

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 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：二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

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 2016 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|
| 基金简称 | 国联安双禧中证 100 指数分级 | | |
| 场内简称 | 双禧 100 | | |
| 基金主代码 | 162509 | | |
| 交易代码 | 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 | | |
| 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 | 267,796,970.61 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 | 2010 年 6 月 18 日 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国联安双禧 A 中 证 100 指数 | 国联安双禧 B 中 证 100 指数 | 国联安双禧中证 100 指数 |
| 下属分级基金的场内简称 | 中证 100A | 中证 100B | 双禧 100 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150012 | 150013 | 162509 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 94,949,116.00 份 | 142,423,674.00 份 | 30,424,180.61 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 | <p>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% 以实现中证 100 指数的有效跟踪。</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 95%×中证 100 指数收益率+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。 |

| | | | |
|---------------|-----------------|-----------------|--|
| 下属分级基金的风险收益特征 | 中证 100A：低风险低收益。 | 中证 100B：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。 |
|---------------|-----------------|-----------------|--|

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 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址 | http://www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015 年 | 2014 年 | 2013 年 |
|---------------|------------------|------------------|-----------------|
| 本期已实现收益 | 1,095,641,380.95 | 112,231,826.84 | -191,199,937.58 |
| 本期利润 | 155,049,454.69 | 1,274,785,265.25 | -400,277,323.53 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1853 | 0.5417 | -0.1451 |
| 本期基金份额净值增长 | -2.72% | 57.28% | -13.52% |

| 率 | | | |
|---------------|----------------|------------------|------------------|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 | 2014 年末 | 2013 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2822 | -0.2630 | -0.3050 |
| 期末基金资产净值 | 374,083,505.44 | 3,326,718,574.17 | 2,196,746,949.15 |
| 期末基金份额净值 | 1.397 | 1.436 | 0.913 |

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

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

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

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 | 14.32% | 1.53% | 13.56% | 1.51% | 0.76% | 0.02% |
| 过去六个月 | -16.05% | 2.55% | -15.14% | 2.46% | -0.91% | 0.09% |
| 过去一年 | -2.72% | 2.41% | -1.07% | 2.34% | -1.65% | 0.07% |
| 过去三年 | 32.33% | 1.77% | 35.34% | 1.73% | -3.01% | 0.04% |
| 过去五年 | 16.90% | 1.56% | 19.67% | 1.53% | -2.77% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.31% | 1.53% | 5.85% | 1.54% | 19.46% | -0.01% |

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2010 年 4 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：1、本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ ；

2、本基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，2010 年 10 月 15 日建仓期结束当日除股票投资比例略低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定；

