

**国联安双力中小板综指分级证券投资基金**  
**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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

## 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.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警的说明.....	15
§5	托管人报告.....	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	16
§6	审计报告.....	16
6.1	管理层对财务报表的责任.....	16
6.2	注册会计师的责任.....	16
6.3	审计意见.....	17
§7	年度财务报表.....	17
7.1	资产负债表.....	17
7.2	利润表.....	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4	报表附注.....	21
§8	投资组合报告.....	46
8.1	期末基金资产组合情况.....	46
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3	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.....	47
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
8.6	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.....	58
8.7	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.....	58

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 .....	58
8.9	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 .....	58
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12	投资组合报告附注 .....	59
9	基金份额持有人信息 .....	60
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	60
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
10	开放式基金份额变动 .....	61
11	重大事件揭示 .....	62
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4	基金投资策略的改变 .....	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8	其他重大事件 .....	65
12	备查文件目录 .....	69
12.1	备查文件目录 .....	69
12.2	存放地点 .....	70
12.3	查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安双力中小板综指分级证券投资基金		
基金简称	国联安双力中小板综指分级		
场内简称	国安双力		
基金主代码	162510		
交易代码	162510		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 3 月 23 日		
基金管理人	国联安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	21,093,447.46 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 4 月 16 日		
下属分级基金的基金简称	国联安双力 A 中小板综指	国联安双力 B 中小板综指	国联安双力中小板综指
下属分级基金场内简称	双力 A	双力 B	国安双力
下属分级基金的交易代码	150069	150070	162510
报告期末下属分级基金的份额总额	8,144,124.00 份	8,144,125.00 份	4,805,198.46 份

### 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小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。

业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。		
下属三级基金的风险收益特征	双力 A：低风险低收益。	双力 B：高风险高收益。	国安双力：本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报及深交所网站
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtja-allianz.com">http://www.gtja-allianz.com</a> 或 <a href="http://www.vip-funds.com">www.vip-funds.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所	上海市南京西路1266号恒隆广场49-51楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任	北京西城区金融大街27号

	公司	投资广场23 层
--	----	----------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 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	2012 年 3 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,929,203.80	8,231,684.54	-3,295,180.62
本期利润	7,154,630.52	23,938,272.95	-14,896,002.83
加权平均基金份额本期利润	0.2461	0.2474	-0.0597
本期加权平均净值利润率	21.91%	25.53%	-6.27%
本期基金份额净值增长率	24.74%	20.30%	-9.50%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	5,203,958.50	3,153,441.50	-21,192,683.82
期末可供分配基金份额利润	0.2467	0.0851	-0.0955
期末基金资产净值	26,804,479.07	38,885,391.18	200,778,806.52
期末基金份额净值	1.271	1.050	0.905
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	35.81%	8.87%	-9.50%

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，包括停牌股票按公允价值调整的影响；

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

### 3.2 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	-1.32%	1.38%	-2.45%	1.38%	1.13%	0.00%
过去六个月	21.28%	1.17%	19.16%	1.16%	2.12%	0.01%
过去一年	24.74%	1.21%	24.58%	1.20%	0.16%	0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	35.81%	1.28%	37.93%	1.31%	-2.12%	-0.03%

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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安双力中小板综指分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年3月23日至2014年12月31日)





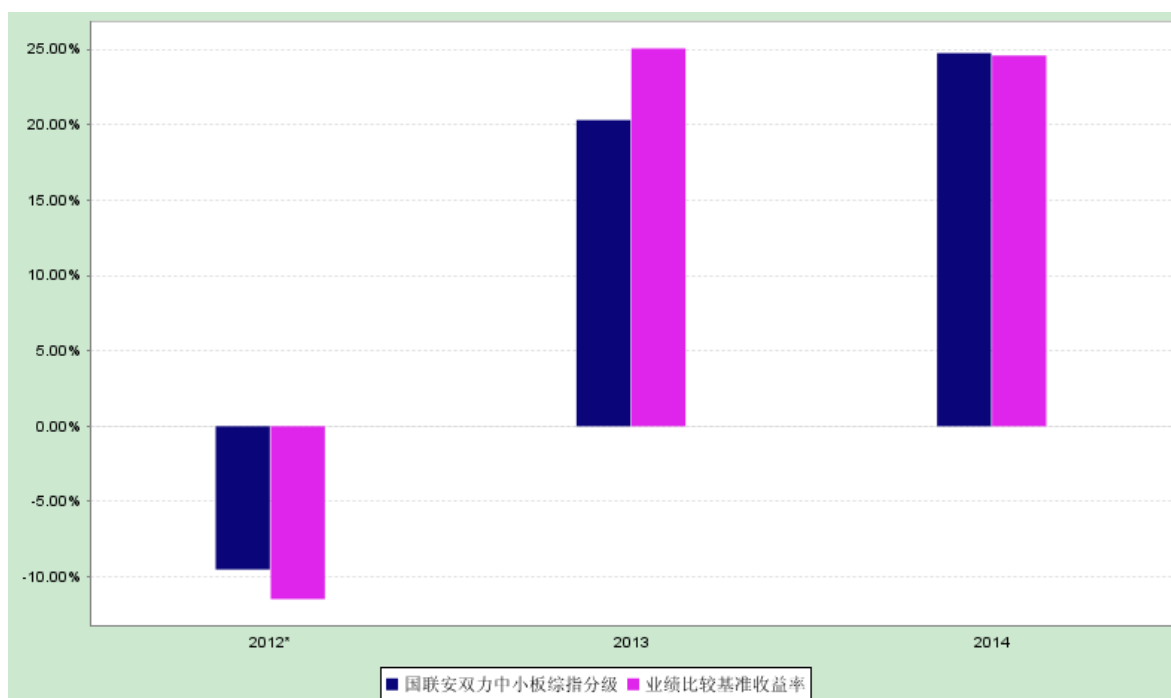
注：1、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率}$ （税后）；

2、本基金基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安双力中小板综指分级证券投资基金  
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：1、\*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 过去三年基金的利润分配情况

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰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、兼任国联安中证医药100指数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、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指	2012-03-23	-	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月起兼任本基金基金经理，2012年6月起至2013年7月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理，2013年8月起兼任国联安中证医药100指数证券

	证券投资 基金联接 基金基金 经理助理				投资基金基金经理。
--	------------------------------	--	--	--	-----------

注：1、基金经理的任职日期和离职日期均为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安双力中小板综指分级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

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.271 元，本报告期份额净值增长率为 24.74%，同期业绩比较基准收益率为 24.58%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.06%，年化跟踪误差为 1.33%，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。

#### 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及本基金基金合同的约定，本基金（包括双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额）分级运作期内，不进行收益分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警的说明**

