
国联安中证医药 100 指数证券投资基金
2014 年年度报告摘要
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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年三月三十日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人交通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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国联安医药 100 指数
基金主代码	000059
交易代码	000059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 21 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	511,414,105.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中证医药 100 指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建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，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对中证医药 100 指数的有效跟踪。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	汤嵩彦
	联系电话	021-38992806	95559
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 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	2013 年 8 月 21 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年
本期已实现收益	11,441,071.21	2,371,903.22	-
本期利润	-8,794,166.97	10,590,631.11	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0565	0.0363	-
本期基金份额净值增长率	13.30%	3.00%	0%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1594	0.0110	-
期末基金资产净值	596,938,836.91	212,873,981.00	-
期末基金份额净值	1.167	1.030	-

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

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

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、本基金于 2013 年 8 月 21 日成立，截止至本报告期末本基金成立不满两年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.47%	1.23%	-2.95%	1.31%	-0.52%	-0.08%
过去六个月	10.41%	1.06%	12.08%	1.09%	-1.67%	-0.03%
过去一年	13.30%	1.11%	15.83%	1.11%	-2.53%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.70%	1.09%	25.37%	1.13%	-8.67%	-0.04%

注：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 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

国联安中证医药 100 指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 8 月 21 日至 2014 年 12 月 31 日)



- 1、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率 (税后)}$ ；
- 2、本基金基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效；

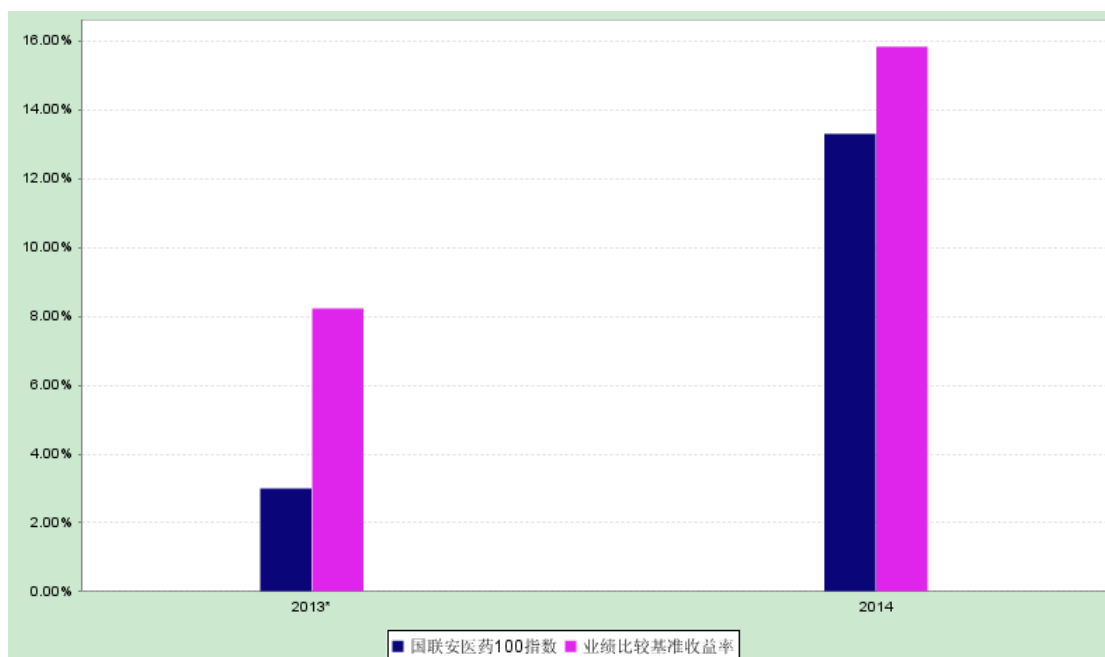
3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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。

3.2.3 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

国联安中证医药 100 指数证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



1、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

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

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

金额单位：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	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效，截止报告期末，本基金成立未满两年。

§ 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		
黄志钢	本基金基金经理、兼任国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理、国联安上证大宗	2013-08-21	-	7 年（自 2007 年起）	黄志钢先生，硕士，曾任海通期货担任研究员；国元证券股份有限公司衍生产品部高级经理。2008 年 10 月起加入国联安基金管理有限公司，曾担任金融工程分析师。2010 年 11 月起担任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理，2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2012 年 3 月起兼任国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金经理，2012 年 6 月至 2013 年 7 月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理，2013 年 8 月起兼任本基金基金经理。