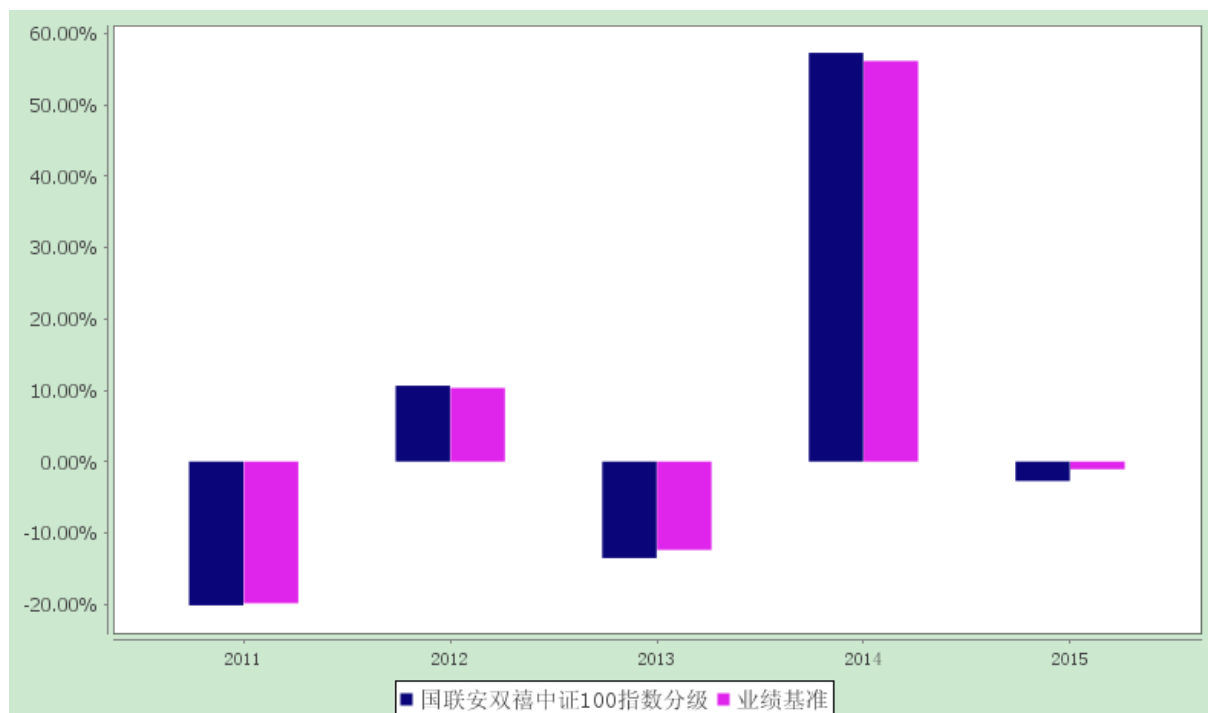
3、本基金于 2010 年 6 月 18 日已基本建仓完毕，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值 90%，其他各项资产配置比例自该日起均符合基金合同的约定。由于 2010 年 10 月 15 日有连续大额申购从而导致股票投资比例当日被动未达标，本基金已于 2010 年 10 月 20 日及时调整完毕；

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

3.2.3 过去五年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

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据法律法规的规定及《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金（包括双禧 100 份额、中证 100A 份额、中证 100B 份额）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，公司共管理二十七只开放式基金。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 | | |
| 黄欣 | 本基金基金经理、兼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、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、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理 | 2010-04-16 | - | 13 年 (自 2002 年起) | 黄欣先生, 伦敦经济学院会计金融专业硕士。2003 年 10 月起加入国联安基金管理有限公司, 先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 4 月起担任国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金经理, 2010 年 5 月起至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理, 2010 年 11 月起兼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, 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, 2013 年 6 月起兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理。 |
| 冒浩 | 本基金基金经理助理 | 2013-07-19 | - | 5 年 (自 2010 年起) | - |

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》、《国联安双禧中证 100 指数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。本基金管理人对不同投资合同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）的不同投资合同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合同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

2015 年大盘先扬后抑，在经历 5 个月的飞速上涨之后，6 月起遭遇了大幅下跌，在政府大力的救市政策支持下，4 季度迎来了一波反弹，全年中证 100 指数下跌约 1.5%，分板块来看，医药、交通运输等板块表现较好，证券、保险等板块表现较差。双禧基金采用完全复制的方式跟踪中证 100 指数，跟踪误差情况良好。

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 1.397 元，本报告期份额净值增长率为-2.72%，同期业绩比较基准收益率为-1.07%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.13%，年化跟踪误差为 3.16%，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

2015 年宏观经济数据并没有明显改善的情况下股市经历了大起大落，在宽松的流动性环境支持下，一些题材股、概念股的市盈率处在历史的高位，积聚了一定的风险。2016 年，预期市场上的流动性不再宽松，人民币存在持续贬值的预期，我们期待政府能够继续推动经济转型、改善经济结构、刺激经济发展，以估值相对合理的大盘蓝筹为主要标的的双禧中证 100 指数基金可能会是 2016 年稳健的投资选择。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本基金（包括双禧 100 份额、中证 100A 份额、中证 100B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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投资运作遵规守信、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

