

## 德盛安心成长混合型证券投资基金

## 2006年年度报告摘要

基金管理人:国联安基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金管理人及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责任。本年度报告正文中凡以独立章节签字方式,并由董事长签发。

本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3月3日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本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,也不保证基金份额持有人最低收益。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

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。

## 一、基金简介

(一)基金名称:德盛安心成长混合型证券投资基金  
基金简称:德盛安心  
基金代码:253010  
基金运作方式:契约型开放式  
基金合同生效日:2006年7月13日  
报告期末基金份额:43,226,357.46份

## (二)基金投资概况

基金投资目标	长期风险投资,分享经济增长,追求绝对收益。
基金投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次通过全线的风险管理,结合数量化的金融工程模型,跟踪市场以及基金超额收益的动向,进行资产配置、行业配置和不同类别债券的配置;第二个层次,在跟踪市场的基础上,以价值选股为原则,主要采取基本面好、流动性好、市值被低估的公司,在行业配置基础上进行行业轮动管理,注重风险管理,动态调整仓位,基于中长期定期趋势与利率趋势的分析和行业景气度与风险度,动态选择可转换债券类投资机会。
基金业绩比较基准	“德盛安心成长”,“德盛安心成长”的固定方式为在基金合同生效日的值为0.00元,跟踪期间的指数每天上,在任一交易日结束时前一交易日存款税后利率乘以365。
风险收益特征	中风险的基金品种,追求长期稳定的收益。

(三)基金管理人及注册登记机构:国联安基金管理有限公司	
信息披露负责人:古蔚	
联系电话:021-60478900	
传真:021-60478920	
网址:http://www.gtja-allianz.com	
电子邮箱:customerservice@gtja-allianz.com	
(四)基金管理人名称:中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人:郭松光	
联系电话:010-66106912	
传真:010-66106904	
电子邮箱:custody@icbc.com.cn	
(五)基金年度报告正文上网网址:www.gtja-allianz.com	
基金年度报告备查地点:上海市浦东新川路88号金茂大厦46楼	

## 二、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标(金额单位:人民币元)

	2006年	2006年7月13日-2006年12月31日
基金资产净值	17,588,181.32	3,490,714.90
基金份额持有人数量	10,033	10,033
基金资产净值增长率	0.034	1.466,88877
期末可供分配收益	4,062,482.14	0.0000
期末可供分配收益占期末基金资产净值的比例	0.0940	0.0000
期末基金份额净值	47,719,713.70	142,972,780.17
期末基金份额持有人数量	1,019	1,019
基金份额持有人户数	27,046	1286
基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	39.73%	19.0%
基金份额持有人户数占基金份额持有人总数的比例	39.73%	19.0%

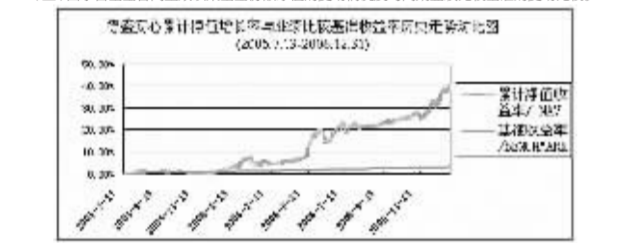
注:上述主要财务指标的计算公式,详见信息披露发布的证券投资基金信息披露编制规则-第7章《主要财务指标的计算及披露》。

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将低于所列数字。

## (二)与同期业绩比较基准变动的比较

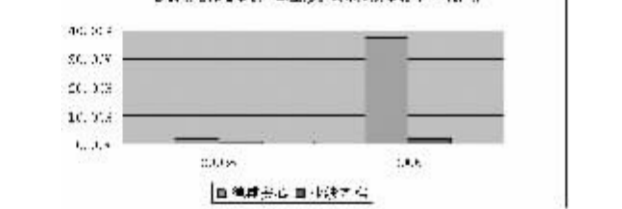
阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	超额收益(1)-(2)	(2)-(1)
过去三个月	12.4%	0.52%	0.5%	0.01%	0.51%
过去6个月	16.0%	0.5%	1.08%	0.01%	14.98%
过去1年	32.7%	0.5%	2.0%	0.01%	30.3%
自基金合同生效至今	39.8%	0.4%	3.0%	0.01%	36.5%