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助理				
------------------------------	--	--	--	--

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》、《国联安中证医药 100 指数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

在报告期内,本基金采用完全复制中证医药 100 指数的方法,对于基金的日常申购赎回、成份股长期停牌等事件处理,基金管理人综合考虑交易成本、个股权重偏离等因素进行组合调整,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为 1.167 元,本报告期份额净值增长率为 13.30%,同期业绩比较基准收益率为 15.83%。本报告期内,日均跟踪偏离度为 0.07%,年化跟踪误差为 1.68%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%,以及年化跟踪误差不超过 4.0%的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年,预计全球经济将分化加剧,美国经济一枝独秀,欧洲经济仍旧低迷,中国经济将保持新常态。一方面,中国经济目前处在“增长速度换档期,结构调整阵痛期,前期刺激政策消化期”的叠加阶段,宏观经济预计不会出现太多的亮色,为应对经济增速的下滑,2015 年将维持积极的财政政策和适度宽松的货币政策,预计会陆续出台稳增长的措施,但是其措施力度会适度,不会出现强的刺激经济政策;另一方面,2015 年作为全面深化改革的关键之年,预计将有大规模,多方面的改革措施落地和突破。财税体制改革、土地制度改革、国企改革和金融领域的改革值得期待。总之,2015 年经济面保持相对平稳,公司的盈利增长保持稳定,但是改革预期将继续提升市场的风险偏好和估值水平,预计 2015 年 A 股市场将呈现震荡上扬走势。

在人口老龄化趋势和产业结构升级的驱动下,医药行业将维持刚性需求增长。由于 2014 年全年医药行业指数相对滞涨,预计 2015 年医药指数有望估值修复。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成,并根据业务分工履行相应的职责,所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过,数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致,估值决策

由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

§ 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

2014 年度，基金托管人在国联安中证医药 100 指数证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，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持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014 年度，国联安基金管理有限公司在国联安中证医药 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014 年度，由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安中证医药 100 指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

毕马威华振会计师事务所对国联安基金管理有限公司国联安中证医药 100 指数证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的资产负债表, 2014 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第 1500283 号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 国联安中证医药 100 指数证券投资基金

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	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	38,029,964.76	12,856,835.00
结算备付金		1,501,578.84	-
存出保证金		146,714.72	62,951.80
交易性金融资产	7.4.7.2	551,429,383.23	202,199,140.38
其中: 股票投资		551,429,383.23	202,199,140.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	11,878.32	6,127.77
应收股利		-	-
应收申购款		18,307,862.76	210,563.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		609,427,382.63	215,335,617.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,091,708.52	-
应付赎回款		4,170,779.20	1,928,617.76
应付管理人报酬		396,494.98	147,363.54
应付托管费		99,123.74	36,840.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	507,419.34	81,546.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	223,019.94	267,268.57
负债合计		12,488,545.72	2,461,636.98
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	511,414,105.80	206,725,418.15
未分配利润	7.4.7.10	85,524,731.11	6,148,562.85
所有者权益合计		596,938,836.91	212,873,981.00
负债和所有者权益总计		609,427,382.63	215,335,617.98

注：1、报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.167 元，基金份额总额 511,414,105.80 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 8 月 21 日 (基金合同生效 日)至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		-5,702,115.65	12,276,336.88
1.利息收入		173,644.44	804,609.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	173,644.44	468,015.40
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	336,594.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,924,722.75	2,978,086.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,475,897.47	2,962,620.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	448,825.28	15,465.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-20,235,238.18	8,218,727.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	434,755.34	274,913.21
减：二、费用		3,092,051.32	1,685,705.77
1. 管理人报酬		1,407,513.43	856,422.77
2. 托管费		351,878.31	214,105.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	977,510.58	345,125.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	355,149.00	270,052.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,794,166.97	10,590,631.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,794,166.97	10,590,631.11