2014 年 8 月 8 日-2014 年 11 月 6 日本基金资产净值低于 5000 万元。

2014 年 11 月 11 日-2014 年 12 月 31 日本基金资产净值低于 5000 万元。

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

毕马威华振审字第 1500277 号

国联安双力中小板综指分级证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称“国联安双力基金”)财务报表，包括 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。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

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

### 6.2 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。

### 6.3 审计意见

我们认为，国联安双力基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了国联安双力基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度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 资产负债表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,220,850.88	2,614,478.72
结算备付金		-	-
存出保证金		2,387.84	13,401.52
交易性金融资产	7.4.7.2	25,615,228.54	36,743,237.87
其中：股票投资		25,615,228.54	36,743,237.87
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		832,405.72	65,106.92
应收利息	7.4.7.5	403.24	646.11
应收股利		-	-
应收申购款		33,738.29	693.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		27,705,014.51	39,437,564.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年12月31日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付赎回款		775,623.11	168,779.33
应付管理人报酬		25,181.91	34,212.50
应付托管费		5,540.01	7,526.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,711.22	13,764.21
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	89,479.19	327,890.86
负债合计		900,535.44	552,173.66
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	19,730,852.65	35,731,949.68
未分配利润	7.4.7.10	7,073,626.42	3,153,441.50
所有者权益合计		26,804,479.07	38,885,391.18
负债和所有者权益总计		27,705,014.51	39,437,564.84

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.271 元，基金份额总额 21,093,447.46 份。其中国联安双力 A 中小板综指份额 8,144,124.00 份；国联安双力 B 中小板综指份额 8,144,125.00 份；国联安双力中小板综指份额 4,805,198.46 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

本报告期：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1月1日至2013年 12月31日
<b>一、收入</b>		<b>7,938,344.74</b>	<b>26,097,597.29</b>
1.利息收入		16,355.14	46,071.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,355.14	46,071.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,643,896.07	10,115,694.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,358,644.76	9,206,903.43
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	285,251.31	908,790.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,225,426.72	15,706,588.41
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	52,666.81	229,243.50
<b>减：二、费用</b>		<b>783,714.22</b>	<b>2,159,324.34</b>
1. 管理人报酬		327,817.42	954,008.57
2. 托管费		72,119.81	209,881.87
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	37,430.86	413,021.94
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	346,346.13	582,411.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>7,154,630.52</b>	<b>23,938,272.95</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>7,154,630.52</b>	<b>23,938,272.95</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

本报告期：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）	35,731,949.68	3,153,441.50	38,885,391.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,154,630.52	7,154,630.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-16,001,097.03	-3,234,445.60	-19,235,542.63
其中：1.基金申购款	18,737,108.10	7,062,461.01	25,799,569.11
2.基金赎回款	-34,738,205.13	-10,296,906.61	-45,035,111.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	19,730,852.65	7,073,626.42	26,804,479.07
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）	221,971,490.34	-21,192,683.82	200,778,806.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,938,272.95	23,938,272.95
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）	-186,239,540.66	407,852.37	-185,831,688.29
其中：1.基金申购款	2,282,166.75	46,423.93	2,328,590.68
2.基金赎回款	-188,521,707.41	361,428.44	-188,160,278.97

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）	35,731,949.68	3,153,441.50	38,885,391.18

注：报告附注为财务报表的组成部分

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为： $95\% \times$  中小板综指收益率 $+5\% \times$  活期存款利率(税后)。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人国联安基金管理有限公司以 2013 年 3 月 22 日、2014 年 3 月 21 日为本基金份额折算基准日，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了定期折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司进行了变更登记。

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 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 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。

##### **7.4.4.2 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。

##### **7.4.4.3 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。

#### **7.4.4.4 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。

#### **7.4.4.5 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。

#### **7.4.4.6 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。

#### **7.4.4.7 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。

#### **7.4.4.8 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)”。

#### **7.4.4.9 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。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的规定，指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费按前一日基金资产

净值的 0.02% 年费率每日计算，逐日累计，按季支付。基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

本基金的交易费用于进行股票、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。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

#### **7.4.4.12 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。

#### **7.4.5 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后的主要会计政策已在附注 3 中列示。采用上述企业会计准则对本基金本报告期无重大影响。

#### 7.4.5.2 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

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

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

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

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	1,220,850.88	2,614,478.72
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,220,850.88	2,614,478.72

#### 7.4.7.2 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		18,284,035.62	25,615,228.54	7,331,192.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		18,284,035.62	25,615,228.54	7,331,192.92
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		32,637,471.67	36,743,237.87	4,105,766.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		32,637,471.67	36,743,237.87	4,105,766.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2014 年 12 月 31 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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）及上年度末（2013 年 12 月 31 日），本基金均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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）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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	402.03	639.50
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.21	6.60
合计	403.24	646.11

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.6 其他资产

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

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,711.22	13,764.21
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,711.22	13,764.21

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,869.50	629.30
应付后端申购费	-	-
应付指数使用费	1,609.69	2,261.56
债券利息税	-	-
银行手续费	-	-
预提信息披露费	30,000.00	270,000.00
审计费	55,000.00	55,000.00
合计	89,479.19	327,890.86

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,049,377.21	35,731,949.68
本期申购	763,101.83	736,050.36
本期赎回（以“-”号填列）	-5,136,167.44	-4,953,503.98
2014 年 3 月 21 日基金拆分/份 额折算前	32,676,311.60	31,514,496.06
基金拆分/份额折算调整	1,010,368.84	-
本期申购	19,238,999.61	18,001,057.74
本期赎回（以“-”号填列）	-31,832,232.59	-29,784,701.15
本期末	21,093,447.46	19,730,852.65

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2014 年 3 月 21 日为份额折算基准日，对国联安双力中小板综指分级、国联安双力 A 中小板综指和国联安双力 B 中

小板综指实施首次定期份额折算。

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

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,821,119.94	-667,678.44	3,153,441.50
本期利润	3,929,203.80	3,225,426.72	7,154,630.52
本期基金份额交易产生的变动数	-2,546,365.24	-688,080.36	-3,234,445.60
其中：基金申购款	3,851,182.36	3,211,278.65	7,062,461.01
基金赎回款	-6,397,547.60	-3,899,359.01	-10,296,906.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,203,958.50	1,869,667.92	7,073,626.42

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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1月1日至2013年12月31日
活期存款利息收入	16,291.76	44,859.84
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	-	662.55
其他	63.38	548.72
合计	16,355.14	46,071.11

注：此处其他列示的是基金申购款滞留利息及结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 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12月31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	18,715,368.31	195,729,073.55
减：卖出股票成本总额	14,356,723.55	186,522,170.12
买卖股票差价收入	4,358,644.76	9,206,903.43



