

# 国联安中证股债动态策略指数证券投资 基金

## 招募说明书（更新）摘要

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

### 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2013年2月6日证监许可[2013]128号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2014 年 12 月 26 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 12 月 31 日(财务数据未经审计)。

## 一、基金合同生效日期：2013年6月26日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

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

法定代表人：庾启斌

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期限：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：（021）38992888

联系人：茅斐

股权结构：

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

### （二）证券投资基金管理情况

截至本招募说明书（更新）所载内容截止日，公司旗下共管理23只基金：国联安德盛稳健证券投资基金（以下简称“国联安稳健混合”）、国联安德盛小盘精选证券投资基金（以下简称“国联安小盘精选混合”）、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金（以下简称“国联安安心成长混合”）、国联安德盛精选股票证券投资基金（以下简称“国联安精选股票”）、

国联安德盛优势股票证券投资基金（以下简称“国联安优势股票”）、国联安德盛红利股票证券投资基金（以下简称“国联安红利股票”）、国联安德盛增利债券证券投资基金（以下简称“国联安增利债券”）、国联安主题驱动股票型证券投资基金（以下简称“国联安主题驱动股票”）、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金（以下简称“国联安双禧中证100指数分级”）、国联安信心增益债券型证券投资基金（以下简称“国联安信心增益债券”）、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“商品ETF”）、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“国联安上证商品ETF联接”）、国联安货币市场证券投资基金（以下简称“国联安货币”）、国联安优选行业股票型证券投资基金（以下简称“国联安优选行业股票”）、国联安信心增长债券型证券投资基金（以下简称“国联安信心增长债券”）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金（以下简称“国联安双力中小板综指分级”）、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金（以下简称“国联安双佳信用分级债券”）、国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“国联安中债信用债指数增强”）、国联安保本混合型证券投资基金（以下简称“国联安保本混合”）、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金（以下简称“国联安股债动态”）、国联安中证医药100指数证券投资基金（以下简称“国联安医药100指数”）、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金（“国联安新精选混合”）、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金（“国联安通盈混合”）。

### （三）主要人员情况

#### 1、董事会成员

（1）庹启斌先生，董事长，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事、党委委员；国联安基金管理有限公司董事长，并代为履行总经理职责。

（2）Andrew Douglas Eu（余义焜）先生，副董事长，工商管理硕士。

历任怡富证券投资有限公司高级研究分析员、投资经理、董事（地区业务）、JF资产管理有限公司董事、行政总裁。现任德盛安联亚太区行政总裁及公司全球执行委员会成员、德盛安联资产管理有限公司（香港）董事、研富资产管理有限公司（亚太地区）董事。

（3）叶锦华先生（IP Kam Wah），董事，学士学位，澳洲注册会计师。历任瑞士银行香港分行会计经理、财务总监；瑞士银行集团财务董事、亚太区财务变更计划负责人及项目总监；瑞银环球资产管理有限公司亚太区首席财务总监及常务董事；瑞银证券投资信托股份有限公司财务总监及公司监事；瑞银环球资产管理（日本）有限公司法定核数师；国投瑞银基金管理有限公司监事、监事长。现任德盛安联资产管理有限公司首席财务总监，德盛安联资产管理公司（香港、日本、新加坡、台湾）董事、研富资产管理有限公司（亚太地区）董事。

（4）汪卫杰先生，董事，经济学硕士，会计师职称。1994年起进入金融行业，历任君安证券有限责任公司财务部主管、稽核部副总经理、资金计划部副总经理、长沙营业部总经理、财务总部总经理、深圳分公司总经理助理、计划财务总部总经理、国泰君安证券股份有限公司计划财务总部总经理、资产负债管理委员会专职主任委员、子公司管理小组主任。现任国泰君安证券股份有限公司监事会办公室主任、纪检监察室主任。