本报告期的基金财务会计报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师黄小熠、张楠签字出具了毕马威华振审字第 1600380 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 22,148,366.44 | 179,116,161.75 |
| 结算备付金 | 59,859.41 | 889,051.44 |
| 存出保证金 | 369,252.72 | 256,124.15 |
| 交易性金融资产 | 353,005,812.18 | 3,160,959,790.43 |
| 其中：股票投资 | 353,005,812.18 | 3,159,888,009.00 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | 1,071,781.43 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 56,816,009.62 |
| 应收利息 | 5,945.33 | 40,318.67 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 99.88 | 290,184.96 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 375,589,335.96 | 3,398,367,641.02 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
| 负债： | - | - |

| | | |
|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 145.40 | - |
| 应付赎回款 | 472,509.56 | 65,513,808.52 |
| 应付管理人报酬 | 331,490.38 | 2,814,650.73 |
| 应付托管费 | 72,927.90 | 619,223.15 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 141,819.13 | 1,930,695.95 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 486,938.15 | 770,688.50 |
| 负债合计 | 1,505,830.52 | 71,649,066.85 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 298,500,588.89 | 2,582,899,427.11 |
| 未分配利润 | 75,582,916.55 | 743,819,147.06 |
| 所有者权益合计 | 374,083,505.44 | 3,326,718,574.17 |
| 负债和所有者权益总计 | 375,589,335.96 | 3,398,367,641.02 |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.397 元，基金份额总额 267,796,970.61 份。其中国联安双禧 A 中证 100 指数份额 94,949,116.00 份；国联安双禧 B 中证 100 指数份额 142,423,674.00 份；国联安双禧中证 100 指数份额 30,424,180.61 份。

7.2 利润表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | 180,151,637.95 | 1,308,523,055.42 |
| 1.利息收入 | 617,015.23 | 1,095,183.68 |
| 其中：存款利息收入 | 616,586.42 | 1,057,211.26 |
| 债券利息收入 | 428.81 | 180.34 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 37,792.08 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 1,115,630,213.91 | 143,092,243.53 |
| 其中：股票投资收益 | 1,094,524,537.93 | 84,539,875.79 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 1,071,400.95 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 20,034,275.03 | 58,552,367.74 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -940,591,926.26 | 1,162,553,438.41 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 4,496,335.07 | 1,782,189.80 |
| 减：二、费用 | 25,102,183.26 | 33,737,790.17 |
| 1. 管理人报酬 | 12,781,711.17 | 21,814,749.08 |
| 2. 托管费 | 2,811,976.43 | 4,799,244.78 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 8,696,735.23 | 6,122,742.83 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 811,760.43 | 1,001,053.48 |

| | | |
|---------------------|----------------|------------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 155,049,454.69 | 1,274,785,265.25 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 155,049,454.69 | 1,274,785,265.25 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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) | 2,582,899,427.11 | 743,819,147.06 | 3,326,718,574.17 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 155,049,454.69 | 155,049,454.69 |
| 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) | -2,284,398,838.22 | -823,285,685.20 | -3,107,684,523.42 |
| 其中：1.基金申购款 | 341,824,916.33 | 173,805,393.69 | 515,630,310.02 |
| 2.基金赎回款 | -2,626,223,754.55 | -997,091,078.89 | -3,623,314,833.44 |
| 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) | 298,500,588.89 | 75,582,916.55 | 374,083,505.44 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |

| | 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) | 2,681,705,000.25 | -484,958,051.10 | 2,196,746,949.15 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,274,785,265.25 | 1,274,785,265.25 |
| 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) | -98,805,573.14 | -46,008,067.09 | -144,813,640.23 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,391,836,782.00 | -93,384,265.68 | 1,298,452,516.32 |
| 2.基金赎回款 | -1,490,642,355.14 | 47,376,198.59 | -1,443,266,156.55 |
| 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) | 2,582,899,427.11 | 743,819,147.06 | 3,326,718,574.17 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 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: 谭晓雨, 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