**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益买卖债券差价收入。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

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1月1日至2013年12月 31日
股票投资产生的股利收益	285,251.31	908,790.84
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	285,251.31	908,790.84

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年12月 31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
1.交易性金融资产	3,225,426.72	15,706,588.41
——股票投资	3,225,426.72	15,706,588.41
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	3,225,426.72	15,706,588.41

**7.4.7.17 其他收入**

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1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	51,962.45	222,645.21
转换费收入	704.36	2.58
其他	-	6,595.71
合计	52,666.81	229,243.50

注：1、此处列示的其他为交易所证管费返还收入。

2、本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

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1月1日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	37,430.86	413,021.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	37,430.86	413,021.94

#### 7.4.7.19 其他费用

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1月1日至2013年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	30,000.00	270,000.00
银行划款费用	1,998.00	3,259.91
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	199,348.13	194,152.05
其他	-	-
合计	346,346.13	582,411.96

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据基金合同约定，本基金于 2015 年 3 月 23 日(基金合同生效后三年期届满日)转换为上市开放式基金(LOF)。在转换日日终，双力 A、双力 B 的基金份额将以各自

的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起,本基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。

#### 7.4.9 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
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司 (“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司 (“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无股票交易。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 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	327,817.42	954,008.57
其中:支付销售机构的客户 维护费	24,372.47	58,274.22

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

2、在本基金分级运作期到期后,支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支

付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 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12月31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	72,119.81	209,881.87

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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

#### 国联安双力 A 中小板综指

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		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
国泰君安	500,000.00	6.14%	-	-

注：1、上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

2、国泰君安股份有限公司持有的上述基金份额乃根据正常的商业交易条件进行交易，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.10.5 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 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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
建设银行	1,220,850.88	16,291.76	2,614,478.72	44,859.84

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

2、本基金通过“建设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 0.00 元（2013 年 12 月 31 日：人民币 0.00 元）。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

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

##### 7.4.12.1 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（2014 年 12 月 31 日）未持有因认购新发或增发而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002018	华信国际	2014-11-19	重大资产重组停牌	13.99	2015-03-06	15.39	4,049	16,204.74	56,645.51	-
002050	三花股份	2014-10-27	重大事项停牌	13.57	2015-01-27	14.93	7,937	68,625.39	107,705.09	-
002071	长城影视	2014-12-09	重大事项	19.38	2015-02-16	21.32	3,016	20,842.51	58,450.08	-

			停牌								
002123	荣信股份	2014-12-22	重大事项停牌	9.22	2015-3-26	10.14	4,370	59,162.52	40,291.40		-
002135	东南网架	2014-12-15	重大事项停牌	5.62	2015-01-06	6.00	11,296	58,827.04	63,483.52		-
002152	广电运通	2014-12-17	重大事项停牌	22.15	2015-03-11	24.37	6,800	74,497.20	150,620.00		-
002157	正邦科技	2014-12-17	重大资产重组停牌	10.03	2015-3-16	11.03	4,514	41,822.27	45,275.42		-
002168	深圳惠程	2014-11-28	重大事项停牌	10.13	2015-01-28	9.51	6,109	58,024.56	61,884.17		-
002170	芭田股份	2014-12-25	筹划员工持股计划停牌	9.00	2015-01-05	9.38	8,687	41,651.76	78,183.00		-
002171	精诚铜业	2014-11-24	重大事项停牌	13.07		-	6,609	76,244.36	86,379.63		-
002180	艾派克	2014-11-06	重大事项停牌	23.51		-	1,457	16,373.31	34,254.07		-
002184	海得控制	2014-11-27	重大事项停牌	21.82	2015-01-26	20.00	2,439	14,264.23	53,218.98		-
002211	宏达新材	2014-12-10	重大事项停牌	8.93		-	4,699	35,245.43	41,962.07		-
002298	鑫龙电器	2014-09-30	重大资产重组停牌	8.97		-	6,388	51,300.19	57,300.36		-
002308	威创股份	2014-12-29	重大事项停牌	8.25	2015-02-04	9.08	7,306	54,124.18	60,274.50		-
002331	皖通科技	2014-11-10	重大事项	15.42	2015-3-25	16.96	2,033	14,642.50	31,348.86		-

			停牌							
002335	科华恒盛	2014-12-08	重大事项停牌	21.41	2015-01-30	22.00	3,352	31,092.99	71,766.32	-
002386	天原集团	2014-12-19	签订土地收储及地面上下建筑物征收补偿协议停牌	9.38	2015-01-07	10.00	7,065	53,056.04	66,269.70	-
002396	星网锐捷	2014-10-20	重大事项停牌	27.31	2015-02-09	30.04	3,556	56,324.37	97,114.36	-
002439	启明星辰	2014-12-08	重大事项停牌	26.24	2015-03-12	28.86	2,642	20,871.80	69,326.08	-
002451	摩恩电气	2014-12-18	重大事项停牌	7.51	2015-01-05	7.60	1,815	7,157.76	13,630.65	-
002482	广田股份	2014-12-10	重大事项停牌	15.13	2015-01-06	16.64	4,438	64,073.87	67,146.94	-
002528	英飞拓	2014-12-23	重大事项停牌	11.48	2015-02-13	12.63	2,343	16,488.30	26,897.64	-
002531	天顺风能	2014-12-18	重大事项停牌	15.28	2015-01-26	15.48	3,620	30,571.13	55,313.60	-
002602	世纪华通	2014-12-05	重大事项停牌	26.58	-	-	2,611	21,484.42	69,400.38	-
002617	露笑科技	2014-12-01	重大事项停牌	23.41	-	-	818	7,226.16	19,149.38	-
002647	宏磊股份	2014-06-05	重大事项停牌	8.41	2015-01-23	9.25	3,748	28,773.39	31,520.68	-
002663	普邦园林	2014-12-09	重大	18.3	2015-03-1	15.8	5,428	73,226.53	99,549.52	-

			事项 停牌	4	7	4				
002675	东诚药业	2014-10-10	重大 事项 停牌	24.1 8	-	-	2,867	39,079.28	69,324.06	
002694	顾地科技	2014-12-30	重大 事项 停牌	8.27	2015-3-17	9.10	4,130	25,815.18	34,155.10	

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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 0 元，因此没有作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 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 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。



### 7.4.13.2 信用风险

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用债券投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。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。

#### 7.4.13.4.1.1 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	1,220,850.88	-	-	-	-	-	-	-	-	1,220,850.88
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,387.84	-	-	-	-	-	-	-	-	2,387.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	25,615,228.54	25,615,228.54
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	832,405.72	832,405.72
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	403.24	403.24
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	33,738.29	33,738.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,223,238.72	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26,481,775.79	27,705,014.51
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回	-	-	-	-	-	-	-	-	775,62	775,62