（5）程静萍女士，独立董事，高级经济师职称。历任上海市财政局副科长、副处长、处长、局长助理，上海市财政局、税务局副局长，上海市计划委员会、上海市发展计划委员会副主任兼上海市物价局局长、上海市发展和改革委员会副主任、第十届全国人大代表、上海市决策咨询委员会专职委员。现任上海银行独立董事、上海市创业投资行业协会会长。

（6）王鸿嫔女士，独立董事，法学士。历任台湾摩根资产管理旗下的怡富证券投资信托有限公司副总经理、怡富证券投资顾问公司总经理，中国摩根资产管理董事总经理、上投摩根基金管理有限公司总经理。现主要从事教育工作和公益活动。

（7）胡斌先生，独立董事，特许金融分析师(CFA)，美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司担任Standish Mellon量化分析师、公司副总裁，

Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理。2007年11月起，于纽银梅隆西部基金管理有限公司（筹建）担任筹建组副组长。2010年7月起，于纽银梅隆西部基金管理有限公司担任首席执行官（总经理）。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）担任总经理。

## 2、监事会成员

（1）元滢伟女士，监事会主席，北京大学光华管理学院工商管理硕士。历任中国工商银行大连分行出纳、会计、信息技术等工作，1992年担任工商银行信托公司证券部副主任；1994年加入君安证券任大连营业部总经理助理，期间兼任君安物业有限责任公司总经理；1999年担任国泰君安证券大连西安路营业部副总经理；2004年起任大连营业部总经理；2005年起任辽宁营销总部副总经理；2007年起任辽宁营销总部总经理；2009年起担任辽宁分公司总经理；2012年起任财富管理部总经理；现任国联安基金管理有限公司监事会主席。

（2）庄小慧女士，监事，法律硕士。历任Bell, Temple见习律师、McCague, Peacock, Borlack, McInnis & Lloyd大律师及事务律师助理、金杜律师事务所事务律师助理、瑞士再保险公司法律顾问。现任德盛安联资产管理（亚太）有限公司法律顾问。

（3）朱慧女士，职工监事，经济学学士，历任国泰证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司财务部副经理，现任国联安基金管理有限公司财务部总监。

（4）刘涓女士，职工监事，经济学学士，现任国联安基金管理有限公司基金事务部副总监。

## 3、公司高级管理人员

（1）庹启斌先生，董事长，代理总经理，经济学博士。历任华东师范大学国际金融系讲师、君安证券有限公司万航渡路营业部经理、资产管理公司研究部经理、香港公司研究策划部经理、研究发展中心主任、经纪管理部总经理、债券部总经理、副总裁，国泰君安证券股份有限公司副总裁。现任国泰君安证券股份有限公司执行董事、党委委员；国联安基金管理有限公司董事长，代理总经理。

（2）周浩先生，督察长，法学硕士。曾先后任职于中国证券监督管理

委员会和上海航运产业基金管理有限公司。2012年2月加盟国联安基金管理有限公司，现担任国联安基金管理有限公司督察长。

(3) 李柯女士，副总经理，经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理，现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(4) 魏东先生，副总经理，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；2003年1月加盟华宝兴业基金管理有限公司，先后担任交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理和华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司，先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009年9月起，担任国联安德盛精选股票证券投资基金的基金经理。2009年12月至2011年8月，兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金的基金经理。2014年3月起，兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现担任国联安基金管理有限公司副总经理。

(5) 满黎先生，副总经理，研究生学历。曾任职于华安基金管理有限公司，先后担任上海分公司高级投资顾问、西安分公司总经理、华东业务总部总经理、北京总部高级董事总经理；2012年9月加盟国联安基金管理有限公司，担任市场总监。自2012年11月起，担任国联安基金管理有限公司副总经理。

#### 4、基金经理

本基金基金经理为黄欣。黄欣先生，硕士，2003年10月加盟国联安基金管理有限公司，先后担任产品开发部经理助理（主持部门工作）、总经理特别助理、债券投资助理及基金经理助理的职务。黄欣先生自2010年4月起至今，担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理；自2010年5月起至2012年9月期间兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理；自2010年11月起至今，兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2010年12月起至今，兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