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金(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”)《关于核准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]228 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《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2010 年

4 月 16 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 982,138,906.44 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、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》和《国联安双禧中证 100 指数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具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股、备选成份股、新股、现金和到期日在一年以内的政府债券等。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，履行适当程序后可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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 2015 年 12 月 31 日的财务状况、2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据估值处理标准，本基金自 2015 年 3 月 26 日起，对本基金所持有的在上海证券交易所、深

圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调 整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于 2015 年 3 月 26 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

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[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (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 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 |

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 399,141,750.52 | 8.41% | 1,836,838,110.80 | 46.54% |

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 1,074,830.10 | 30.06% | - | - |

注：本基金上年度与关联方无债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------|----------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国泰君安 | - | - | 70,000,000.00 | 100.00% |

注：本基金本年度与关联方无债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|------------|--------------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰君安 | 356,035.38 | 8.26% | 0.00 | 0.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰君安 | 1,671,203.66 | 46.80% | 1,022,675.30 | 52.97% |

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券及回购交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年 12月31日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,781,711.17 | 21,814,749.08 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 822,845.03 | 1,396,973.00 |

注：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：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年 12月31日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,811,976.43 | 4,799,244.78 |

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间内，基金管理人未投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国联安双禧 A 中证 100 指数（场内简称：中证 100A）

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2014 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 | - | - | 11,983,335.00 | 1.67% |

注：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。

国联安双禧 B 中证 100 指数（场内简称：中证 100B）

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2014 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 | - | - | 17,974,563.00 | 1.67% |

注：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。

国联安双禧中证 100 指数（场内简称：双禧 100）

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2014 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 | - | - | 2.00 | 0.00% |

注：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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014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 | 22,148,366.44 | 576,959.85 | 179,116,161.75 | 1,025,036.83 |
|------|---------------|------------|----------------|--------------|

注：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。

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 2015 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 59,859.41 元。(2014 年：人民币 889,051.44 元)

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末（2015 年 12 月 31 日）未持有因认购新发或增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|-------|--------------|--------------|---------------|----|
| 601018 | 宁波港 | 2015-08-04 | 重大事项 | 8.16 | 2016-02-22 | 7.34 | 337,698.00 | 2,504,704.62 | 2,755,615.68 | - |
| 600690 | 青岛海尔 | 2015-10-19 | 重大事项 | 9.92 | 2016-02-01 | 8.93 | 202,504.00 | 2,018,860.36 | 2,008,839.68 | - |
| 000002 | 万科 A | 2015-12-21 | 重大事项 | 24.43 | - | - | 476,068.00 | 5,432,130.57 | 11,630,341.24 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 353,005,812.18 | 93.99 |
| | 其中：股票 | 353,005,812.18 | 93.99 |
| 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 | - | - |
| 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 | 22,208,225.85 | 5.91 |
| 7 | 其他各项资产 | 375,297.93 | 0.10 |
| 8 | 合计 | 375,589,335.96 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 10,960,269.30 | 2.93 |
| C | 制造业 | 91,390,881.67 | 24.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,909,600.78 | 3.72 |
| E | 建筑业 | 16,859,753.78 | 4.51 |
| F | 批发和零售业 | 3,517,444.00 | 0.94 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,841,103.14 | 2.63 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,584,751.84 | 3.10 |
| J | 金融业 | 174,533,430.23 | 46.66 |
| K | 房地产业 | 17,603,755.64 | 4.71 |
| 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 | 1,910,136.80 | 0.51 |
| 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 | 876,000.00 | 0.23 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 352,987,127.18 | 94.36 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|-----------|------|
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 18,685.00 | 0.00 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 18,685.00 | 0.00 |