回款									3.11	3.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	25,181.91	25,181.91
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	5,540.01	5,540.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	4,711.22	4,711.22
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	89,479.19	89,479.19
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	900,535.44	900,535.44
利率敏感度缺口	1,223,238.72	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	25,581,240.35	26,804,479.07
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	2,614,478.72	-	-	-	-	-	-	-	-	2,614,478.72
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	13,401.52	-	-	-	-	-	-	-	-	13,401.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	36,743,237.87	36,743,237.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	65,106.92	65,106.92
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	646.11	646.11
应收股	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

利										
应收申 购款	99.40	-	-	-	-	-	-	-	594.30	693.70
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总 计	2,627,9 79.64	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	36,809, 585.20	39,437, 564.84
负债										
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎 回款	-	-	-	-	-	-	-	-	168,77 9.33	168,77 9.33
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	-	-	-	34,212. 50	34,212. 50
应付托 管费	-	-	-	-	-	-	-	-	7,526.7 6	7,526.7 6
应付交 易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	13,764. 21	13,764. 21
其他负 债	-	-	-	-	-	-	-	-	327,89 0.86	327,89 0.86
负债总 计	-	-	-	-	-	-	-	-	552,17 3.66	552,17 3.66
利率敏 感度缺 口	2,627,9 79.64	-	-	-	-	-	-	-	36,257, 411.54	38,885, 391.18

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行利率敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 95.56%，无债券投资和衍生金融资产。

##### 7.4.13.4.3.1 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		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	25,615,228.54	95.56	36,743,237.87	94.49
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,615,228.54	95.56	36,743,237.87	94.49

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 1,339,320.79	增加 1,943,034.49
	业绩比较基准下降 5%	减少 1,339,320.79	减少 1,943,034.49

## § 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	25,615,228.54	92.46
	其中：股票	25,615,228.54	92.46
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	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	1,220,850.88	4.41
7	其他各项资产	868,935.09	3.14
8	合计	27,705,014.51	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 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	428,655.75	1.60
B	采矿业	263,101.26	0.98
C	制造业	18,811,965.68	70.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	247,254.77	0.92
E	建筑业	1,362,166.33	5.08
F	批发和零售业	1,146,065.78	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	155,952.95	0.58
H	住宿和餐饮业	85,752.75	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,253,846.44	4.68

J	金融业	799,345.09	2.98
K	房地产业	610,857.63	2.28
L	租赁和商务服务业	346,707.43	1.29
M	科学研究和技术服务业	45,106.60	0.17
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	58,450.08	0.22
S	综合	-	-
	合计	25,615,228.54	95.56

### 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所有股票投资明细

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

细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	23,479	525,225.23	1.96
2	002304	洋河股份	6,553	518,014.65	1.93
3	002024	苏宁云商	36,822	331,398.00	1.24
4	002142	宁波银行	20,353	320,152.69	1.19
5	002252	上海莱士	6,938	312,973.18	1.17
6	002500	山西证券	18,546	296,736.00	1.11
7	002202	金风科技	16,477	232,820.01	0.87
8	002081	金螳螂	12,776	214,636.80	0.80
9	002450	康得新	7,270	210,611.90	0.79
10	002146	荣盛发展	12,480	198,057.60	0.74
11	002673	西部证券	4,872	182,456.40	0.68
12	002065	东华软件	10,146	181,714.86	0.68
13	002051	中工国际	6,285	171,706.20	0.64
14	002594	比亚迪	4,323	164,922.45	0.62
15	002399	海普瑞	6,138	158,360.40	0.59
16	002007	华兰生物	4,748	158,108.40	0.59
17	002152	广电运通	6,800	150,620.00	0.56
18	002001	新和成	9,712	147,331.04	0.55

19	002344	海宁皮城	8,664	137,844.24	0.51
20	002353	杰瑞股份	4,377	133,804.89	0.50
21	002008	大族激光	8,363	133,557.11	0.50
22	002470	金正大	4,873	131,083.70	0.49
23	002038	双鹭药业	3,301	130,719.60	0.49
24	002570	贝因美	7,710	124,824.90	0.47
25	002183	怡亚通	8,110	120,514.60	0.45
26	002544	杰赛科技	4,186	116,538.24	0.43
27	002405	四维图新	5,963	116,457.39	0.43
28	002236	大华股份	5,202	114,183.90	0.43
29	002230	科大讯飞	4,166	111,023.90	0.41
30	002129	中环股份	5,131	108,007.55	0.40
31	002372	伟星新材	6,825	107,835.00	0.40
32	002050	三花股份	7,937	107,705.09	0.40
33	002311	海大集团	8,753	107,486.84	0.40
34	002375	亚厦股份	5,607	106,308.72	0.40
35	002285	世联行	7,052	106,062.08	0.40
36	002429	兆驰股份	13,833	105,130.80	0.39
37	002503	搜于特	5,317	104,851.24	0.39
38	002367	康力电梯	9,231	104,771.85	0.39
39	002219	恒康医疗	5,463	104,070.15	0.39
40	002445	中南重工	5,702	103,662.36	0.39
41	002030	达安基因	5,075	101,855.25	0.38
42	002128	露天煤业	10,911	101,799.63	0.38
43	002385	大北农	7,574	101,643.08	0.38
44	002190	成飞集成	3,124	99,968.00	0.37
45	002663	普邦园林	5,428	99,549.52	0.37
46	002299	圣农发展	7,863	99,466.95	0.37
47	002187	广百股份	7,853	98,633.68	0.37
48	002269	美邦服饰	9,282	97,925.10	0.37
49	002396	星网锐捷	3,556	97,114.36	0.36
50	002456	欧菲光	5,106	96,809.76	0.36
51	002520	日发精机	3,433	92,347.70	0.34
52	002039	黔源电力	6,472	92,290.72	0.34
53	002203	海亮股份	10,355	91,227.55	0.34
54	002267	陕天然气	8,201	88,652.81	0.33
55	002400	省广股份	4,077	88,348.59	0.33
56	002153	石基信息	1,341	87,969.60	0.33
57	002310	东方园林	4,735	87,455.45	0.33
58	002041	登海种业	2,709	86,823.45	0.32
59	002292	奥飞动漫	2,943	86,818.50	0.32



