148.06
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,631,148.06

注：本基金于 2014 年 7 月 29 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2014 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日（下同）。

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安信心增长债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 7 月 29 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 7 月 29 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）	333,823,276.84	9,477,759.27	343,301,036.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,631,148.06	4,631,148.06
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）	-101,373,505.24	-187,879.27	-101,561,384.51
其中：1.基金申购款	122,502,700.86	7,705,738.90	130,208,439.76
2.基金赎回款	-223,876,206.10	-7,893,618.17	-231,769,824.27
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）	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	232,449,771.60	13,921,028.06	246,370,799.66

注：1、本基金于 2014 年 7 月 29 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2014 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日（下同）。

2、本表中“期初所有者权益（基金净值）”为基金合同生效日即 2014 年 7 月 29 日的数。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：庾启斌，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

国联安信心增长债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而成。国联安信心增长定期开放债券型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”)《关于核准国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011] 1945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《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于2012年2月22日生效。国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会于2014年5月19日审议通过《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型议案》, 并于2014年7月29日在中国证监会完成备案手续, 原《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》自2014年7月29日起失效, 《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》于当日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 基金合同生效日基金规模为333,823,276.84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, 基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》和《国联安信心增长债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下, 本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%, 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%; 投资于非固定收益类资产(不含现金)的比例不超过基金资产的20%。本基金的业绩比较基准为中证全债指数。

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公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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 2014 年 12 月 31 日的财务状况、自 2014 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 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 2014 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 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、应收款项和其他金融负债。

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

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

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。

—应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

—其他金融负债

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

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

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

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

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

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

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。

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。由于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。由于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

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

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

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

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

根据《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率逐日计提。

根据《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产

净值 0.2% 的年费率逐日计提。

根据《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额按前一日 B 类基金份额资产净值 0.3% 的年费率逐日计提销售服务费。

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

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，但本基金同一类别内的每一基金份额享有同等收益分配权。本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，如投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为 1 次，最多 12 次，每次分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 80%，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。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。

7.2.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称“《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》”)，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收

盘价低于非公开发行股票的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。

7.2.4.5 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

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

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

1、主要税项说明

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

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂

免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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

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

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

2、 应交税费

债券利息收入所得税 2014 年 12 月 31 日：357,706.70 元，

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

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 2014 年 12 月 31 日	
	活期存款	4,622,890.63
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	4,622,890.63	

7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,222,858.14	6,549,636.00	326,777.86

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	180,437,106.51	180,785,718.14	348,611.63
	银行间市场	155,517,176.26	154,531,500.00	-985,676.26
	合计	335,954,282.77	335,317,218.14	-637,064.63
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		342,177,140.91	341,866,854.14	-310,286.77

7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2014 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（2014 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（2014 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 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,231.49
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	4,498.45
应收债券利息	9,747,969.79
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20.68
合计	9,753,720.41

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2014 年 12 月 31 日）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 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	126,870.84
银行间市场应付交易费用	9,778.06
合计	136,648.90

7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
信息披露费用	215,000.00
审计费用	65,000.00
合计	280,000.00

7.2.4.7.9 实收基金

国联安信心增长债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年7月29日至2014年12月31日	
	基金份额	账面金额

基金合同生效日	257,399,959.84	257,399,959.84
本期申购	122,336,091.48	122,336,091.48
本期赎回（以“-”号填列）	-164,176,955.05	-164,176,955.05
本期末	215,559,096.27	215,559,096.27

注：原基金国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金于基金合同失效前的基金资产净值为 343,301,036.11 元（A 级净值为 265,198,370.20 元，B 级净值为 78,102,665.91 元），已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

国联安信心增长债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年7月29日至2014年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	76,423,317.00	76,423,317.00
本期申购	166,609.38	166,609.38
本期赎回（以“-”号填列）	-59,699,251.05	-59,699,251.05
本期末	16,890,675.33	16,890,675.33

注：原基金国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金于基金合同失效前的基金资产净值为 343,301,036.11 元（A 级净值为 265,198,370.20 元，B 级净值为 78,102,665.91 元），已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