## 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资组合管理部负责人、固定收益业务负责人、研究部负责人及高级基金经理1-2人(根据需要)组成。投资决策委员会成员为：

庹启斌（代理总经理）投委会主席

魏东(投资总监、副总经理) 投委会执行主席

韦明亮（投资组合管理部总监）

冯俊（固定收益部负责人）

高级基金经理1-2人(根据需要)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 三、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9

月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

2014年上半年，本集团实现利润总额1,695.16亿元，较上年同期增长9.23%；净利润1,309.70亿元，较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元，较上年同期增长14.20%；其中，利息净收入增长12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长8.39%，在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%，同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%，同业领先。

截至2014年6月末，本集团资产总额163,997.90亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户贷款和垫款总额91,906.01亿元，增长6.99%；负债总额152,527.78亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户存款总额129,569.56亿元，增长6.00%。

截至2014年6月末，中国建设银行公司机构客户326.89万户，较上年末增加20.35万户，增长6.64%；个人客户近3亿户，较上年末增加921万户，增长3.17%；网上银行客户1.67亿户，较上年末增长9.23%，手机银行客户数1.31亿户，增长12.56%。

截至2014年6月末，中国建设银行境内营业机构总量14,707个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备72,128台，较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%，较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12

位。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 240 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2014 年

9月末，中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

## 四、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### （1）直销机构

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

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

法定代表人：庑启斌

联系人：茅斐

客户服务电话：400-700-0365（免长途话费）、86-21-3878 4766

网 址：

w w w . v i p - f u n d s . c o  
m

或

w w w . G T J A - A l l i a n z  
. c o m

#### （2）销售机构

1 ) 中 国 建 设 银 行  
股 份 有 限 公 司  
注 册 地 址：北 京 市  
西 城 区 金 融 大 街  
2 5 号

办 公 地 址：北 京 市  
西 城 区 金 融 大 街  
2 5 号  
法 定 代 表 人：王 洪  
章  
联 系 电 话：  
0 1 0 - 6 7 5 9 6 0 8 4  
联 系 人：王 琳  
客 服 电 话：9 5 5 3 3  
网 址：  
w w w . c c b . c o m  
2 ) 上 海 浦 东 发 展  
银 行 股 份 有 限 公 司  
注 册 地 址：上 海 中 山 东 一 路 1 2 号  
办 公 地 址：上 海 市  
中 山 东 一 路 1 2 号  
法 定 代 表 人：吉 晓  
辉  
联 系 电 话：（ 0 2 1 ） 6 1 6 1 6 2 0 6  
联 系 人：虞 谷 云  
客 户 服 务 电 话：  
9 5 5 2 8  
网 址：  
w w w . s p d b . c o m . c n

3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛 锡 明

联系电话：0 2 1 - 5 8 7 8 1 2 3 4

联系人：曹 榕

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

4 ) 招 商 银 行 股 份  
有 限 公 司

注 册 地 址：中 国 广  
东 省 深 圳 市 福 田 区  
深 南 大 道 7 0 8 8 号

办 公 地 址：中 国 广  
东 省 深 圳 市 福 田 区  
深 南 大 道 7 0 8 8 号

法 定 代 表 人：李 建  
红

联系电 话：（ 0755）83077278

联 系 人：邓 炯 鹏

客 户 服 务 电 话：  
9 5 5 5 5

网 址：  
[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

5 ) 国 泰 君 安 证 券  
股 份 有 限 公 司

注 册 地 址：上 海 市  
浦 东 新 区 商 城 路  
6 1 8 号

办 公 地 址：上 海 市  
浦 东 新 区 银 城 中 路  
1 6 8 号 上 海 银 行 大  
厦 2 9 楼

法 定 代 表 人：万 建 华

电话：(021) 38676161

联系人：芮敏琪

客 户 服 务 电 话：  
95521  
网 址：  
www.gtja.com  
6 ) 招 商 证 券 股 份  
有 限 公 司  
注 册 地 址：深 圳 市  
福 田 区 益 田 路 江 苏  
大 厦 A 座 3 8 - 4 5 层  
办 公 地 址：深 圳 市  
福 田 区 益 田 路 江 苏  
大 厦 A 座 3 8 - 4 5 层  
法 定 代 表 人：宫 少  
林

