国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安双佳信用分级债券(场内简称:国安双佳)	
基金主代码	162511	
基金运作方式	契约型	
基金合同生效日	2012年6月4日	
报告期末基金份额总额	1,021,430,469.44份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动地投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略,在严格控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合,以期获得最大化的债券收益;并通过适当参与二级市场权益类品种投资,力争获取超额收益。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国联安双佳A信用分级债券(场内简称:双佳A)	国联安双佳B信用分级债券(场内简称:双佳B)
下属两级基金的交易代码	162512	150080
报告期末下属两级基金的份额总额	529,455,516.57份	491,974,952.87份
下属两级基金的风险收益特征	预期低风险、预期收益相对稳定	预期较高风险、预期较高收益

注:本基金(基金合同)生效之日起3年内,本基金的基金份额划分为国联安双佳A信用分级债券(以下简称"双佳A")、国联安双佳B信用分级债券(以下简称"双佳B")两级份额,其中双佳A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次申购与赎回业务,双佳B封闭运作并上市交易;本基金《基金合同》生效后3年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	20,143,135.55
2.本期利润	-5,951,699.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0058
4.期末基金资产净值	1,065,080,522.01
5.期末基金份额净值	1.043

注:1、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,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

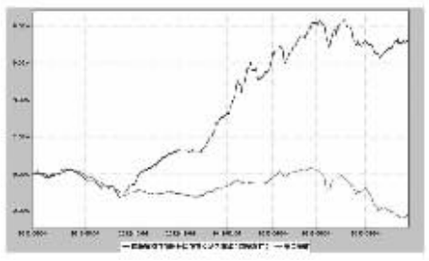
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.57%	0.13%	-1.92%	0.07%	1.35%	0.06%

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

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年6月4日至2013年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为中债综合指数;

2、本基金基金合同于2012年6月4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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2013-7-13	-	12年(自2001年起)	冯俊先生,复旦大学经济学博士,曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管,光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员,长盛基金管理有限公司基金经理助理,泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理。2008年10月起加入国联安基金管理有限公司,现任债券组合管理部总监,2009年3月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2010年6月至2013年7月兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任本基金基金经理。
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、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数证券投资基金联接基金基金经理助理	2012-6-4	2013-7-13	6年(自2007年起)	黄志钢先生,硕士,先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟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月兼任本基金基金经理,2013年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《国联安双佳信用分级债券型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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本报告期内,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未发现有超过该证券当日成交量5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年第三季度,宏观经济数据超出了市场的预期。9月中国制造业PMI指数终值在经历了连续3个月的放缓态势后,首次回到临界点之上,并创下4个月新高,中国海关9月公布出口数据的好转,得益于主要经济体经济复苏大环境下的外需增加,特别是欧美的经济回暖。美国经济数据喜忧参半,虽然就业数据不佳,但更多的数据是在支撑美国经济正在温和增长的。从欧元区的情况来看,欧元区8月制造业采购经理人指数也达到2011年6月以来最高水平。

经济基本面的边际改善和流动性高度紧张,这使得债券市场出现了相当幅度的调整。和基本面更加相关利率品种收益率上行更加明显。整体市场持续平坦化的趋势,短端信用品种收益率上行出现一定倒挂。基于如此的债市环境判断下,本基金在三季度初,降低利率债券仓位应对预期的资金压力,并从8月份开始适当加大了对转债的波段操作,逐渐增加大盘转债以及防御性强的转债配置,并在9月底降低转债仓位,兑现收益。

展望四季度,CPI数据大幅上行的空间不大,但资金面仍有可能出现短期紧张局面,加上IPO重启,企业信用风险恶化的事件的影响,将影响到债券市场不同品种的息差水平,因此债券市场波动幅度或将加大。不过,由于持续一个季度的资金紧张,债券收益率已经到了历史较高水平,本基金认为信用债券在2013年第四季度存在一定的配置价值,我们将寻找机会适当加长久期和杠杆操作,加强转债波段操作,对此我们将力争做好信用债券基本面的研究和筛选工作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-0.57%,同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,745,353,103.07	91.45
	其中:债券	1,745,353,103.07	91.45
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	29,936,349.58	1.57
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	29,936,349.58	1.57
6	银行存款和结算备付金合计	69,854,187.52	3.66
7	其他资产	63,474,438.24	3.33
8	合计	1,908,618,078.41	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,512,282,794.07	141.99
5	企业短期融资券	109,897,000.00	10.32
6	中期票据	70,050,000.00	6.58
7	可转债	53,123,309.00	4.99
8	其他	-	-
9	合计	1,745,353,103.07	163.87