7.2.4.7.10 未分配利润

国联安信心增长债券 A

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	-2,370,110.19	10,168,520.55	7,798,410.36
本期利润	6,211,439.43	-2,342,204.79	3,869,234.64
本期基金份额交易产生的变动数	1,459,604.60	-59,971.06	1,399,633.54
其中：基金申购款	1,482,741.42	6,214,606.86	7,697,348.28
基金赎回款	-23,136.82	-6,274,577.92	-6,297,714.74
本期已分配利润	-	-	-

本期末	5,300,933.84	7,766,344.70	13,067,278.54
-----	--------------	--------------	---------------

注：原基金国联安心心增长定期开放债券型证券投资基金于基金合同失效前的基金资产净值为 343,301,036.11 元（A 级净值为 265,198,370.20 元，B 级净值为 78,102,665.91 元），已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

国联安心心增长债券 B

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	-1,324,724.64	3,004,073.55	1,679,348.91
本期利润	968,370.17	-206,456.75	761,913.42
本期基金份额交易产生的变动数	604,301.39	-2,191,814.20	-1,587,512.81
其中：基金申购款	426.18	7,964.44	8,390.62
基金赎回款	603,875.21	-2,199,778.64	-1,595,903.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	247,946.92	605,802.60	853,749.52

注：原基金国联安心心增长定期开放债券型证券投资基金于基金合同失效前的基金资产净值为 343,301,036.11 元（A 级净值为 265,198,370.20 元，B 级净值为 78,102,665.91 元），已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

7.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 7 月 29 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	58,348.41
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	29,864.22
其他	281.47
合计	88,494.10

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

7.2.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年7月29日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	73,351,231.25
减：卖出股票成本总额	74,226,069.19
买卖股票差价收入	-874,837.94

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

单位：人民币元

项目	本期
	2014年7月29日至2014年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,682,386.68
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,682,386.68

7.2.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年7月29日至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	428,897,130.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	416,356,252.75
减：应收利息总额	6,858,491.26
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,682,386.68

7.2.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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投资收益。

7.2.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

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
	2014年7月29日至2014年12月31日
1.交易性金融资产	-2,548,661.54
——股票投资	326,777.86
——债券投资	-2,875,439.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-2,548,661.54

7.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年7月29日至2014年12月31日
基金赎回费收入	652.30
合计	652.30

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
	2014年7月29日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	231,563.50
银行间市场交易费用	5,125.00
合计	236,688.50

7.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年7月29日至2014年12月31日
审计费用	22,054.68
信息披露费	70,076.11
其他	34,093.98
合计	126,224.77

注：其他费用为账户维护费、划款手续费、数字证书费及召开持有人大会费用。

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，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2015 年 1 月 23 日实施分红，向截止至 2015 年 1 月 22 日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额（A 类）0.2 元派发红利，按每 10 份基金份额（B 类）0.12 元派发红利，该分红的收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，红利发放日为 2015 年 1 月 23 日，共发放红利 4,290,957.09 元，其中以现金形式发放 4,039,707.93 元，以红利再投资形式发放 251,249.16 元。

7.2.4.9 关联方关系

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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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

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。

本基金基金合同于 2014 年 7 月 29 日生效，本报告期间为 2014 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日(下同)。

7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年7月29日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	66,540,462.75	43.26%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年7月29日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安	231,419,141.52	62.90%

7.2.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年7月29日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	4,031,700,000.00	72.95%

7.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年7月29日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	60,578.73	43.96%	57,394.71	45.24%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券及权证交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

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 2014年7月29日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	636,423.10
其中：支付销售机构的客户维护费	96,786.72

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提，逐日累计至每月月末，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×0.7%/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 2014年7月29日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	181,835.13

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.2%/当年天数。

7.2.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2014年7月29日至2014年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安信心增长债券 A	国联安信心增长债券 B	合计
	国联安基金管理有限 公司	-	3,894.22
国泰君安	-	5,542.45	5,542.45
中信银行	-	15,448.95	15,448.95
合计	-	24,885.62	24,885.62