联系电话：0755-82943079

联 系 人：吴 少 彬  
客 户 服 务 电 话：  
9 5 5 6 5 或  
4 0 0 - 8 8 8 8 - 1 1 1  
网 址：  
[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

7 ) 国 信 证 券 股 份  
有 限 公 司  
注 册 地 址：深 圳 市  
红 岭 中 路 1 0 1 2 号  
国 信 证 券 大 厦  
办 公 地 址：深 圳 市  
红 岭 中 路 1 0 1 2 号  
国 信 证 券 大 厦  
法 定 代 表 人：何 如

联系电话：(0755) 82133066

联系人：李颖  
客户服务电话：  
9 5 5 3 6  
网 址：  
w w w . g u o s e n . c o m . c n  
8 ) 中 国 光 大 银 行  
股 份 有 限 公 司  
住 所：北 京 市 西 城  
区 太 平 桥 大 街 2 5  
号、甲 2 5 号 中 国 光  
大 中 心  
办 公 地 址：北 京 市  
西 城 区 太 平 桥 大 街  
2 5 号、甲 2 5 号 中  
国 光 大 中 心  
法 定 代 表 人：唐 双  
宁  
联 系 电 话：  
0 1 0 - 6 3 6 3 6 2 3 5  
联 系 人：张 谓  
客 户 服 务 电 话：  
9 5 5 9 5

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

9) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045555

网址：www.txsec.com

（10）天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系电话：027-87618882

联系人：翟璟

客户服务电话：400-8005-000

网址：www.tfzq.com

（11）中国国际期货有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵

联系人：赵森

电话：010-59539864

客服电话：95162、400-8888-160

网址：www.cifco.net

12）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层

法定代表人：陈柏青

联系电话：0571-28829790

联系人：周旻旻

客户服务电话：400-0766-123

网址：www.fund123.cn

13）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

法定代表人：其实

联系电话：021-54509998

联系人：练兰兰

客户服务电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

14) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903—906 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903—906 室

法定代表人：杨文斌

联系电话：021-58870011

联系人：王玉山

客户服务电话：400-7009-665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

15) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系电话：010-62020088

联系人：宋丽冉

客户服务电话：400-8886-661

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

16) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客户服务电话：400-6788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

17) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18 楼

法定代表人：王莉

电话：021-68419822

联系人：周轶

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

## （二）注册登记机构

名称：国联安基金管理有限公司

住所及办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

法定代表人：庾启斌

联系人：茅斐

电话：021-38992888

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系人：安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红、安冬

## （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所

住所及办公地址：上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼

负责人：蔡廷基  
联系人：王国蓓  
联系电话：021-22122428  
传真：021-62881889  
经办注册会计师：王国蓓、戴丽

## 五、基金的名称

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金

## 六、基金的类型

混合型

## 七、基金份额的申购与赎回

### （一）申购费用与赎回费用

#### 1. 申购费

投资者可以多次申购本基金，本基金基金份额的申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金基金份额的申购费率如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
100 万元以下	1.5%
100 万元（含）-500 万元	0.7%
500 万元（含）以上	每笔 1000 元

注：M 为申购金额

投资者通过国联安基金网上直销平台申购本基金可享受前端申购费率优惠，具体优惠申购费率以最新的相关公告为准。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

#### 2. 赎回费

本基金基金份额具体赎回费率如下表所示：

持有时间	赎回费率
持有 1 年以下	0.5%
持有 1 年（含）-2 年	0.3%
持有 2 年（含）以上	0%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## （二）申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金资产所有。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用 = 申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