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122581	12淮海城	1,000,000	100,780,000.00	9.46
2	122641	12武进债	899,660	89,966,000.00	8.45
3	1080011	10萍乡城投债	800,000	81,128,000.00	7.62
4	122630	12惠投债	700,000	71,400,000.00	6.70
5	122669	12桂林债	700,000	71,393,000.00	6.70

5.6报告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。

5.7 报告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。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	182,740.88
2	应收证券清算款	21,955,541.61
3	应收股利	-
4	应收利息	41,336,155.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,474,438.24

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	20,006,000.00	1.88
2	110023	民生转债	13,480,194.00	1.27
3	110015	石化转债	10,327,395.00	0.97
4	113002	工行转债	9,309,720.00	0.87

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金份额变动

单位:份

	国联安双佳A信用分级债券(场内简称:双佳A)	国联安双佳B信用分级债券(场内简称:双佳B)
报告期期初基金份额总额	529,455,516.57	491,974,952.87
报告期期间总申购份额	-	-
减:报告期期间总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	529,455,516.57	491,974,952.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安双佳信用分级债券型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同》

3、《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

8.2 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

8.3 查阅方式

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

国联安基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

国联安主题驱动股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

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2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安主题驱动股票	
基金主代码	257050	
交易代码	257050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年8月26日	
报告期末基金份额总额	115,312,011.51份	
投资目标	把握中国经济结构转型带来的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。	
投资策略	1. 资产配置策略 根据宏观经济发展趋势、金融市场的利率变动和市场情绪,综合运用定性和定量的方法,对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估,确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下,形成大类资产的配置方案。 若出现重大突发事件、投资者情绪急剧变化、海外市场异常变动等因素导致投资决议形成的市场环境发生改变,基金经理可以提出大类资产配置的调整建议,投资决策委员会召开会议,讨论基金经理的建议并确定大类资产的调整比例,由基金经理执行。 2.股票投资策略 本基金股票投资运用主题驱动投资策略,通过"自上而下"的分析方法,前瞻性地挖掘中国经济结构转型过程中涌现的投资主题,结合价值投资理念,精选投资主题下的个股,获取超额收益率。 投资主题是影响经济发展或企业盈利前景的趋势性因素,投资主题是动态的,一般分为四个阶段:主题萌芽阶段、主题形成阶段、主题繁荣阶段、主题衰退阶段。 在主题的萌芽阶段,对主题的关注度较低,市场反映往往不足;主题繁荣阶段,主题引起广泛关注,市场反映往往过度,这种反应不足和反应过度就带来股票定价的偏差,即主题萌芽阶段,股票往往被低估,而到主题繁荣阶段,股票往往被高估。通过对主题进程的把握,利用这种定价偏差,精选主题下的相关个股,在主题萌芽阶段买入,在主题繁荣阶段卖出,形成完整的主题驱动投资策略。 3.债券投资策略 在债券投资方面,本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债等债券品种。本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。主要的债券投资策略有: (1)久期控制策略 (2)类属策略 (3)收益率曲线配置策略 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证的投资。 (1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素,根据BS模型和溢价率对权证的合理价值做出判断,对价值被低估的权证进行投资; (2)基于对权证标的股票未来走势的预期,充分利用权证的杆杆比率高的特点,对权证进行单边投资; (3)基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断,将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资,或利用权证进行风险对冲。	
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%	
风险收益特征	本基金是股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险品种,其预期收益水平和风险高于混合型基金和债券型基金。	
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	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,002,194.44
2.本期利润	15,935,668.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1277
4.期末基金资产净值	128,439,128.21
5.期末基金份额净值	1.114

注:1、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,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

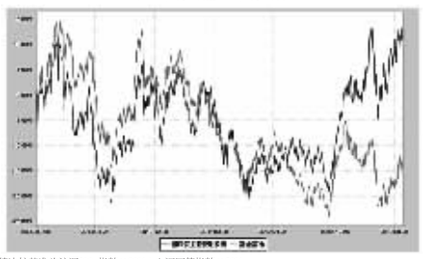
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.64%	1.37%	7.70%	1.15%	4.94%	0.22%

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

国联安主题驱动股票型证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年8月26日至2013年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为沪深300 指数×80%+上证国债指数×20%;