注：1、国联安信心增长债券 A 基金份额：不收取销售服务费；

2、国联安信心增长债券 B 基金份额：收取销售服务费：

(1) 计算标准

支付基金销售机构的国联安信心增长债券 B 基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.3% 年费率计提，每日计提，按月支付。

(2) 计算方式

B 类基金份额每日应计提的销售服务费 = B 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.3% / 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

本基金本报告期内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

份额单位：份

项目	本期 2014年7月29日至2014年12月31日	
	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
基金合同生效日（2014 年 7 月 29 日）持有的基金份额	48,595,775.12	-
期初持有的基金份额	48,595,775.12	-

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	48,595,775.12	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.54%	-

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

本报告期末除管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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 2014年7月29日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	4,622,890.63	58,348.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计算。

本基金通过“中信银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2014 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 9,087,753.00 元。

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

本基金本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联交易事项。

7.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.2.4.12 期末（2014 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

本基金本报告期末未持有因认购首发或增发而受上述规定约束的流通受限的股票、权证或其他

类别的证券。

7.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2014 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 78,799,561.80 元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量(张)	期末估值总额
1080114	10 华靖债	2015-01-05	75.03	100,000.00	7,503,000.00
1180053	11 宝城投债	2015-01-05	104.69	100,000.00	10,469,000.00
1180130	11 通泰债	2015-01-05	102.57	200,000.00	20,514,000.00
1380037	13 长兴岛债	2015-01-05	102.89	20,000.00	2,057,800.00
1380059	13 大石桥债	2015-01-05	101.94	100,000.00	10,194,000.00
041460106	14 海沧投资 CP002	2015-01-06	99.31	300,000.00	29,793,000.00
合计				820,000.00	80,530,800.00

7.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 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为 40,000,000.00 元, 于 2015 年 1 月 5 日到期。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年12月31日
A-1	49,953,000.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	49,953,000.00

注：本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 年。

7.2.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014年12月31日
AAA	24,197,550.10
AAA 以下	261,166,668.04
未评级	-
合计	285,364,218.14

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资；

2、根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级；

3、本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 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，其余亦可用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 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	4,622,890.63	-	-	-	-	-	-	-	-	4,622,890.63
结算备付金	9,087,753.00	-	-	-	-	-	-	-	-	9,087,753.00
存出保证金	41,796.48	-	-	-	-	-	-	-	-	41,796.48
交易性金融资产	36,471,252.00	31,684,759.80	-	86,202,046.34	-	-	149,551,634.90	31,407,525.10	6,549,636.00	341,866,854.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	6,266,460.22	6,266,460.22
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	9,753,720.41	9,753,720.41
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	50,223,692.11	31,684,759.80	-	86,202,046.34	0.00	0.00	149,551,634.90	31,407,525.10	22,569,816.63	371,639,474.88
负债										
卖出回购金融资产款	118,799,561.80	-	-	-	-	-	-	-	-	118,799,561.80
应付证	-	-	-	-	-	-	-	-	5,475,	5,475,

券清算款									964.96	964.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	5,235.30	5,235.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	150,319.63	150,319.63
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	42,948.45	42,948.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	4,627.66	4,627.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	136,648.90	136,648.90
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	357,706.70	357,706.70
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	15,661.82	15,661.82
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	280,000.00	280,000.00
负债总计	118,799,561.80	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	6,469,113.42	125,268,675.22
利率敏感度缺口	-68,575,869.69	31,684,759.80		86,202,046.34	0.00	0.00	149,551,634.90	31,407,525.10	16,100,703.21	246,370,799.66

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

7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2014 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加 1,655,091.70
	市场利率上升 25 个基点	减少 1,655,091.70

注：本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 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。

本基金投资组合中债券投资比例为基金资产净值的 136.10%，股票投资比例为基金资产净值的 2.66%，无衍生金融资产。于 2014 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 2014 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	6,549,636.00	2.66
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	335,317,218.14	136.10
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	341,866,854.14	138.76