60	002171	精诚铜业	6,609	86,379.63	0.32
61	002140	东华科技	4,798	86,316.02	0.32
62	002092	中泰化学	11,133	86,280.75	0.32
63	002419	天虹商场	6,304	85,671.36	0.32
64	002444	巨星科技	7,648	85,657.60	0.32
65	002422	科伦药业	2,916	85,234.68	0.32
66	002179	中航光电	3,588	84,246.24	0.31
67	002294	信立泰	2,360	83,662.00	0.31
68	002250	联化科技	5,605	82,954.00	0.31
69	002223	鱼跃医疗	3,321	82,892.16	0.31
70	002416	爱施德	7,575	82,264.50	0.31
71	002228	合兴包装	6,026	81,230.48	0.30
72	002055	得润电子	7,140	81,039.00	0.30
73	002155	辰州矿业	7,848	79,971.12	0.30
74	002540	亚太科技	4,482	79,689.96	0.30
75	002240	威华股份	3,559	79,686.01	0.30
76	002063	远光软件	3,965	79,498.25	0.30
77	002436	兴森科技	2,718	79,311.24	0.30
78	002275	桂林三金	4,319	79,253.65	0.30
79	002302	西部建设	5,210	78,827.30	0.29
80	002170	芭田股份	8,687	78,183.00	0.29
81	002588	史丹利	2,003	78,016.85	0.29
82	002221	东华能源	4,678	77,140.22	0.29
83	002097	山河智能	7,649	76,872.45	0.29
84	002340	格林美	5,936	76,693.12	0.29
85	002177	御银股份	10,964	76,309.44	0.28
86	002242	九阳股份	6,887	76,239.09	0.28
87	002156	通富微电	9,372	75,163.44	0.28
88	002100	天康生物	6,274	74,974.30	0.28
89	002489	浙江永强	5,501	74,758.59	0.28
90	002534	杭锅股份	4,057	74,202.53	0.28
91	002271	东方雨虹	2,216	73,881.44	0.28
92	002556	辉隆股份	5,768	73,715.04	0.28
93	002564	天沃科技	9,846	72,958.86	0.27
94	002650	加加食品	6,166	72,943.78	0.27
95	002005	德豪润达	9,183	72,821.19	0.27
96	002110	三钢闽光	11,776	72,540.16	0.27
97	002392	北京利尔	5,396	72,522.24	0.27
98	002185	华天科技	5,796	72,392.04	0.27
99	002204	大连重工	5,998	71,916.02	0.27
100	002495	佳隆股份	4,230	71,867.70	0.27

101	002287	奇正藏药	3,199	71,785.56	0.27
102	002335	科华恒盛	3,352	71,766.32	0.27
103	002321	华英农业	9,455	71,763.45	0.27
104	002461	珠江啤酒	5,594	71,659.14	0.27
105	002262	恩华药业	2,879	71,399.20	0.27
106	002078	太阳纸业	17,574	71,350.44	0.27
107	002665	首航节能	1,821	71,255.73	0.27
108	002064	华峰氨纶	6,656	71,219.20	0.27
109	002022	科华生物	3,356	71,147.20	0.27
110	002056	横店东磁	3,237	71,052.15	0.27
111	002224	三力士	8,182	71,019.76	0.26
112	002080	中材科技	5,424	70,512.00	0.26
113	002432	九安医疗	3,060	70,227.00	0.26
114	002303	美盈森	5,224	70,106.08	0.26
115	002501	利源精制	2,502	69,855.84	0.26
116	002085	万丰奥威	2,635	69,827.50	0.26
117	002025	航天电器	3,693	69,797.70	0.26
118	002485	希努尔	6,373	69,465.70	0.26
119	002602	世纪华通	2,611	69,400.38	0.26
120	002439	启明星辰	2,642	69,326.08	0.26
121	002675	东诚药业	2,867	69,324.06	0.26
122	002316	键桥通讯	7,975	69,223.00	0.26
123	002073	软控股份	5,715	69,208.65	0.26
124	002701	奥瑞金	3,376	69,106.72	0.26
125	002462	嘉事堂	2,569	68,592.30	0.26
126	002307	北新路桥	5,830	68,327.60	0.25
127	002035	华帝股份	5,610	67,656.60	0.25
128	002191	劲嘉股份	4,925	67,521.75	0.25
129	002029	七匹狼	7,542	67,199.22	0.25
130	002482	广田股份	4,438	67,146.94	0.25
131	002062	宏润建设	11,044	66,595.32	0.25
132	002208	合肥城建	8,049	66,484.74	0.25
133	002479	富春环保	7,303	66,311.24	0.25
134	002386	天原集团	7,065	66,269.70	0.25
135	002106	莱宝高科	5,178	65,657.04	0.24
136	002004	华邦颖泰	3,774	65,592.12	0.24
137	002244	滨江集团	8,132	65,381.28	0.24
138	002484	江海股份	4,413	65,224.14	0.24
139	002254	泰和新材	5,698	65,185.12	0.24
140	002428	云南锗业	4,462	64,743.62	0.24
141	002266	浙富控股	7,613	64,329.85	0.24

142	002277	友阿股份	5,083	64,198.29	0.24
143	002276	万马股份	7,788	64,095.24	0.24
144	002557	洽洽食品	3,383	63,972.53	0.24
145	002369	卓翼科技	6,646	63,735.14	0.24
146	002382	蓝帆医疗	3,732	63,705.24	0.24
147	002023	海特高新	2,894	63,668.00	0.24
148	002032	苏泊尔	3,733	63,535.66	0.24
149	002135	东南网架	11,296	63,483.52	0.24
150	002533	金杯电工	9,635	62,820.20	0.23
151	002251	步步高	4,474	62,680.74	0.23
152	002430	杭氧股份	7,070	61,933.20	0.23
153	002168	深圳惠程	6,109	61,884.17	0.23
154	002118	紫鑫药业	5,117	61,557.51	0.23
155	002463	沪电股份	12,833	61,470.07	0.23
156	002147	方圆支承	7,545	61,265.40	0.23
157	002449	国星光电	5,784	61,194.72	0.23
158	002012	凯恩股份	9,443	60,907.35	0.23
159	002273	水晶光电	3,561	60,893.10	0.23
160	002104	恒宝股份	5,028	60,838.80	0.23
161	002418	康盛股份	4,408	60,830.40	0.23
162	002440	闰土股份	3,393	60,802.56	0.23
163	002550	千红制药	2,977	60,552.18	0.23
164	002069	獐子岛	5,075	60,392.50	0.23
165	002117	东港股份	2,966	60,358.10	0.23
166	002345	潮宏基	7,184	60,345.60	0.23
167	002308	威创股份	7,306	60,274.50	0.22
168	002237	恒邦股份	3,696	59,912.16	0.22
169	002121	科陆电子	4,901	59,547.15	0.22
170	002394	联发股份	5,534	59,379.82	0.22
171	002115	三维通信	6,690	59,273.40	0.22
172	002496	辉丰股份	2,718	59,252.40	0.22
173	002630	华西能源	3,493	59,206.35	0.22
174	002300	太阳电缆	8,277	59,180.55	0.22
175	002384	东山精密	5,384	58,900.96	0.22
176	002358	森源电气	1,682	58,870.00	0.22
177	002474	榕基软件	5,585	58,810.05	0.22
178	002492	恒基达鑫	6,268	58,668.48	0.22
179	002071	长城影视	3,016	58,450.08	0.22
180	002325	洪涛股份	5,378	58,351.30	0.22
181	002011	盾安环境	5,950	58,191.00	0.22
182	002363	隆基机械	4,153	58,058.94	0.22