例：某投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50000/（1+1.5%）=49261.08元

申购费用=50000-49261.08=738.92元

申购份额=49261.08/1.05=46915.31份

即：投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净

值为1.05元，则其可得到46915.31份基金份额。

## 2、赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.148=11480 元

赎回费用=11480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11480-57.40=11422.60 元

即：投资者赎回本基金 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11422.60 元。

## 3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## （三）基金转换

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

（一）基金转换费及转换份额的计算：

1、进行基金转换的总费用包括转换手续费、转出基金的赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费三部分。

（1）转换手续费率为零。如基金转换手续费率调整将另行公告。

（2）转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

其中：转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

前端份额之间转换的申购补差费率按转出金额对应转入基金的申购费率和转出基金的申购费率作为依据来计算。后端份额之间转换的申购补差费率为零，因此申购补差费为零。

投资者通过网上直销平台办理前端收费模式下本基金与本公司旗下其他开通基金转换业务的开放式基金间的基金转换业务，享受转换费中相应前端申购补差费率的优惠，其他费率标准不变。在确定基金转换补差费率时，对于转出基金、转入基金的标准申购费率高于 0.6% 的，申购费率按各基金对应的 4 折优惠申购费率执行，但优惠申购费率不得低于 0.6%；转出基金、转入基金的标准申购费率等于或低于 0.6% 的，则依据标准申购费率计算。

基金管理人有权根据业务情况调整上述交易费用，并依据相关法规要求进行公告。

（二）、转换份额的计算公式：

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转换费用=转换手续费+转出基金的赎回费+申购补差费

其中：

转换手续费=0

赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费=(转出金额-赎回费)×申购补差费率/(1+申购补差费率)

（1）如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转换费用=转出基金的赎回费+申购补差费

（2）如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率

转换费用=转出基金的赎回费

(3) 转入金额 = 转出金额 - 转换费用

(4) 转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额作为确定依据。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

### （三）、基金转换业务举例：

例：某投资者投资 101,500 元申购国联安股债动态基金，申购费率为 1.5%，申购申请当日国联安股债动态基金的基金份额净值是 1.0000 元，则可申购国联安股债动态基金 100,000 份。持有超过一年后，但持有未满两年，该投资者将这 100,000 份国联安股债动态基金基金份额转换为国联安货币市场基金，转换申请当日国联安货币市场的基金份额净值为 1.0000 元，国联安股债动态基金基金份额净值为 1.120 元。则：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值 = 100,000 × 1.120 = 112,000 元；

赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率 = 112,000 × 0.3% = 336 元；

申购补差费率 = max [ (转入基金申购费 - 转出基金申购费), 0 ] (即转入基金申购费减去转出基金申购费，如为负数则取零)，即申购补差费率 = max [ (0 - 1.5%), 0 ] = 0；

申购补差费 = (转出金额 - 赎回费) × 申购补差费率 / (1 + 申购补差费率) = (112,000 - 336) × 0 / (1 + 0) = 0 元；

转入金额 = 转出金额 - 赎回费 - 申购补差费 = 112,000 - 336 - 0 = 111,664 元；

转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值  
= 111,664 / 1.0000 = 111,664 份。

### （四）业务规则：

1、基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

2、基金转换采取未知价法，即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

3、正常情况下，基金注册与过户登记人将在 T+1 日对投资者 T 日的基

金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2 日后（包括该日）投资者可通过本公司直销业务平台查询基金转换的成交情况。

4、目前基金转换的最低申请份额原则上为 100 份基金单位。基金份额持有最低为 100 份基金单位。如投资者办理基金转换出后该基金份额不足 100 份时，需一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

5、单个开放日基金净赎回份额及净转出申请份额之和超过上一开放日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

6、目前，原有基金为前端收费的基金份额只能转换为其他前端收费的基金份额，后端收费的基金份额只能转换为其他后端收费的基金份额。

本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关限制，但最迟应在调整生效前按照《信息披露管理办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （四）定期定额投资计划