2、本基金基金合同于2009 年8 月26 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6 个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韦明兆	本基金基金经理、兼任国联安德盛优势股票证券投资基金基金经理、投资组合管理部总监	2010-12-10	-	12年(自2001年起)	韦明兆先生,经济学硕士,曾任上海升华投资有限公司研究员,上海国禾投资有限公司研究员,光大证券研究所研究员,2006年3月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级分析师。2006年11月加入光大证券股份有限公司,先后担任证券投资顾问投资经理、证券投资部执行董事。2010年5月起加入国联安基金管理有限公司,先后担任研究副总监、投资组合管理部总监,2010年12月起担任本基金基金经理,2011年4月起兼任国联安德盛优势股票证券投资基金基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《国联安主题驱动股票型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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本报告期内,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未发现有超过该证券当日成交量5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年第三季度,宏观经济和企业盈利扭转了下跌趋势,出现反弹。不过,市场参与者仍普遍对经济的中长期走势持有悲观态度。在流动性方面,经历了6月底的钱荒后,市场利率大致保持在相对较高的水平,虽然在季度末出现上升,但总体可控。随着三中全会召开日期的临近,市场对改革的预期进一步升温。在上述因素的影响下,市场维持了上涨的态势。从板块看,传媒等成长股继续获得大幅超额收益,而传统蓝筹板块表现依然不尽如人意。另外,以自贸板块为代表的改革主体板块和涉网板块等主体板块表现较为强劲。

报告期内,本基金总体仓位大部分时间保持在中性偏高水平。在保持大致均衡的资产配置的同时,仍然偏重于中等增长并且估值偏低的板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为12.64%,同期业绩比较基准收益率为7.70%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	110,828,072.30	85.68
	其中:股票	110,828,072.30	85.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,385,031.90	14.21
7	其他资产	133,644.97	0.10
8	合计	129,346,749.17	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,074,990.00	0.84
B	采矿业	4,070,000.00	3.17
C	制造业	72,869,697.43	56.73
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	-	-
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	7,110,397.05	5.54
J	金融业	3,985,000.00	3.10
K	房地产业	20,305,820.32	15.81
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,412,167.50	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	110,828,072.30	86.29

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	431,550	12,247,389.00	9.54
2	000002	万 科A	869,972	7,942,844.36	6.18
3	600587	新华医疗	129,389	7,838,385.62	6.10
4	600048	保利地产	726,617	7,178,975.96	5.59
5	600406	国电南瑞	492,069	7,110,397.05	5.54
6	601633	长城汽车	135,000	6,895,800.00	5.37
7	600872	中炬高新	661,204	6,625,264.08	5.16
8	000063	中兴通讯	350,000	5,810,000.00	4.52
9	000625	长安汽车	505,000	5,201,500.00	4.05
10	000024	招商地产	216,000	5,184,000.00	4.04

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	86,769.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,813.09
5	应收申购款	44,062.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	133,644.97

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	130,260,732.38
报告期期间基金总申购份额	3,985,254.63
减:报告期期间基金总赎回份额	18,933,975.50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	115,312,011.51

注: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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安主题驱动股票型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安主题驱动股票型证券投资基金基金合同》

3、《国联安主题驱动股票型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安主题驱动股票型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

8.2 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

8.3 查阅方式

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

国联安基金管理有限公司
二〇一三年十月二十三日

国联安双禧中证100指数分级证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

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2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安双禧中证100指数分级(场内简称:双禧100)
基金主代码	162509
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月16日
报告期末基金份额总额	2,779,165,569.12份
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不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%以实现对中证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%×中证100指数收益率+5%×活期存款利率(税后)
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
下属三级基金的基金简称	国联安双禧A中证100指数(场内简称:双禧A) / 国联安双禧B中证100指数(场内简称:双禧B) / 国联安双禧中证100指数(场内简称:双禧100)
下属三级基金的交易代码	150012 / 150013 / 162509
报告期末下属三级基金的份额总额	986,675,660.00份 / 1,480,013,490.00份 / 312,476,419.12份
下属三级基金的风险收益特征	双禧A:低风险低收益。 / 双禧B:高风险高收益。 / 双禧100: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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-155,473,558.25
2.本期利润	128,821,344.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0507
4.期末基金资产净值	2,647,015,142.86
5.期末基金份额净值	0.952

注:1、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,包含停牌股票按公允价值调整的影响;