

国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）
（原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金）

2015 年第 2 季度报告

2015 年 6 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：二〇一五年七月二十一日

§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 2015 年 7 月 17 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。

自 2015 年 6 月 4 日国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳 A 和双佳 B 份额终止上市起，原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金名称变更为国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）。原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金报告期自 2015 年 4 月 1 日至 2015 年 6 月 4 日止，国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）报告期自 2015 年 6 月 5 日至 2015 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）

基金简称	国联安双佳信用债券
场内简称	国安双佳
基金主代码	162511
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015 年 6 月 5 日
报告期末基金份额总额	195,737,864.75 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

2.2 原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

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，本基金基金合同生效后，封闭期为三年（含三年），封闭期届满后转为上市开放式基金（LOF）。
基金合同生效日	2012 年 6 月 4 日
报告期末基金份额总额	506,885,893.79 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	国联安双佳 B 信用分级债券
下属分级基金场内简称	双佳 A	双佳 B
下属分级基金的交易代码	162512	150080
报告期末下属分级基金的份额总额	14,910,940.92 份	491,974,952.87 份
下属分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

项目	2015年2季度报告	
	国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）（2015年6月5日-2015年6月30日）	原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金（2015年4月1日-2015年6月30日）

		月4日)
1.本期已实现收益	3,037,124.50	24,069,700.93
2.本期利润	-90,034.72	19,935,866.62
3.加权平均基金份 额本期利润	-0.0002	0.0382
4.期末基金资产净 值	195,298,426.04	621,251,634.37
5.期末基金份额净 值	0.998	1.226

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、根据基金合同，本基金转换日为 2015 年 6 月 4 日，在转换日日终，国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳 A 份额（基金份额简称：双佳 A，基金代码：162512）、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳 B 份额（基金份额简称：双佳 B，场内简称：双佳 B，基金代码：150080）的基金份额将以各自的基金份额为基准转换为国联安双佳信用债券型证券投资基金 (LOF) 的基金份额。，双佳 A 转换比例为 1：1.019107480，双佳 B 转换比例为 1：1.231883410。

4、国联安双佳信用债券型证券投资基金 (LOF) 于 2015 年 6 月 12 日开放日常赎回、转换转出业务。

3.2 基金净值表现

3.2.1 国联安双佳信用债券型证券投资基金 (LOF)

3.2.1.1 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
自本基金份额转换日次日起至本报告期末（2015年6月5日至2015年6月30日）	-0.20%	0.17%	-0.17%	0.04%	-0.03%	0.13%

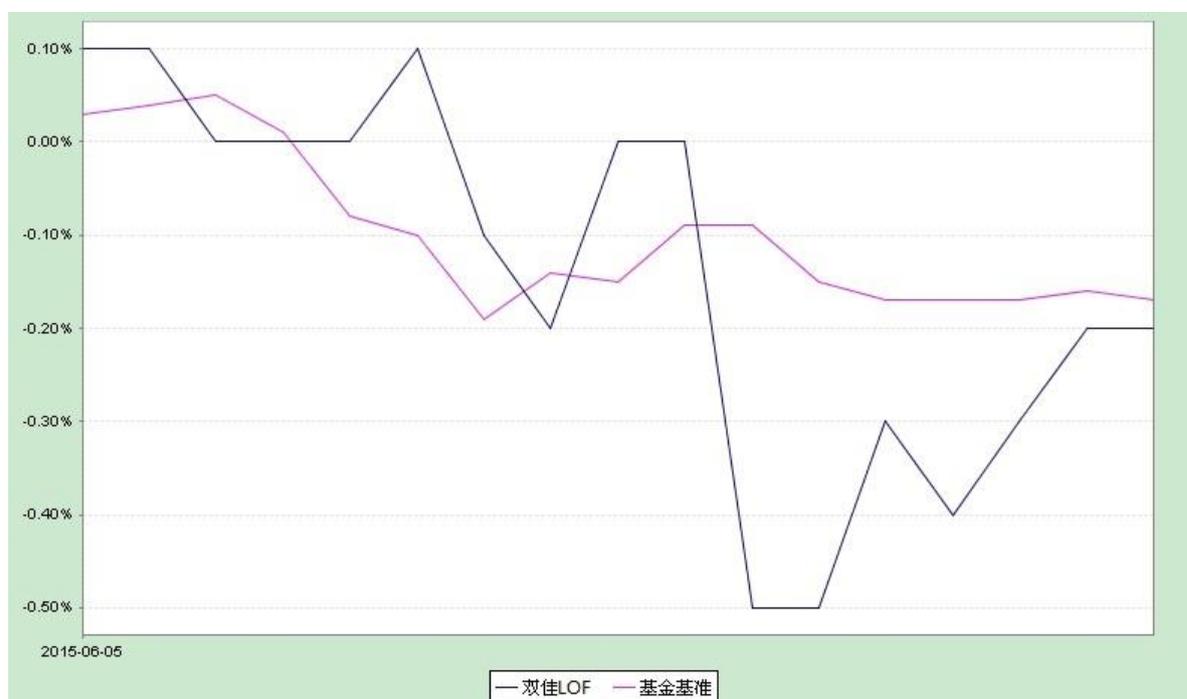
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1.2 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