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 639,458 | 23,020,488.00 | 6.15 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2 | 600016 | 民生银行 | 1,744,399 | 16,816,006.36 | 4.50 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 787,218 | 13,437,811.26 | 3.59 |
| 4 | 000002 | 万科A | 476,068 | 11,630,341.24 | 3.11 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 608,804 | 10,952,383.96 | 2.93 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 550,583 | 10,059,151.41 | 2.69 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 618,995 | 9,792,500.90 | 2.62 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 464,644 | 8,990,861.40 | 2.40 |
| 9 | 601328 | 交通银行 | 1,390,097 | 8,952,224.68 | 2.39 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 2,256,425 | 7,288,252.75 | 1.95 |

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

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

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 | 002781 | 奇信股份 | 500.00 | 18,685.00 | 0.00 |

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 | 601988 | 中国银行 | 35,549,496.95 | 1.07 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 30,997,615.71 | 0.93 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 26,299,857.58 | 0.79 |
| 4 | 601390 | 中国中铁 | 23,478,491.80 | 0.71 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 22,109,883.25 | 0.66 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 20,775,607.00 | 0.62 |
| 7 | 601601 | 中国太保 | 20,378,342.91 | 0.61 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 19,725,914.20 | 0.59 |
| 9 | 601688 | 华泰证券 | 19,495,922.49 | 0.59 |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 18,490,747.80 | 0.56 |
| 11 | 601166 | 兴业银行 | 18,305,381.99 | 0.55 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 18,240,163.14 | 0.55 |
| 13 | 000002 | 万科A | 18,186,839.57 | 0.55 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 601669 | 中国电建 | 18,091,625.62 | 0.54 |
| 15 | 601857 | 中国石油 | 18,091,337.00 | 0.54 |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 16,656,017.52 | 0.50 |
| 17 | 600028 | 中国石化 | 15,977,999.00 | 0.48 |
| 18 | 601600 | 中国铝业 | 15,560,713.16 | 0.47 |
| 19 | 600050 | 中国联通 | 15,210,182.97 | 0.46 |
| 20 | 600705 | 中航资本 | 14,519,436.12 | 0.44 |

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 | 601318 | 中国平安 | 206,186,487.78 | 6.20 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 155,576,613.73 | 4.68 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 155,205,250.92 | 4.67 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 133,911,428.79 | 4.03 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 109,993,142.23 | 3.31 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 109,616,393.41 | 3.30 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 101,797,957.34 | 3.06 |
| 8 | 601988 | 中国银行 | 86,835,636.84 | 2.61 |
| 9 | 000002 | 万科 A | 85,293,847.62 | 2.56 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 75,747,390.36 | 2.28 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 73,228,720.41 | 2.20 |
| 12 | 601601 | 中国太保 | 69,242,993.29 | 2.08 |
| 13 | 601818 | 光大银行 | 68,363,917.46 | 2.05 |
| 14 | 601390 | 中国中铁 | 66,461,528.41 | 2.00 |
| 15 | 601688 | 华泰证券 | 61,353,277.31 | 1.84 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 59,890,150.51 | 1.80 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 58,639,712.16 | 1.76 |
| 18 | 601288 | 农业银行 | 58,449,095.35 | 1.76 |
| 19 | 601766 | 中国中车 | 56,665,241.08 | 1.70 |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 55,023,890.43 | 1.65 |

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 | 892,960,716.88 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 3,926,738,688.29 |

注：不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.7 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。

8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金包报告期末未持有股指期货。

8.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金包报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

8.9.2 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。

8.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除中国平安、民生银行、海通证券和中信证券外，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。

中国平安（601318）的控股子公司中国平安财产保险股份有限公司（以下简称“平安产险”）的北京分公司于 2015 年 1 月 12 日收到中国保监会的《行政处罚决定书》，平安产险北京分公司违反了《健康保险管理办法》，被处以警告并罚款。

中国平安（601318）的控股子公司平安资产管理有限责任公司（以下简称“平安资产”）于 2015 年 2 月 2 日收到中国保监会的《行政处罚决定书》，平安资产未谨慎处理投资计划事务的行为，构成