7.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.66%，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 7 月 29 日，本基金基金合同生效日 2014 年 7 月 29 日至报告期末未满 1 年。

§8 投资组合报告

8.1 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	309,054,176.12	89.80
	其中：债券	309,054,176.12	89.80
	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	26,000,000.00	7.55
	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	4,992,642.42	1.45
7	其他各项资产	4,126,525.60	1.20
8	合计	344,173,344.14	100.00

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	93,201,927.65	27.15
5	企业短期融资券	200,511,000.00	58.41
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,341,248.47	4.47
8	其他	-	-
9	合计	309,054,176.12	90.02

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	071407004	14 中信建投 CP004	500,000.00	49,995,000.00	14.56
2	071416008	14 华泰证券 CP008	500,000.00	49,995,000.00	14.56
3	041464010	14 华数 CP001	300,000.00	30,204,000.00	8.80
4	041460031	14 闽西兴杭 CP001	300,000.00	30,183,000.00	8.79
5	041464024	14 武水务 CP001	300,000.00	30,138,000.00	8.78

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投资。

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，增长定期开放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。

8.1.12.2 增长定期开放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	240,932.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,885,593.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,126,525.60

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.2 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）

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	6,549,636.00	1.76
	其中：股票	6,549,636.00	1.76
2	固定收益投资	335,317,218.14	90.23
	其中：债券	335,317,218.14	90.23
	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	13,710,643.63	3.69
7	其他各项资产	16,061,977.11	4.32
8	合计	371,639,474.88	100.00

8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	850,374.00	0.35
C	制造业	4,049,553.00	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	345,030.00	0.14
F	批发和零售业	664,101.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	640,578.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,549,636.00	2.66

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	000401	冀东水泥	70,300.00	918,821.00	0.37
2	600259	广晟有色	15,300.00	850,374.00	0.35
3	000858	五粮液	33,500.00	720,250.00	0.29
4	600809	山西汾酒	31,000.00	709,590.00	0.29
5	600486	扬农化工	23,400.00	704,340.00	0.29
6	600826	兰生股份	33,900.00	664,101.00	0.27
7	600176	中国玻纤	41,600.00	643,552.00	0.26
8	600125	铁龙物流	72,300.00	640,578.00	0.26
9	000157	中联重科	50,000.00	353,000.00	0.14
10	002060	粤水电	46,500.00	345,030.00	0.14

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	600970	中材国际	4,716,085.60	1.91
2	600259	广晟有色	4,617,480.00	1.87
3	000625	长安汽车	4,550,240.00	1.85
4	600661	新南洋	4,470,388.20	1.81
5	600887	伊利股份	4,133,835.51	1.68
6	000937	冀中能源	3,406,411.00	1.38
7	000831	五矿稀土	3,400,183.48	1.38
8	000157	中联重科	3,172,411.48	1.29
9	002051	中工国际	3,164,409.00	1.28
10	000031	中粮地产	3,163,009.00	1.28
11	600648	外高桥	3,160,665.00	1.28
12	000997	新大陆	2,993,966.38	1.22
13	601101	昊华能源	2,685,954.00	1.09
14	000778	新兴铸管	2,434,601.31	0.99
15	000401	冀东水泥	1,959,144.00	0.80
16	600212	江泉实业	1,673,929.00	0.68
17	600125	铁龙物流	1,468,845.00	0.60
18	600392	盛和资源	1,460,275.00	0.59
19	000024	招商地产	1,456,455.00	0.59
20	002465	海格通信	1,383,198.94	0.56