国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）

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

（2015年6月5日至2015年6月30日）



注：1、本基金份额转换日为 2015 年 6 月 4 日，在转换日日终，双佳 A 和双佳 B 以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）的份额；

- 2、本基金业绩比较基准为中债综合指数；
- 3、原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的基金合同于 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、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 原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

3.2.2.1 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
自本报告期期初起至本基金份额转换日（2015 年 4 月 1 日至 2015 年 6 月 4 日）	3.81%	0.11%	1.52%	0.11%	2.29%	0.00%

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。

3.2.2.2 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

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 6 月 4 日至 2015 年 6 月 4 日）



- 注：1、本基金份额转换日为 2015 年 6 月 4 日，在转换日日终，双佳 A 和双佳 B 以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）的份额；
- 2、本基金业绩比较基准为中债综合指数；
- 3、原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的基金合同于 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、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。

§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	2013-7-13	-	14 年 （自 2001 年	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、

	<p>安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵</p>			<p>起)</p>	<p>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 月至 2015 年 3 月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 月至 2015 年 6 月任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月起兼任国联安信心增长债券型证券投资基金</p>
--	--	--	--	-----------	---

	活配置混合型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监				的基金经理。2014 年 6 月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起兼任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月起兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起兼任国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理。
吕中凡	本基金基金经理、兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-05-20		4 年（自 2011 年起）	吕中凡，硕士研究生。2005 年 7 月至 2008 年 7 月在华虹宏力半导体制造有限公司（原宏力半导体制造有限公司）担任企业内部管理咨询管理师一职。2009 年 3 月至 2011 年 3 月

	理			<p>在上海远东资信评估有限公司（原上海远东鼎信财务咨询有限公司）担任信用评估项目经理。2011 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，历任信用研究信用分析员、债券组合助理、基金经理助理等职位。2015 年 5 月起任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理。</p>
--	---	--	--	--

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合规守信情况说明

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，及时执行交易系统内的公平交易模块；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

回顾 2015 年第二季度，经济下行压力大于预期，经济回升的内生动力弱于预期。政策放松趋势没有改变。当前经济仅仅是短期企稳，经济自主增长动能暂难以逆转。不仅实际利率高，社会融资总量增速也持续放缓，这些都对总需求有滞后影响，经济经过短期企稳后，可能在 2016 年继续下行。通缩环境没有改变，二季度 GDP 缩减指数为负，未来几个季度 GDP 缩减指数依然将为负。

在此背景下，我们预计下半年信用债供给逐渐回升，货币政策将以定向宽松为主，且随着股市震荡不断加剧，配资、打新等资金短期内会选择观望或进入债市避险，预计股市对债市的分流高峰已经过去，下半年资产配置的天平有望逐渐向债市倾斜。随着货币政策间歇性的放松，下半年债券市场交易性机会较多。

因为本基金之前封闭期结束后打开赎回，规模出现了一定下降。但通过债券市场的操作，本基金还是保持了一个相对中性的债券杠杆。下半年争取利用货币政策间歇性的放松的机会，获得债券市场配置和交易性机会，为投资者获取较为稳定的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

自本基金份额转换日次日（2015年6月5日）起至本报告期末，本基金份额净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为-0.17%。