敬请参见招募说明书“对基金份额持有人的服务”之第（四）项“定期定额投资计划”。

## 八、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争使基金净值增长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 0.5%，年化跟踪误差不超过 6%，努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

## 九、基金的投资方向

本基金资产投资于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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、股指期货、权证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）。其中，投资于沪深 300 指数成份股及其备选成份股、沪深 300 股指期货净多头合约价值之和占基金资产的比例不低于标的指数中股票类资产配置比例的 90%，投资于中证短融 50 指数的成份券及备选成份券的市值占基金资产的比例不低于标的指数中债券类资产配置比例的 90%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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，本基金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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 十、基金的投资策略

本基金进行被动式指数化投资。其中，除应对赎回所必需的现金类资产之外，其余基金资产严格按照标的指数中股票类资产与债券类资产的比例进行配置。

### 1、股票组合的构建方法

对于指数的股票资产部分采取完全复制的方法，主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，同时结合持有沪深 300 股指期货多头或空头，以复制和跟踪标的指数的股票资产部分。

### 2、债券组合的构建方法

对于指数的债券资产部分采取抽样复制的方法，进行债券选择时，在基于“平均久期盯住”标准的基础上，主要通过抽样优选标的指数成份券和通过灵活选取关键特征类似的非成份券进行投资组合的构建：首先在综

合考虑债券流动性、收益性、剩余久期等因素的情况下选择对标的指数走势影响较大且流动性较好的成份债券；当对标的指数走势影响较大的成份债券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例等市场因素发生时，本基金将根据市场情况，结合经验判断，选取关键特征和相关成份券类似的非成份券或者非成份券组合进行替代。

由于本基金投资策略中，债券部分并非完全被动复制标的指数，因此本基金投资组合中债券个券权重和券种与标的指数债券成份券和券种间将可能存在一定差异。

### 3、股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 十一、标的指数及业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金的标的指数为中证股债动态合成期权策略指数。

中证股债动态合成期权策略指数是多资产策略指数，由股票和债券两类资产构成，这两类资产分别由沪深 300 指数与中证短融 50 指数代表。中证股债动态合成期权策略指数旨在模拟合成期权的风险收益状况。这类策略以期权定价模型为基础，通过动态调整股票和固定收益两类资产的配置

比例，合成相应资产组合的期权暴露头寸，从而在尽可能锁定股市上涨收益的同时，达到对冲组合风险的效果。

若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体上刊登公告；若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并及时公告。

## 2、业绩比较基准

$95\% \times \text{中证股债动态合成期权策略指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$

本基金标的指数变更的，业绩比较基准相应变更。此外，如果今后法律法规或基金合同发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者基金管理人认为上述比较基准已不适用于本基金时，本基金管理人可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开持有人大会。

## 十二、基金的风险收益特征

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。

## 十三、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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责任。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规

定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。本投资组合报告所载数据截至 2014 年 12 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

## 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	14,896,834.75	28.44
	其中：股票	14,896,834.75	28.44
2	固定收益投资	1,315,957.90	2.51
	其中：债券	1,315,957.90	2.51
	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	1,051,142.83	2.01
7	其他资产	35,108,096.67	67.04
8	合计	52,372,032.15	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	44,175.70	0.09
B	采矿业	703,765.26	1.36
C	制造业	4,632,202.15	8.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	563,651.14	1.09
E	建筑业	681,903.53	1.31
F	批发和零售业	341,673.01	0.66

G	交通运输、仓储和邮政业	398,611.20	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	489,152.45	0.94
J	金融业	5,937,258.44	11.44
K	房地产业	707,232.81	1.36
L	租赁和商务服务业	124,366.22	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	119,518.05	0.23
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	106,133.16	0.20
S	综合	47,191.63	0.09
	合计	14,896,834.75	28.70

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

## 2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

### 3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	8,415	628,684.65	1.21
2	600016	民生银行	47,652	518,453.76	1.00
3	600036	招商银行	29,012	481,309.08	0.93