违规运用保险资金的违法行为，被处以罚款。

民生银行（600016）的支行中国民生银行股份有限公司北京阜成门支行于 2015 年 11 月 20 日收到中国保监会的《行政处罚决定书》，其工作人员与民生人寿北京分公司银保专管员在产品销售过程中，存在将购买保险产品与办理银行贷款进行捆绑、承诺贷款终止后可全额退还保费、承诺缴费后可按比例返还保费等行为，被处以吊销保险兼业代理业务许可证的处罚。

海通证券（600837）的发行主体海通证券股份有限公司于 2015 年 1 月 20 日发布公告称，因存在违规为到期融资融券合约展期的问题受到中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

海通证券（600837）的发行主体海通证券股份有限公司于 2015 年 8 月 26 日发布公告称，其于 2015 年 8 月 24 日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为予以立案调查的《调查通知书》

海通证券（600837）的发行主体海通证券股份有限公司于 2015 年 9 月 12 日发布公告称，其于 2015 年 9 月 10 日收到中国证券监督管理委员会的《行政处罚事先告知书》，海通证券未按规定审查、了解客户的身份信息，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，性质恶劣、情节严重，对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

海通证券（600837）的发行主体海通证券股份有限公司于 2015 年 11 月 28 日发布公告称，其于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定予以立案调查的《调查通知书》。

中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司于 2015 年 1 月 19 日发布公告称，因存在为到期融资融券合约展期的问题被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司于 2015 年 8 月 31 日发布公告称，几名高级管理人员和员工于 2015 年 8 月 25 日被公安机关要求协助调查有关问题，调查工作尚在进行之中，相关事项如有新的进展，且涉及公告事项时，其将按照有关规定，及时发布公告。

中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司于 2015 年 9 月 16 日发布公告称，公司总经理程博明、经纪业务发展与管理委员会运营管理部负责人于新利、信息技术中心汪锦岭等人于 2015 年 9 月 15 日因涉嫌内幕交易、泄露内幕信息被公安机关依法要求接受调查。

中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司于 2015 年 11 月 27 日发布公告称，其于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规

定予以立案调查的《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。

8.10.2 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。

8.10.3 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 | 369,252.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,945.33 |
| 5 | 应收申购款 | 99.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 375,297.93 |

8.10.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.10.4.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|-------|---------------|--------------|----------|
| 1 | 000002 | 万 科 A | 11,630,341.24 | 3.11 | 重大事项停牌 |

8.10.4.2 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 |
| 国联安双禧 A 中证 100 指数 | 841 | 112,900.26 | 19,055,453.00 | 20.07% | 75,893,663.00 | 79.93% |
| 国联安双禧 B 中证 100 指数 | 6,290 | 22,642.87 | 31,895,960.00 | 22.40% | 110,527,714.00 | 77.60% |
| 国联安双禧中证 100 指数 | 1,826 | 16,661.65 | 19,009,090.45 | 62.48% | 11,415,090.16 | 37.52% |
| 合计 | 8,957 | 29,898.07 | 69,960,503.45 | 26.12% | 197,836,467.16 | 73.88% |

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

国联安双禧 A 中证 100 指数

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|--------------|---------------|----------|
| 1 | 陈淦 | 20,155,118.00 | 21.23% |
| 2 | 中荷人寿保险有限公司 | 8,332,166.00 | 8.78% |
| 3 | 陈岩 | 7,881,386.00 | 8.30% |
| 4 | 中国银河证券股份有限公司 | 7,411,197.00 | 7.81% |
| 5 | 张华 | 6,612,761.00 | 6.96% |
| 6 | 陈维 | 5,835,039.00 | 6.15% |
| 7 | 王琬雯 | 4,408,393.00 | 4.64% |
| 8 | 邢宏建 | 4,159,281.00 | 4.38% |
| 9 | 王利 | 3,761,494.00 | 3.96% |
| 10 | 赵颖 | 3,450,000.00 | 3.63% |