注：本基金于 2013 年 8 月 21 日成立，上年度可比期间为 2013 年 8 月 21 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日（下同）。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	206,725,418.15	6,148,562.85	212,873,981.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,794,166.97	-8,794,166.97
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）	304,688,687.65	88,170,335.23	392,859,022.88
其中：1. 基金申购款	616,267,434.58	130,676,051.96	746,943,486.54
2. 基金赎回款	-311,578,746.93	-42,505,716.73	-354,084,463.66
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）	511,414,105.80	85,524,731.11	596,938,836.91
项目	上年度可比期间		
	2013年8月21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）	414,529,636.08	-	414,529,636.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,590,631.11	10,590,631.11
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）	-207,804,217.93	-4,442,068.26	-212,246,286.19
其中：1. 基金申购款	7,556,827.77	124,691.29	7,681,519.06
2. 基金赎回款	-215,361,045.70	-4,566,759.55	-219,927,805.25
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）	206,725,418.15	6,148,562.85	212,873,981.00

注：1、本基金于 2013 年 8 月 21 日成立，上年度可比期间为 2013 年 8 月 21 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日（下同）。本表中上年度“期初所有者权益（基金净值）”为基金合同生效日即 2013 年 8 月 21 日的数据。

2、报告附注为财务报表的组成部分。

本报告从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国联安中证医药 100 指数证券投资基金(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”)《关于核准国联安中证医药 100 指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1237 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《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2013 年 8 月 21 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 414,529,636.08 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金于 2013 年 7 月 22 日至 2013 年 8 月 16 日募集，募集期间净认购资金人民币 414,463,396.69 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 66,239.39 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 414,529,636.08 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了毕马威华振验字第 1300160 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》和《国联安中证医药 100 指数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，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股、到期日在一年以内的政府债券、债券回购、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合比例为：股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产市值不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产市值不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

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

7.4.2 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。

7.4.3 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、2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

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。

7.4.6 税项

7.4.7 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
交通银行股份有限公司（交通银行）	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

7.4.8 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 2013 年 8 月 21 日生效，上年度可比期间为 2013 年 8 月 21 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日（下同）。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：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12月31日	2013年8月21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	767,172,117.92	100.00%	291,887,856.57	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内与上年度可比期间内，本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本报告期内与上年度可比期间内，本基金无关联方债券交易。

7.4.8.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2013年8月21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	-	-	2,730,000,000.00	100.00%

本报告期内与上年度可比期间内，本基金无关联方债券回购交易。

7.4.8.1.5 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	685,688.15	100.00%	507,419.34	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2013年8月21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	261,351.37	100.00%	81,546.21	100.00%

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《证券交易单元租用协议》，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、权证及回购交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31 日	上年度可比期间 2013年8月21日至2013年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,407,513.43	856,422.77
其中：支付销售机构的客户维护费	721,966.61	282,628.70

注：本基金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 0.80% 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×0.80%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31 日	上年度可比期间 2013年8月21日至2013年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	351,878.31	214,105.68

注：本基金支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内，基金管理人未投资本基金。

7.4.8.4.2 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

报告期末（2014 年 12 月 31 日）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 8 月 21 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
交通银行	38,029,964.76	139,141.32	12,856,835.00	150,002.51

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计算。本基金通过“交通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 1,501,578.84 元。(2013 年：人民币 0.00 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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（2014 年 12 月 31 日）未持有因认购新发和增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002437	誉衡药业	2014-11-21	重大事项停牌	23.75	2015-01-26	26.13	188,180	4,329,249.76	4,469,275.00	-
300244	迪安诊断	2014-10-13	重大事项停牌	43.93	2015-01-09	44.00	19,972	703,651.51	877,369.96	-
300347	泰格医药	2014-12-11	重大事项停牌	30.22	2015-01-22	33.24	146,325	5,171,387.18	4,421,941.50	-
600332	白云山	2014-12-04	重大事项停牌	27.11	2015-01-13	29.82	165,848	4,608,162.00	4,496,139.28	-
600664	哈药股份	2014-12-31	重大事项停牌	8.68	2015-02-17	9.45	708,069	5,463,299.80	6,146,038.92	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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 0 元，因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 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 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	551,429,383.23	90.48
	其中：股票	551,429,383.23	90.48
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	39,531,543.60	6.49
6	其他各项资产	18,466,455.80	3.03
7	合计	609,427,382.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	480,353,808.03	80.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	46,658,296.38	7.82
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	7,590,318.19	1.27
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	16,826,960.63	2.82
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	551,429,383.23	92.38