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	600970	中材国际	5,146,759.05	2.09
2	000625	长安汽车	4,441,736.00	1.80
3	600259	广晟有色	4,032,953.00	1.64
4	600887	伊利股份	3,932,904.12	1.60
5	600661	新南洋	3,930,236.11	1.60
6	000831	五矿稀土	3,323,060.00	1.35
7	000937	冀中能源	3,295,930.00	1.34
8	002051	中工国际	3,150,880.00	1.28
9	000031	中粮地产	3,116,024.31	1.26
10	000997	新大陆	3,069,069.06	1.25
11	600648	外高桥	3,062,125.69	1.24
12	000157	中联重科	2,853,745.00	1.16
13	601101	昊华能源	2,604,800.17	1.06
14	000778	新兴铸管	2,411,656.00	0.98
15	000024	招商地产	1,607,706.48	0.65

16	002465	海格通信	1,478,157.60	0.60
17	600212	江泉实业	1,382,433.30	0.56
18	600392	盛和资源	1,320,734.00	0.54
19	300262	巴安水务	1,288,917.00	0.52
20	002223	鱼跃医疗	1,258,646.00	0.51

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	80,448,927.33
卖出股票的收入（成交）总额	73,351,231.25

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	265,860,218.14	107.91
5	企业短期融资券	49,953,000.00	20.28
6	中期票据	19,504,000.00	7.92
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	335,317,218.14	136.10

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	122921	10 郴州债	354,080.00	36,470,240.00	14.80
2	1180053	11 宝城投 债	300,000.00	31,407,000.00	12.75
3	041460106	14 海沧投 资 CP002	300,000.00	29,793,000.00	12.09
4	1180130	11 通泰债	200,000.00	20,514,000.00	8.33
5	041464010	14 华数 CP001	200,000.00	20,160,000.00	8.18

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投资。

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	41,796.48
2	应收证券清算款	6,266,460.22
3	应收股利	-
4	应收利息	9,753,720.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,061,977.11

8.2.12.4 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。

8.2.12.5 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。

§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 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）

份额单位：份

份额级别	持有人户	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
国联安信心增长 债券 A	523	412,158.88	178,892,949.48	82.99%	36,666,146.79	17.01%
国联安信心增长 债券 B	495	34,122.58	-	-	16,890,675.33	100.00 %
合计	1,018	228,339.66	178,892,949.48	76.96%	53,556,822.12	23.04%

9.1.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）

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
国联安定期开放 债券 A	739	348,308.47	207,845,885.28	80.75%	49,554,074.56	19.25%
国联安定期开放 债券 B	739	103,414.50	50,700,222.23	66.34%	25,723,094.77	33.66%
合计	1,478	225,861.49	258,546,107.51	77.45%	75,277,169.33	22.55%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

10.1 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）

单位：份

项目	国联安定期开放债券 A	国联安定期开放债券 B
基金合同生效日（2012 年 2 月 22 日）基金份额总额	124,802,904.99	120,938,401.30
本报告期期初基金份额总额	1,498,995,613.14	453,212,055.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	197,854,503.14	50,139,345.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,439,450,156.44	426,928,084.27
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	257,399,959.84	76,423,317.00

10.2 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）

单位：份

项目	国联安信心增长债券 A	国联安信心增长债券 B
基金合同生效日（2014 年 7 月 29 日）基金份额总额	257,399,959.84	76,423,317.00
本报告期期初基金份额总额	257,399,959.84	76,423,317.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	122,336,091.48	166,609.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	164,176,955.05	59,699,251.05
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	215,559,096.27	16,890,675.33
-------------	----------------	---------------

注：原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金于基金合同失效前的基金份额为 333,823,276.84 份（A 级份额为 257,399,959.84 份，B 级份额为 76,423,317.00 份），已于基金合同生效日全部转为本基金的基金份额。

§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，国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金自 2014 年 5 月 19 日至 2014 年 6 月 23 日 17:00（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）以通讯方式召开了基金份额持有人大会，持有人大会通过了《关于修改国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。中国证券监督管理委员会基金监管部于 2014 年 7 月 29 日下发了《关于国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（证券基金机构监管部部函[2014]860 号），国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金持有人大会决议报中国证监会备案手续完成，持有人大会决议生效。