4	600030	中信证 券	13,837	469,074.30	0.90
5	600837	海通证 券	14,226	342,277.56	0.66
6	601166	兴业银 行	20,096	331,584.00	0.64
7	600000	浦发银 行	19,675	308,700.75	0.59
8	000002	万 科 A	17,259	239,900.10	0.46
9	601668	中国建 筑	26,370	191,973.60	0.37
10	601328	交通银 行	27,601	187,686.80	0.36

### 3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	758,147.40	1.46
	其中：政策性金融债	758,147.40	1.46
4	企业债券	554,469.30	1.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,341.20	0.01
8	其他	-	-
9	合计	1,315,957.90	2.54

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5 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债券投资明

细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	018001	国开1301	7,380	758,147.40	1.46
2	126019	09长虹债	5,670	554,469.30	1.07
3	128009	歌尔转债	27	3,341.20	0.01

**6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7 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 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**9.1 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。

**9.2 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。

**10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**10.1 本基金投资国债期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

**10.2 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。

**10.3 本基金投资国债期货的投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

## 11 投资组合报告附注

### 11.1

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

中国平安（601318）的控股子公司中国平安财产保险股份有限公司（以下简称“平安产险”）于2014年8月22日收到中国保监会的《行政处罚决定书》，对于平安产险倒签单导致保费收入、准备金等数据不真实违反《保险法》的行为处以罚款，对于平安产险未执行关于危险单位划分的内控制度与流程、未加强内部管理违反《保险公司管理规定》的行为处以警告并罚款。

中国平安（601318）的控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于2014年12月8日收到中国证监会关于保荐书存在虚假记载的行为、未审慎核查海联讯公开发行人募集文件的真实性和准确性的行为违反《证券法》的《行政处罚决定书》，对平安证券给予警告，没收保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2,867万元，并处以440万元罚款。本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

11.2 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。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,163.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,029.88
5	应收申购款	35,049,902.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,108,096.67

### 11.4 报告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。

#### 11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

##### 11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

	基金份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率③	①-③	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差④	②-④
2013-6-26 至 2013-12-31	0.90%	3.06%	-2.16%	0.21%	0.23%	-0.02%
2014-1-1 至 2014-12-31	25.57%	35.26%	-9.69%	0.68%	0.75%	-0.07%
2013-6-26 至 2014-12-31	26.70%	39.40%	-12.70%	0.57%	0.62%	-0.05%

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.标的指数许可使用基点费；
- 4.基金财产拨划支付的银行费用；
- 5.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6.基金份额持有人大会费用；
- 7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8.基金的证券交易费用；
- 9.基金的开户费用、账户维护费用
- 10.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

11.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

**(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。**

### **(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式**

1、与基金运作有关的费用：

1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

3) 基金合同生效后的指数许可使用基点费

指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指

数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付，收取标准和方法为：

$$H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H=每日应付的指数许可使用基点费；E=前一日基金的资产净值

指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

4) 除管理费、托管费和指数许可使用基点费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## 2、与基金销售有关的费用

### (1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的内容。

### (2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式等内容详见招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的内容。

## (四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

**(五)基金管理人**和**基金托管人**可根据**基金发展情况调整基金管理费率**和**基金托管费率**。**基金管理人**必须最迟于新的费率实施日**2**日前在指定媒体上刊登公告。

## (六) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体根据国家法律法规的规定，履行各自纳税义务。

## 十六、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2014 年 8 月 9 日刊登的本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新了“三、基金管理人”部分的内容。
- 2、更新了“四、基金托管人”部分的内容。
- 3、更新了“五、相关服务机构”部分的内容。
- 4、更新了“八、基金份额的申购与赎回”部分的内容。
- 5、更新了“九、基金的投资”部分的内容。
- 6、更新了“十、基金的业绩”部分的内容。
- 7、更新了“二十二、其他应披露事项”部分的内容。

国联安基金管理有限公司

二〇一五年二月七日