183	002232	启明信息	5,607	57,583.89	0.21
184	002279	久其软件	2,128	57,498.56	0.21
185	002122	天马股份	7,520	57,377.60	0.21
186	002366	丹甫股份	1,896	57,354.00	0.21
187	002298	鑫龙电器	6,388	57,300.36	0.21
188	002322	理工监测	4,717	57,122.87	0.21
189	002364	中恒电气	3,489	56,975.37	0.21
190	002018	华信国际	4,049	56,645.51	0.21
191	002443	金洲管道	8,746	56,324.24	0.21
192	002646	青青稞酒	2,622	56,241.90	0.21
193	002433	太安堂	4,859	55,975.68	0.21
194	002186	全聚德	2,935	55,911.75	0.21
195	002689	博林特	6,056	55,715.20	0.21
196	002521	齐峰新材	5,239	55,690.57	0.21
197	002567	唐人神	6,477	55,507.89	0.21
198	002096	南岭民爆	4,909	55,471.70	0.21
199	002226	江南化工	4,405	55,414.90	0.21
200	002138	顺络电子	3,173	55,368.85	0.21
201	002531	天顺风能	3,620	55,313.60	0.21
202	002060	粤水电	7,422	55,071.24	0.21
203	002457	青龙管业	5,310	55,064.70	0.21
204	002313	日海通讯	4,956	55,011.60	0.21
205	002454	松芝股份	3,907	54,776.14	0.20
206	002220	天宝股份	6,377	54,650.89	0.20
207	002327	富安娜	4,075	54,605.00	0.20
208	002003	伟星股份	5,526	54,431.10	0.20
209	002511	中顺洁柔	5,533	54,223.40	0.20
210	002013	中航机电	2,185	54,188.00	0.20
211	002431	棕榈园林	2,563	54,104.93	0.20
212	002293	罗莱家纺	2,086	53,735.36	0.20
213	002184	海得控制	2,439	53,218.98	0.20
214	002581	万昌科技	1,555	53,181.00	0.20
215	002522	浙江众成	2,768	53,090.24	0.20
216	002589	瑞康医药	1,642	53,085.86	0.20
217	002535	林州重机	6,362	52,295.64	0.20
218	002233	塔牌集团	5,132	52,192.44	0.19
219	002133	广宇集团	10,652	51,981.76	0.19
220	002626	金达威	2,146	51,740.06	0.19
221	002565	上海绿新	6,348	51,672.72	0.19
222	002165	红宝丽	8,196	51,552.84	0.19
223	002377	国创高新	7,536	51,320.16	0.19

224	002218	拓日新能	5,483	51,211.22	0.19
225	002600	江粉磁材	4,767	50,863.89	0.19
226	002559	亚威股份	2,810	50,832.90	0.19
227	002356	浩宁达	1,325	50,588.50	0.19
228	002144	宏达高科	2,915	50,429.50	0.19
229	002053	云南盐化	3,210	49,755.00	0.19
230	002255	海陆重工	3,655	49,379.05	0.18
231	002404	嘉欣丝绸	4,578	49,167.72	0.18
232	002350	北京科锐	3,999	49,027.74	0.18
233	002216	三全食品	2,521	48,932.61	0.18
234	002010	传化股份	5,344	48,470.08	0.18
235	002314	雅致股份	9,660	48,300.00	0.18
236	002478	常宝股份	4,293	48,081.60	0.18
237	002638	勤上光电	4,022	47,982.46	0.18
238	002554	惠博普	4,503	47,956.95	0.18
239	002510	天汽模	5,434	47,873.54	0.18
240	002020	京新药业	2,882	47,841.20	0.18
241	002037	久联发展	2,963	47,704.30	0.18
242	002088	鲁阳股份	3,572	47,686.20	0.18
243	002093	国脉科技	7,720	46,937.60	0.18
244	002048	宁波华翔	3,259	46,831.83	0.17
245	002333	罗普斯金	4,142	46,804.60	0.17
246	002628	成都路桥	8,098	46,644.48	0.17
247	002256	彩虹精化	4,612	46,396.72	0.17
248	002047	宝鹰股份	8,543	46,388.49	0.17
249	002527	新时达	2,830	46,270.50	0.17
250	002182	云海金属	4,118	46,039.24	0.17
251	002523	天桥起重	7,000	45,990.00	0.17
252	002393	力生制药	1,431	45,834.93	0.17
253	002157	正邦科技	4,514	45,275.42	0.17
254	002339	积成电子	4,032	45,198.72	0.17
255	002398	建研集团	2,828	45,106.60	0.17
256	002332	仙琚制药	4,128	44,995.20	0.17
257	002238	天威视讯	3,199	44,849.98	0.17
258	002574	明牌珠宝	4,358	44,625.92	0.17
259	002283	天润曲轴	5,167	44,539.54	0.17
260	002016	世荣兆业	5,090	44,537.50	0.17
261	002077	大港股份	5,610	44,487.30	0.17
262	002101	广东鸿图	2,795	44,300.75	0.17
263	002031	巨轮股份	3,452	44,116.56	0.16
264	002176	江特电机	3,015	43,807.95	0.16