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、2014 年 9 月 17 日，基金管理人发布关于《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。经国联安基金管理有限公司第四届董事会第九次会议审议通过，由董事长庾启斌先生代任公司总经理一职，邵杰军先生不再担任公司总经理。上述事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告，并经中国证券监督管理委员会审核批准。

2、2014 年 12 月 8 日，基金管理人发布关于《国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理变更公告》。增聘冯俊先生担任本基金的基金经理，袁新钊先生不再担任本基金的基金经理。

3、2014 年 2 月 27 日，基金托管人发布关于《中信银行股份有限公司关于资产托管部负责人变更的公告》。因中信银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，刘勇先生不再担任本行资产托管部总经理，任命刘泽云先生为本行资产托管部副总经理，主持资产托管部相关工作。刘泽云先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券监督管理委员会备案。

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。本基金本报告期未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 3 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 国联安信心增长债券型证券投资基金（转型后）

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	
东方证券股份有限公司	1	87,259,695.83	56.74%	77,216.18	56.04%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	66,540,462.75	43.26%	60,578.73	43.96%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本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
东方证券股份有限公司	136,512,261.35	37.10%	1,495,038,000.00	27.05%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	231,419,141.52	62.90%	4,031,700,000.00	72.95%	-	-

11.7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金（转型前）

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	
东方证券股份有限公司	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	0.00	0.00%	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服

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

本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
东方证券股份有限公司	82,699,622.43	7.23%	134,000,000.00	0.54%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1,060,839,868.09	92.77%	24,700,900,000.00	99.46%	-	-

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部分基金参加广发证券股份有限公司费率优惠活动公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2014-01-16
2	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金 2013 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-01-22
3	国联安基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-02-25
4	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金第二次集中开放申购与赎回业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-02-26
5	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》、《证券日报》、公司网站	2014-02-27

6	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金 2013 年年报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-03-31
7	国联安基金管理有限公司关于网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动延期的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、公司网站	2014-04-01
8	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	2014-04-02
9	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-04-08
10	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金 2014 年 1 季报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-04-21
11	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券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	2014-04-30
12	国联安基金管理有限公司关于以通讯方式召开国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-05-14
13	国联安基金管理有限公司关于以通讯方式召开国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-05-15
14	国联安基金管理有限公司关于以通讯方式召开国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-05-16
15	国联安基金管理有限公司关于网上直销平台暂停量化定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 《证券日报》、公司网站	2014-05-21
16	关于国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-06-25
17	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	2014-07-02
18	国联安信心增长债券型证券投资基金 2014 年 2 季报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-07-18
19	国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-08-01
20	关于《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》的更正公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、 公司网站	2014-08-02

21	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华龙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	2014-08-08
22	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期货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》、公司网站	2014-08-15
23	国联安信心增长债券型证券投资基金 2014 年半年报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-08-29
24	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	2014-09-17
25	国联安信心增长债券型证券投资基金 2014 年 3 季报	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2014-10-27
26	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	2014-11-21
27	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持新大陆（000997）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	2014-11-26
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持捷成股份（300182）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	2014-11-28
29	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宜华地产（000150）和亚威股份（002559）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	2014-11-29
30	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝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》、《证券日报》、公司网站	2014-12-01
31	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中航资本（600705）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	2014-12-06
32	国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-12-08
33	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中航电测（300114）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	2014-12-11
34	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中国南车（601766）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	2014-12-13
35	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三泰电子（002312）估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、	2014-12-13

		公司网站	
36	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中国北车（601299）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	2014-12-18
37	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持普邦园林（002663）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	2014-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2014 年 5 月 19 日国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型议案》，内容包括国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金变更运作方式、投资策略、基金更名和修订基金合同等。上述基金份额持有人大会决议事项已于 2014 年 7 月 29 日在中国证监会完成备案手续，自该日起，《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效且《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、国联安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照及公司章程
- 3、《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》
- 4、《国联安信心增长债券型证券投资基金托管协议》
- 5、国联安信心增长债券型证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

13.2 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

13.3 查阅方式

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

国联安基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日