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 期末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

8.3.1 期末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

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	000623	吉林敖东	292,050	10,166,260.50	1.70
2	002424	贵州百灵	185,504	7,614,939.20	1.28
3	600645	中源协和	187,369	7,590,318.19	1.27
4	000650	仁和药业	949,016	7,326,403.52	1.23
5	600056	中国医药	431,074	7,073,924.34	1.19
6	600511	国药股份	223,865	6,937,576.35	1.16
7	600614	鼎立股份	508,703	6,765,749.90	1.13
8	600252	中恒集团	412,155	6,742,855.80	1.13
9	600521	华海药业	444,820	6,467,682.80	1.08
10	600380	健康元	874,613	6,288,467.47	1.05

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002424	贵州百灵	6,976,463.95	3.28
2	002589	瑞康医药	6,856,074.62	3.22
3	300363	博腾股份	6,393,843.92	3.00
4	000650	仁和药业	6,228,799.72	2.93
5	000788	北大医药	6,141,590.20	2.89
6	002727	一心堂	6,094,394.00	2.86
7	002030	达安基因	6,022,990.46	2.83
8	600566	洪城股份	6,021,358.84	2.83
9	000566	海南海药	6,010,013.32	2.82
10	300006	莱美药业	5,929,079.50	2.79
11	002626	金达威	5,895,932.00	2.77
12	600645	中源协和	5,872,694.16	2.76
13	600812	华北制药	5,823,484.12	2.74
14	300110	华仁药业	5,817,016.00	2.73
15	603168	莎普爱思	5,792,698.72	2.72
16	002433	太安堂	5,781,340.70	2.72
17	600161	天坛生物	5,778,278.40	2.71
18	002566	益盛药业	5,710,453.87	2.68
19	000963	华东医药	5,697,917.51	2.68
20	300238	冠昊生物	5,687,328.22	2.67
21	002399	海普瑞	5,679,528.92	2.67
22	002390	信邦制药	5,647,934.94	2.65
23	300147	香雪制药	5,643,951.44	2.65
24	600521	华海药业	5,636,184.49	2.65
25	000623	吉林敖东	5,622,093.22	2.64
26	000661	长春高新	5,619,732.00	2.64
27	002653	海思科	5,598,778.53	2.63
28	600511	国药股份	5,577,269.70	2.62
29	600079	人福医药	5,575,272.11	2.62
30	002550	千红制药	5,557,026.40	2.61
31	600420	现代制药	5,553,850.58	2.61
32	002412	汉森制药	5,549,773.25	2.61

33	002317	众生药业	5,542,551.54	2.60
34	300298	三诺生物	5,536,680.76	2.60
35	300026	红日药业	5,530,963.68	2.60
36	600056	中国医药	5,515,734.00	2.59
37	300015	爱尔眼科	5,512,726.60	2.59
38	600594	益佰制药	5,477,737.25	2.57
39	002275	桂林三金	5,471,291.46	2.57
40	002038	双鹭药业	5,443,816.68	2.56
41	600380	健康元	5,432,215.00	2.55
42	002022	科华生物	5,430,924.47	2.55
43	600587	新华医疗	5,393,825.65	2.53
44	002223	鱼跃医疗	5,390,735.52	2.53
45	300273	和佳股份	5,373,407.90	2.52
46	600557	康缘药业	5,366,540.14	2.52
47	000915	山大华特	5,355,108.14	2.52
48	600351	亚宝药业	5,351,738.59	2.51
49	002219	恒康医疗	5,349,191.06	2.51
50	000739	普洛药业	5,335,996.46	2.51
51	002118	紫鑫药业	5,317,947.17	2.50
52	300204	舒泰神	5,313,480.83	2.50
53	600993	马应龙	5,312,756.17	2.50
54	600252	中恒集团	5,311,224.31	2.50
55	300003	乐普医疗	5,307,953.00	2.49
56	600771	广誉远	5,287,974.00	2.48
57	600867	通化东宝	5,257,394.00	2.47
58	600614	鼎立股份	5,236,787.99	2.46
59	002019	亿帆鑫富	5,219,045.35	2.45
60	000078	海王生物	5,217,074.23	2.45
61	300267	尔康制药	5,214,359.39	2.45
62	600329	中新药业	5,205,554.00	2.45
63	000919	金陵药业	5,189,131.91	2.44
64	600062	华润双鹤	5,182,134.93	2.43
65	000999	华润三九	5,178,323.13	2.43
66	600750	江中药业	5,132,205.70	2.41
67	000028	国药一致	5,122,840.00	2.41
68	000423	东阿阿胶	5,118,670.99	2.40
69	002603	以岭药业	5,108,708.00	2.40
70	300119	瑞普生物	5,080,335.26	2.39
71	002007	华兰生物	5,071,128.43	2.38
72	000513	丽珠集团	5,040,225.31	2.37
73	002551	尚荣医疗	5,027,518.29	2.36