265	002402	和而泰	2,578	43,722.88	0.16
266	002082	栋梁新材	4,650	43,663.50	0.16
267	002028	思源电气	3,505	43,637.25	0.16
268	002642	荣之联	1,556	43,536.88	0.16
269	002099	海翔药业	5,051	43,236.56	0.16
270	002618	丹邦科技	1,656	43,221.60	0.16
271	002054	德美化工	4,979	43,167.93	0.16
272	002284	亚太股份	3,351	43,160.88	0.16
273	002108	沧州明珠	3,244	43,145.20	0.16
274	002695	煌上煌	1,524	43,098.72	0.16
275	002614	蒙发利	3,093	42,930.84	0.16
276	002320	海峡股份	3,933	42,594.39	0.16
277	002631	德尔家居	3,714	41,968.20	0.16
278	002211	宏达新材	4,699	41,962.07	0.16
279	002477	雏鹰农牧	4,751	41,618.76	0.16
280	002601	佰利联	1,970	41,468.50	0.15
281	002668	奥马电器	2,047	41,349.40	0.15
282	002605	姚记扑克	2,280	41,313.60	0.15
283	002362	汉王科技	2,472	41,307.12	0.15
284	002537	海立美达	2,602	41,189.66	0.15
285	002674	兴业科技	3,243	41,088.81	0.15
286	002518	科士达	2,552	40,883.04	0.15
287	002667	鞍重股份	1,223	40,652.52	0.15
288	002536	西泵股份	1,546	40,567.04	0.15
289	002083	孚日股份	8,224	40,544.32	0.15
290	002014	永新股份	4,807	40,523.01	0.15
291	002209	达意隆	4,457	40,424.99	0.15
292	002309	中利科技	2,142	40,333.86	0.15
293	002123	荣信股份	4,370	40,291.40	0.15
294	002161	远望谷	4,922	39,868.20	0.15
295	002441	众业达	1,759	39,823.76	0.15
296	002045	国光电器	5,873	39,818.94	0.15
297	002494	华斯股份	2,900	39,440.00	0.15
298	002079	苏州固锔	5,404	39,016.88	0.15
299	002086	东方海洋	3,724	38,953.04	0.15
300	002435	长江润发	4,069	38,777.57	0.14
301	002584	西陇化工	2,322	38,521.98	0.14
302	002074	东源电器	2,699	38,136.87	0.14
303	002167	东方锆业	2,758	38,115.56	0.14
304	002389	南洋科技	4,076	37,580.72	0.14
305	002141	睿胜超微	2,699	37,489.11	0.14

306	002091	江苏国泰	2,589	37,462.83	0.14
307	002052	同洲电子	4,087	37,273.44	0.14
308	002206	海利得	4,622	37,253.32	0.14
309	002548	金新农	3,861	37,181.43	0.14
310	002546	新联电子	2,856	37,013.76	0.14
311	002539	新都化工	2,121	36,905.40	0.14
312	002472	双环传动	3,071	36,852.00	0.14
313	002042	华孚色纺	6,839	36,725.43	0.14
314	002622	永大集团	1,249	36,720.60	0.14
315	002154	报喜鸟	4,542	36,653.94	0.14
316	002664	信质电机	1,294	36,581.38	0.14
317	002641	永高股份	3,892	36,545.88	0.14
318	002087	新野纺织	7,519	36,316.77	0.14
319	002109	兴化股份	6,065	36,208.05	0.14
320	002301	齐心集团	4,222	35,929.22	0.13
321	002502	骅威股份	2,926	35,638.68	0.13
322	002107	沃华医药	1,465	35,423.70	0.13
323	002139	拓邦股份	2,813	35,246.89	0.13
324	002612	朗姿股份	1,521	34,983.00	0.13
325	002543	万和电气	3,112	34,543.20	0.13
326	002317	众生药业	1,789	34,348.80	0.13
327	002636	金安国纪	2,903	34,284.43	0.13
328	002541	鸿路钢构	2,554	34,274.68	0.13
329	002180	艾派克	1,457	34,254.07	0.13
330	002694	顾地科技	4,130	34,155.10	0.13
331	002513	蓝丰生化	3,083	34,128.81	0.13
332	002328	新朋股份	4,211	34,109.10	0.13
333	002596	海南瑞泽	3,044	33,910.16	0.13
334	002305	南国置业	4,697	33,865.37	0.13
335	002193	山东如意	3,384	33,400.08	0.12
336	002681	奋达科技	1,218	33,385.38	0.12
337	002629	仁智油服	4,246	33,373.56	0.12
338	002452	长高集团	1,819	33,287.70	0.12
339	002417	三元达	3,986	32,964.22	0.12
340	002347	泰尔重工	3,148	32,078.12	0.12
341	002516	江苏旷达	1,761	32,050.20	0.12
342	002280	新世纪	868	32,011.84	0.12
343	002647	宏磊股份	3,748	31,520.68	0.12
344	002331	皖通科技	2,033	31,348.86	0.12
345	002656	卡奴迪路	2,052	31,190.40	0.12
346	002295	精艺股份	3,385	31,142.00	0.12

347	002365	永安药业	2,555	30,813.30	0.11
348	002231	奥维通信	3,843	30,205.98	0.11
349	002661	克明面业	842	30,185.70	0.11
350	002649	博彦科技	950	30,067.50	0.11
351	002306	中科云网	4,900	29,841.00	0.11
352	002676	顺威股份	1,826	29,782.06	0.11
353	002696	百洋股份	2,544	29,637.60	0.11
354	002685	华东重机	2,136	29,476.80	0.11
355	002578	闽发铝业	1,579	29,448.35	0.11
356	002504	东光微电	1,722	28,912.38	0.11
357	002143	高金食品	1,914	28,308.06	0.11
358	002488	金固股份	1,211	28,264.74	0.11
359	002682	龙洲股份	3,184	28,242.08	0.11
360	002201	九鼎新材	3,400	27,438.00	0.10
361	002528	英飞拓	2,343	26,897.64	0.10
362	002576	通达动力	1,438	26,861.84	0.10
363	002381	双箭股份	2,127	26,736.39	0.10
364	002597	金禾实业	1,939	26,544.91	0.10
365	002590	万安科技	2,193	26,513.37	0.10
366	002627	宜昌交运	1,856	26,448.00	0.10
367	002360	同德化工	3,601	25,495.08	0.10
368	002580	圣阳股份	1,453	25,107.84	0.09
369	002635	安洁科技	924	24,920.28	0.09
370	002406	远东传动	2,418	24,566.88	0.09
371	002124	天邦股份	2,650	24,168.00	0.09
372	002112	三变科技	2,367	24,143.40	0.09
373	002666	德联集团	1,772	23,301.80	0.09
374	002212	南洋股份	3,671	23,237.43	0.09
375	002343	禾欣股份	1,743	23,181.90	0.09
376	002662	京威股份	1,815	21,961.50	0.08
377	002620	瑞和股份	1,316	21,779.80	0.08
378	002593	日上集团	1,582	21,325.36	0.08
379	002617	露笑科技	818	19,149.38	0.07
380	002654	万润科技	1,481	18,941.99	0.07
381	002545	东方铁塔	1,196	18,310.76	0.07
382	002660	茂硕电源	2,011	18,038.67	0.07
383	002455	百川股份	2,070	18,029.70	0.07
384	002095	生意宝	486	15,347.88	0.06
385	002451	摩恩电气	1,815	13,630.65	0.05
386	002692	远程电缆	1,151	13,489.72	0.05
387	002195	海隆软件	96	4,102.08	0.02