(三)图示自基金合同生效以来基金净值变动的变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较。



注:本基金的业绩基准为“德盛安心成长”,“德盛安心成长”的固定方式为在基金合同生效日的值为0.00元,跟踪期间的指数每天上,在任一交易日结束时前一交易日存款税后利率乘以365。

(四)图示自基金合同生效以来基金的净值增长率及与同期业绩比较基准收益率比较。



\*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率

## (五)自基金合同生效以来基金资产的配置情况

年度	每10份基金份额的买入金额	备注	合计
2006	2700元	-	2700元
2005	-	-	-

## 三、基金管理人

(一)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金管理人简介:国联安基金管理有限公司是中国一家获准筹建的中外合资基金管理公司,其中方股东为国联安证券股份有限公司,是目前中国规模最大、经营范围最广、机构分布最广的综合类证券公司之一,为外资控股的国内最大资产管理集团,也是全球领先的综合性金融集团之一,公司目前管理着五只开放式基金。国联安基金管理有限公司的国际化背景,使得外方股东在人才、技术和风险管理方面,结合本地化投资者对客户“服务至上”的经营理念,秉持“稳健、专业、诚信”的经营理念,力争成为中国领先的基金资产管理公司。

(二)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(三)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(四)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(五)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(六)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(七)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(八)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(九)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(十)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(十一)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(十二)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(十三)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(十四)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

(十五)基金管理人:国联安基金管理有限公司  
基金经理简介:古蔚,男,1968年11月生,复旦大学金融学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员,行业研究副经理及美国FRAMINGHAM基金管理公司基金经理。2003年加入本公司,2006年7月担任德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2006年9月起兼任德盛稳健证券投资基金基金经理。

银行存款	2006(v)	15,734,440.21	57,415,762.96
交易性金融资产	5	415,580.63	915,677.16
应收利息	5	250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		191,026.79	-
预收账款	6	86,773.11	602,166.30
其他应收款		433,576.00	9,126,820.00
其他流动资产		500.00	500.00
流动资产合计	7	14,661,080.64	10,372,854.50
其中:理财产品投资		11,770,742.77	9,817,279.98
其中:债券投资	7	17,339,463.50	74,306,279.63
其中:债券投资成本	7	16,432,217.26	73,969,277.41
其中:债券投资公允价值变动	7	236,935.50	-
其中:权证投资成本	7	120,393.62	-
非流动资产	7	49,408,385.38	153,528,160.42
总计		64,069,466.02	163,899,014.92
负债		699,303.66	3,921,583.34
应付证券清算款		289,783.28	2,855,764.42
应付赎回款		798.07	22,069.50
应付利息	2006(v)	65,144.40	191,423.60
应付托管费	2006(v)	10,919.03	31,906.42
应付税费	8	54,546.72	37,492.44
其他应付款	9	397,818.92	374,478.12
预收账款	10	170,000.00	170,000.00
其他流动负债		88,671.68	10,555,380.25
负债合计		1,008,641.16	5,538,380.25

德盛安心成长混合型证券投资基金  
资产负债表(续)  
2006年12月31日  
(金额单位:人民币元)

附注	2006年	2005年	
实收资本	11	43,226,357.46	140,245,398.25
未实现利得	12	4,302,474.10	1,270,483.07
未分配基金净收益	4	4,062,482.14	1,456,888.77
所有者权益合计		47,719,713.70	142,972,780.17
其中:未分配基金净收益		49,408,385.38	153,528,160.42
未分配基金净收益		47,719,713.70	142,972,780.17
负债及所有者权益总计		64,069,466.02	163,899,014.92

德盛安心成长混合型证券投资基金

损益表(续)

2006年度

(金额单位:人民币元)