自本报告期初起至本基金份额转换日（2015年6月4日），原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的份额净值增长率为3.81%，同期业绩比较基准收益率为1.52%。

§5 投资组合报告

5.1 国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）

(报告日期:2015年6月5日-2015年6月30日)

5.1.1 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	固定收益投资	220,391,280.40	88.14
	其中：债券	220,391,280.40	88.14
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,481,686.28	7.79

7	其他资产	10,170,716.29	4.07
8	合计	250,043,682.97	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。

5.1.2 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。

5.1.3 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。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	220,391,280.40	112.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债		
8	其他	-	-
9	合计	220,391,280.40	112.85

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资
----	------	------	-------	---------	------

					产净值比例（%）
1	1280342	12 兴安林业债	400,000.00	40,224,000.00	20.60
2	112110	12 东锆债	379,900.00	33,271,642.00	17.04
3	1280261	12 咸宁城投债	200,000.00	20,706,000.00	10.60
4	124370	13 虞新区	199,010.00	20,671,168.70	10.58
5	122600	12 鑫泰债	200,000.00	20,596,000.00	10.55

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除12东锆债和12国创债外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12东锆债（112110）的发行主体广东东方锆业科技股份有限公司于2015年3月20日发布公告称，于2015年3月19日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌违反证券法律法规予以立案调查的《调查通知书》。

12国创债（112096）的发行主体湖北国创高新材料股份有限公司于2015年1月9日发布公告称，其全资子公司四川国创兴路沥青材料有限公司收到成都市环境保护局关于违反《中华人民共和国环境影响评价法》予以责令停产并处罚款的《环境行政处罚决定书》。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.1.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,831.01
2	应收证券清算款	1,227,967.53

3	应收股利	-
4	应收利息	8,885,917.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,170,716.29

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 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。

5.2 原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金 (报告日期:2015 年 4 月 1 日-2015 年 6 月 4 日)

5.2.1 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	固定收益投资	587,053,873.70	84.10
	其中：债券	587,053,873.70	84.10
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入 返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金 合计	94,471,204.02	13.53
7	其他资产	16,494,782.29	2.36
8	合计	698,019,860.01	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。

5.2.2 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。

5.2.3 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。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,185,400.00	0.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,560,000.00	12.97
	其中：政策性金融债	80,560,000.00	12.97
4	企业债券	422,612,473.70	68.03
5	企业短期融资券	80,696,000.00	12.99
6	中期票据	-	-
7	可转债		
8	其他	-	-
9	合计	587,053,873.70	94.50

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	01157001	15 中电 SCP001	800,000.00	80,696,000.00	12.99
2	150202	15 国开 02	800,000.00	80,560,000.00	12.97
3	1180118	11 潍坊滨投债	600,000.00	63,216,000.00	10.18
4	1280342	12 兴安林业债	400,000.00	40,228,000.00	6.48
5	1080154	10 安顺国资债 01	350,000.00	36,081,500.00	5.81

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除12东锆债外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12东锆债（112110）的发行主体广东东方锆业科技股份有限公司于2015年3月20日发布公告称，于2015年3月19日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌违反证券法律法规予以立案调查的《调查通知书》。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.2.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,831.01
2	应收证券清算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	16,437,951.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	16,494,782.29
---	----	---------------

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 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

6.1 国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）

单位：份

基金转型起始日（2015 年6 月4 日）基金份 额总额	621,251,633.71
转型后期间基金总申购份额	
减：转型后期间基金总赎回份额	425,513,768.96
转型后期间基金拆分变动份额	-
转型后期末基金份额总额	195,737,864.75

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）	
报告期期初管理人持有的本基 金份额	36,961,492.00
报告期期间买入/申购总份额	-
	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
	-

报告期期末管理人持有的本基金份额	36,961,492.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	18.88%

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

7.2 原国联安双佳分级债券型证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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）
报告期期初管理人持有的本基金份额		30,004,050.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	30,004,050.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	6.10%

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同约定，本基金于 2015 年 6 月 4 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，双佳 A、双佳 B 的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金份额。自 2015 年 6 月 5 日起，本基金名称变更为“国联安双佳信用债券型券投资基金(LOF)”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)发行及募集的文件
- 2、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)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

9.2 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

9.3 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
二〇一五年七月二十一日