### 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	002522	浙江众成	3,287.50	0.01

### 8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔声学	489,274.83	1.26
2	002415	海康威视	417,650.35	1.07
3	002304	洋河股份	375,511.65	0.97
4	002024	苏宁云商	308,192.06	0.79
5	002252	上海莱士	281,301.58	0.72
6	002399	海普瑞	250,998.74	0.65
7	002142	宁波银行	250,704.24	0.64
8	002081	金螳螂	194,721.88	0.50
9	002450	康得新	184,478.04	0.47
10	002432	九安医疗	182,641.08	0.47
11	002202	金风科技	167,766.21	0.43
12	002065	东华软件	154,292.06	0.40
13	002031	巨轮股份	150,463.44	0.39
14	002146	荣盛发展	149,192.38	0.38
15	002312	三泰电子	141,557.70	0.36
16	002195	海隆软件	139,874.50	0.36
17	002236	大华股份	137,963.15	0.35
18	002240	威华股份	135,764.80	0.35
19	002353	杰瑞股份	131,278.39	0.34
20	002129	中环股份	122,141.98	0.31

### 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	3,287.50
卖出股票的收入（成交）总额	18,715,368.31

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序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 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	2,387.84
2	应收证券清算款	832,405.72
3	应收股利	-
4	应收利息	403.24
5	应收申购款	33,738.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	868,935.09

### 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换债券。

### 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

本基金本报告期末指数投资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

本基金本报告期末积极投资前五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

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国联安双力 A 中小板综指	248	32,839.21	4,262,097.00	52.33%	3,882,027.00	47.67%
国联安双力 B 中小板综指	502	16,223.36	100,200.00	1.23%	8,043,925.00	98.77%
国联安双力中 小板综指	654	7,347.40	1,227,756.00	25.55%	3,577,442.46	74.45%
合计	1,404	15,023.82	5,590,053.00	26.50%	15,503,394.46	73.50%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

国联安双力A中小板综指

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司—传统保险产品	3,706,355.00	45.51%
2	郑淑女	500,053.00	6.14%
3	国泰君安证券股份有限公司	500,000.00	6.14%
4	彩霞	407,400.00	5.00%
5	张兰华	258,700.00	3.18%
6	孙学让	230,023.00	2.82%
7	方向	222,119.00	2.73%
8	杨楚杰	150,012.00	1.84%
9	肖瑞华	100,010.00	1.23%
10	黄乐平	100,010.00	1.23%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双力B中小板综指

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	叶立新	662,270.00	8.13%
2	吴希龙	446,613.00	5.48%

3	郑淑女	424,553.00	5.21%
4	杨震	300,000.00	3.68%
5	金纪良	259,082.00	3.18%
6	朱洪宏	252,000.00	3.09%
7	杨楚杰	170,012.00	2.09%
8	许海燕	136,106.00	1.67%
9	辛文功	112,000.00	1.38%
10	黄国跃	110,000.00	1.35%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	国联安双力 A 中小板综指	-	-
	国联安双力 B 中小板综指	-	-
	国联安双力 中小板综指	-	-
	合计	-	-

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：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

项目	国联安双力 A 中小板综指	国联安双力 B 中小板综指	国联安双力中小板综指
基金合同生效日(2012 年 3 月 23 日)基金份额总额	179,140,090.00	179,140,091.00	450,829,005.27
本报告期期初基金份额总额	14,894,600.00	14,894,601.00	7,260,176.21
本报告期基金总申购份额	-	-	21,012,470.28

减：本报告期基金总赎回份额	-	-	36,968,400.03
本报告期基金拆分变动份额	-6,750,476.00	-6,750,476.00	13,500,952.00
本报告期期末基金份额总额	8,144,124.00	8,144,125.00	4,805,198.46

注：1、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

2、国联安双力的本期申购份额中包含有双力 A 折算时增加的份额 1,010,368.84 份。

## 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

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 2 月 7 日，本基金托管人发布任免通知，解聘尹东中国建设银行股份有限公司投资托管业务部总经理助理职务。

3、2014 年 11 月 03 日，本基金托管人发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行股份有限公司投资托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金本报告期末支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 5.5 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 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	18,715,368.31	100.00%	16,561.29	100.00%	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

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

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

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

A 提供的研究报告质量和数量；

B 研究报告被基金采纳的情况；

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；

E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

H 其他可评价的量化标准。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

### 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		股指期货交易	
	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	成交金额	占当期成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-



有限公司									
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于旗下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	2014-1-16
2	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持鱼跃医疗（002223）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	2014-2-27
3	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持欧菲光（002456）和新华医疗（600587）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	2014-3-12
4	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-3-14
5	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-3-14
6	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）及配对转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	2014-3-14
7	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额定期折算后次日前收盘价调整的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、公	2014-3-14

		司网站	
8	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-18
9	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）及配对转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-18
10	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额定期折算后次日前收盘价调整的提示公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-18
11	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间双力 A 份额停牌的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-24
12	关于国联安双力 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-25
13	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-25
14	关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力 A 份额第三个运作周年约定年基准收益率的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-25
15	《关于国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告》的更正公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-26
16	国联安双力中小板综指分级证券投资基金 2013 年年报	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-3-31
17	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	2014-4-2
18	国联安双力中小板综指分级证券投资	《中国证券报》、	2014-4-21

	基金 2014 年 1 季报	《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	
19	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持荣之联（002642）和乐普医疗（300003）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	2014-4-30
20	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	2014-4-30
21	国联安双力中小板综指分级证券投资 基金招募说明书	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-5-6
22	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰证券股份有限公司开通定期定额投资业务并参加相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-5-21
23	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持骅威股份（002502）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	2014-5-28
24	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持卫宁软件（300253）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	2014-6-18
25	国联安基金管理有限公司关于旗下基金投资控股股东分销证券的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-6-28
26	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	2014-7-2
27	国联安双力中小板综指分级证券投资 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	2014-7-18
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海莱士（002252）和尚荣医疗（002551）估值调整的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公	2014-8-2

		司网站	
29	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	2014-8-8
30	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持久其软件(002279)估值调整的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-8-21
31	国联安双力中小板综指分级证券投资 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	2014-8-29
32	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持九安医疗(002432)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	2014-8-30
33	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持金风科技(002202)和东华软件(002065)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	2014-9-4
34	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持德豪润达(002005)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	2014-9-5
35	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	2014-9-17
36	国联安双力中小板综指分级证券投资 基金 2014 年 3 季报	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》公司 网站	2014-10-27
37	国联安双力中小板综指分级证券投资 基金招募说明书(更新)摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、公 司网站	2014-11-6
38	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
39	国联安基金管理有限公司关于旗下基	《中国证券报》、	2014-11-29

	金所持宜华地产(000150)和亚威股份(002559)估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、公司网站	
40	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	2014-12-1
41	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	2014-12-6
42	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
43	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
44	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》、公司网站	2014-12-13
45	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
46	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 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双力中小板综指分级证券投资基金发行及募集的文件
- 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、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》

- 4、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金托管协议》
- 5、国联安双力中小板综指分级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

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

## 12.3 查阅方式

网址：[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com) 或 [www.vip-funds.com](http://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