附注	2006年	2005年	
营业收入			
股票差价收入	13	13,910,095.14	(2,370,314.74)
债券差价收入	14	1,763,313.07	4,741,856.03
权证差价收入	15	1,961,915.63	6,861,253.60
存款利息收入		699,586.01	1,831,668.20
存贷款净收入		154,212.38	580,345.29
股利收入		240,894.06	-
买入返售证券收入		30,410.00	44,960.00
其他收入	16	285,678.70	364,841.86
收入合计		19,063,320.99	5,881,625.78
费用			
基金管理人报酬	2006(vii)	(697,003.07)	(1,934,282.19)
基金托管费	2006(viii)	(166,161.25)	(462,352.30)
卖出回购证券支出		(9,844.00)	(4,500.00)
其他费用	17	(292,105.32)	(129,748.33)
其中:信息披露费		(202,345.52)	(67,684.38)
利息支出		(1,617.47)	(6,861,253.60)
费用合计		(1,485,133.67)	(2,390,910.89)
基金净收益		17,588,181.32	3,490,714.90
加:未实现估值增值变动数	12	2,581,469.27	1,391,676.73
基金经营活动产生		20,169,650.59	4,882,391.63
经营活动产生的现金流量净额		15,037,330.25	1,456,888.77
年初基金净收益		17,588,181.32	3,490,714.90
本年申购基金份额的损益平均		18,316,826.53	110,448.08
本年赎回基金份额的损益平均		(22,324,576.37)	(2,144,260.21)
可供分配基金净收益	18	(10,974,848.11)	1,456,888.77
年末未分配基金净收益		4,062,482.14	1,456,888.77

德盛安心成长混合型证券投资基金

资产负债表(续)

2006年度

(金额单位:人民币元)

附注	2006年	2005年	
年初基金净收益		142,972,780.17	409,056,615.48
本年经营活动		17,588,181.32	3,490,714.90
本年基金净收益		20,169,650.59	1,391,676.73
经营活动产生的现金流量净额		15,037,330.25	1,456,888.77
年初基金净收益		121,609,470.93	12,795,564.85
其中:分红再投资	18	2,171,663.64	-
基金净收益		(225,507,339.88)	(283,790,781.79)
基金净收益产生的基金净值变动数		(104,447,866.95)	(670,955,228.94)
本年基金净收益		17,588,181.32	3,490,714.90
本年申购基金份额的损益平均		18,316,826.53	110,448.08
本年赎回基金份额的损益平均		(22,324,576.37)	(2,144,260.21)
可供分配基金净收益	18	(10,974,848.11)	1,456,888.77
年末未分配基金净收益		4,062,482.14	1,456,888.77

德盛安心成长混合型证券投资基金

资产负债表(续)

2006年度

(金额单位:人民币元)

附注	2006年	2005年	
年初基金净收益		142,972,780.17	409,056,615.48
本年经营活动		17,588,181.32	3,490,714.90
本年基金净收益		20,169,650.59	1,391,676.73
经营活动产生的现金流量净额		15,037,330.25	1,456,888.77
年初基金净收益		121,609,470.93	12,795,564.85
其中:分红再投资	18	2,171,663.64	-
基金净收益		(225,507,339.88)	(283,790,781.79)
基金净收益产生的基金净值变动数		(104,447,866.95)	(670,955,228.94)
本年基金净收益		17,588,181.32	3,490,714.90
本年申购基金份额的损益平均		18,316,826.53	110,448.08
本年赎回基金份额的损益平均		(22,324,576.37)	(2,144,260.21)
可供分配基金净收益	18	(10,974,848.11)	1,456,888.77
年末未分配基金净收益		4,062,482.14	1,456,888.77

德盛安心成长混合型证券投资基金

资产负债表(续)

2006年度

(金额单位:人民币元)

附注	2006年	2005年	
年初基金净收益		142,972,780.17	409,056,615.48
本年经营活动		17,588,181.32	3,490,714.90
本年基金净收益		20,169,650.59	1,391,676.73
经营活动产生的现金流量净额		15,037,330.25	1,456,888.77
年初基金净收益		121,609,470.93	12,795,564.85
其中:分红再投资	18	2,171,663.64	-
基金净收益		(225,507,339.88)	(283,790,781.79)
基金净收益产生的基金净值变动数		(104,447,866.95)	(670,955,228.94)
本年基金净收益		17,588,181.32	3,490,714.90
本年申购基金份额的损益平均		18,316,826.53	110,448.08
本年赎回基金份额的损益平均		(22,324,576.37)	(2,144,260.21)
可供分配基金净收益	18	(10,974,848.11)	1,456,888.77
年末未分配基金净收益		4,062,482.14	1,456,888.77

德盛安心成长混合型证券投资基金

资产负债表(续)

2006年度

(金额单位:人民币元)

附注	2006年	2005年	
年初基金净收益		142,972,780.17	409,056,615.48
本年经营活动		17,588,181.32	3,490,714.90
本年基金净收益		20,169,650.59	1,391,676.73
经营活动产生的现金流量净额		15,037,330.25	1,456,888.77