74	600518	康美药业	5,019,472.94	2.36
75	600664	哈药股份	4,965,332.13	2.33
76	300142	沃森生物	4,964,521.14	2.33
77	002332	仙琚制药	4,906,071.21	2.30
78	002422	科伦药业	4,889,535.16	2.30
79	600201	金宇集团	4,867,650.57	2.29
80	000538	云南白药	4,856,648.36	2.28
81	300255	常山药业	4,854,040.08	2.28
82	600998	九州通	4,843,624.88	2.28
83	601607	上海医药	4,819,819.37	2.26
84	600572	康恩贝	4,779,784.61	2.25
85	600216	浙江医药	4,778,673.44	2.24
86	002262	恩华药业	4,766,920.59	2.24
87	300289	利德曼	4,766,568.80	2.24
88	002294	信立泰	4,755,511.24	2.23
89	600436	片仔癀	4,754,891.86	2.23
90	600763	通策医疗	4,754,105.74	2.23
91	600195	中牧股份	4,749,048.74	2.23
92	002393	力生制药	4,733,954.88	2.22
93	300347	泰格医药	4,708,767.32	2.21
94	300039	上海凯宝	4,698,258.00	2.21
95	300186	大华农	4,688,424.00	2.20
96	002001	新 和 成	4,651,421.81	2.19
97	002252	上海莱士	4,651,342.71	2.19
98	600267	海正药业	4,610,699.80	2.17
99	600085	同仁堂	4,532,060.50	2.13
100	600276	恒瑞医药	4,427,109.99	2.08
101	600535	天士力	4,295,014.45	2.02

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300204	舒泰神	7,435,123.24	3.49
2	002275	桂林三金	7,176,937.55	3.37
3	300119	瑞普生物	6,691,893.76	3.14
4	002262	恩华药业	6,649,432.90	3.12
5	002589	瑞康医药	6,592,920.30	3.10
6	300186	大华农	6,567,605.61	3.09
7	300289	利德曼	6,540,272.47	3.07
8	300122	智飞生物	5,733,580.09	2.69

9	002219	恒康医疗	2,518,865.86	1.18
10	300267	尔康制药	2,511,510.45	1.18
11	600645	中源协和	2,349,069.53	1.10
12	300110	华仁药业	2,259,148.59	1.06
13	002022	科华生物	2,183,747.04	1.03
14	600587	新华医疗	2,179,145.46	1.02
15	300147	香雪制药	2,165,567.20	1.02
16	600511	国药股份	2,108,160.97	0.99
17	002437	誉衡药业	2,085,558.42	0.98
18	300142	沃森生物	2,082,108.97	0.98
19	002030	达安基因	2,033,898.68	0.96
20	300015	爱尔眼科	2,023,267.84	0.95

8.4.3 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	561,580,850.74
卖出股票的收入（成交）总额	205,591,267.18

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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，没有相关的投资政策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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，没有相关投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	146,714.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,878.32

5	应收申购款	18,307,862.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,466,455.80

8.12.4 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债。

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有积极投资股票。

§ 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

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
10,780	47,441.01	18,933,421.83	3.70%	492,480,683.97	96.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	-	-

注：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

单位：份

基金合同生效日(2013年8月21日)基金份额总额	414,529,636.08
本报告期期初基金份额总额	206,725,418.15
本报告期期间基金总申购份额	616,267,434.58
减：本报告期期间基金总赎回份额	311,578,746.93
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	511,414,105.80

注：1、总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

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。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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。本基金报告年度支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 6 万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续 1 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 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	767,172,117.92	100.00%	685,688.15	100.00%	-

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

上述交易单元均为在本报告期内新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国联安基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日