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。

国联安双禧 B 中证 100 指数

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-----------------|---------------|----------|
| 1 | 幸福人寿保险股份有限公司-分红 | 16,013,214.00 | 11.24% |
| 2 | 张俊生 | 6,000,000.00 | 4.21% |

| | | | |
|----|----------------------------------|--------------|-------|
| 3 | 恒安标准人寿保险有限公司—传统分红险 | 5,184,500.00 | 3.64% |
| 4 | 长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管理 | 4,804,221.00 | 3.37% |
| 5 | 幸福人寿保险股份有限公司—自有资金 | 2,237,400.00 | 1.57% |
| 6 | 东方汇智资管—光大银行—中国光大银行股份有限公司 | 1,904,711.00 | 1.34% |
| 7 | 张成柏 | 1,700,540.00 | 1.19% |
| 8 | 韦桂生 | 1,296,900.00 | 0.91% |
| 9 | 奇翌点金融信息服务（上海）有限公司 | 946,200.00 | 0.66% |
| 10 | 朱世文 | 833,400.00 | 0.59% |

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

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的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研发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 | 国联安双禧 A 中证 100 指数 | 国联安双禧 B 中证 100 指数 | 国联安双禧中证 100 指数 |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010 年 4 月 16 日）基金份额总额 | 263,081,728.00 | 394,622,592.00 | 324,434,577.44 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 716,297,672.00 | 1,074,446,508.00 | 526,642,275.39 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - | 306,685,013.30 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - | 2,356,274,498.08 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | -621,348,556.00 | -932,022,834.00 | 1,553,371,390.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 94,949,116.00 | 142,423,674.00 | 30,424,180.61 |

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金定期份额折算变动份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2015 年 6 月 6 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起谭晓雨女士担任我司总经理一职。公司董事长庾启斌先生不再代为履行总经理职责。上述事项已经 2015 年 4 月 7 日召开的国联安基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议审议通过。

2. 2015 年 8 月 22 日，基金管理人发布《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十七次会议审议通过，自该日起周浩先生不再担任公司督察长一职，由公司总经理谭晓雨女士代为履行督察长职责。

3. 本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金报告年度支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 6.5 万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续 6 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 | 佣金 | 占当期佣金总量的 | |
| | | | | | | |

| | | | 额的比例 | | 比例 | |
|------------------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 申万宏源证券 有限公司 | 1 | 1,806,899,005.91 | 38.07% | 1,647,152.37 | 38.23% | - |
| 华泰证券股份 有限公司 | 1 | 640,175,777.70 | 13.49% | 583,357.67 | 13.54% | - |
| 东兴证券股份 有限公司 | 1 | 568,191,984.05 | 11.97% | 517,282.52 | 12.01% | - |
| 西南证券股份 有限公司 | 1 | 515,642,025.71 | 10.86% | 470,971.36 | 10.93% | - |
| 国泰君安证券 股份有限公司 | 2 | 399,141,750.52 | 8.41% | 356,035.38 | 8.26% | - |
| 兴业证券股份 有限公司 | 1 | 329,498,512.08 | 6.94% | 301,386.80 | 7.00% | - |
| 西部证券股份 有限公司 | 1 | 216,210,870.76 | 4.56% | 191,558.92 | 4.45% | - |
| 东北证券股份 有限公司 | 1 | 210,552,140.69 | 4.44% | 187,374.15 | 4.35% | - |
| 华创证券有限 责任公司 | 1 | 60,312,095.75 | 1.27% | 53,380.81 | 1.24% | - |

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

本报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

3、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|--------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1,439,640.00 | 40.27% | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | 1,060,640.00 | 29.67% | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 1,074,830.10 | 30.06% | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限公司 | | | | | | |
| 兴业证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限 责任公司 | - | - | - | - | - | - |

国联安基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日