

双禧 A 份额与双禧 B 份额上市交易公告书

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

目 录

一、重要声明与提示	2
二、基金概览	3
三、基金份额的募集与上市交易	6
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	9
五、基金主要当事人简介	10
六、基金合同摘要	15
七、基金财务状况	35
八、基金投资组合	37
九、重大事件揭示	40
十、基金管理人承诺	43
十一、基金托管人承诺	44
十二、备查文件目录	45

一、重要声明与提示

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之双禧 A 份额与双禧 B 份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之双禧 A 份额与双禧 B 份额上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2010 年 3 月 15 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和国联安基金管理有限公司网站（<http://www.vip-funds.com/>或 <http://www.gtja-allianz.com/>）的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金名称：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、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”）的基金份额包括国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“双禧 100”）、国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之双禧 A 份额（简称“双禧 A”）与国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之双禧 B 份额（简称“双禧 B”）。其中，双禧 A、双禧 B 的基金份额配比始终保持 4：6 的比率不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、双禧 100 的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对双禧 100 份额进行申购与赎回。双禧 100 场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。双禧 100 场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求

的深圳证券交易所会员单位。双禧 A 与双禧 B 将不接受投资者的申购与赎回。

7、份额配对转换：份额配对转换是指双禧 100 与双禧 A、双禧 B 之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的每十份双禧 100 的场内份额申请转换成四份双禧 A 与六份双禧 B；合并是指基金份额持有人将其持有的每四份双禧 A 与六份双禧 B 进行配对申请转换成十份双禧 100 的场内份额。份额配对转换自本基金上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，有关份额配对转换的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

8、基金份额折算：基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算。折算后基金运作方式及双禧 A 与双禧 B 份额配比不变。

(1) 双禧 100 份额折算

基金份额折算日折算后，双禧 100 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。折算后，双禧 100 份额持有人持有的双禧 100 份额的份额数按照双禧 100 折算比例相应增加或缩减。若折算前，双禧 100 份额净值大于 1.000 元，则折算后双禧 100 份额持有人持有的双禧 100 份额增加；若折算前，双禧 100 份额净值小于或等于 1.000 元，则折算后双禧 100 份额持有人持有的双禧 100 份额缩减。

(2) 双禧 A、双禧 B 份额折算

基金份额折算日折算后，双禧 A、双禧 B 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。根据双禧 B 折算日折算前的基金份额净值，按以下两种情况进行基金份额的折算：

A、折算日折算前双禧 B 的基金份额净值大于 1 元

如果双禧 B 份额折算日折算前基金份额净值大于 1.000 元，则持有人持有的双禧 A 份额及双禧 B 份额的数量在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成双禧 100 份额的场内份额。

B、折算日折算前双禧 B 的基金份额净值小于或等于 1 元

如果双禧 B 份额折算日折算前的基金份额净值小于或等于 1.000 元，则双禧 B 份额持有人持有的双禧 B 份额数按照双禧 B 份额的折算比例相应缩减。为保持双禧 A 和双禧 B 份额比例 4:6 不变，双禧 A 份额的折算比例与双禧 B 份额的折算比例相同，双禧 A 份额持有人持有的双禧 A 份额数同比例相应缩减，超出份额数将全部折算成双禧 100 份额的场内份额。

9、双禧 A 与双禧 B 的终止运作：经基金份额持有人大会决议通过，双禧 A 与双禧 B 可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的双禧 100、双禧 A 与双禧 B 各自的基金份额持有人或其代理人所持双禧 100、双禧 A 与双禧 B 各自表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

10、基金份额总额：截至 2010 年 6 月 8 日，本基金的基金份额总额为 982,138,897.44 份，其中，双禧 100 为 324,434,577.44 份，双禧 A 为 263,081,728 份，双禧 B 为 394,622,592 份。

11、基金份额净值：截止 2010 年 6 月 8 日，双禧 100 的基金份额净值为 0.961 元，双禧 A 的基金份额净值为 1.009 元，双禧 B 的基金份额净值为 0.929 元。

12、本次上市交易的基金份额简称：双禧 A、双禧 B

13、本次上市交易的基金份额总额：双禧 A 263,081,728 份；双禧 B 394,622,592 份

14、本次上市交易的基金份额交易代码：双禧 A 为 150012；双禧 B 为 150013

15、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

16、上市交易日期：2010 年 6 月 18 日

17、基金管理人：国联安基金管理有限公司

18、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

19、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公

司

### 三、基金份额的募集与上市交易

#### (一) 上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：经 2010 年 2 月 21 日中国证监会证监许可[2010]228 号文批准募集

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2010 年 3 月 18 日至 2010 年 4 月 9 日

5、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

6、发售机构：

##### (1) 场内发售机构

1) 直销机构：国联安基金管理有限公司。

2) 代销机构：已经具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

##### (2) 场外发售机构

1) 直销机构：国联安基金管理有限公司。

2) 代销机构：中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、华泰证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、广发华福证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司

#### 7、认购费率

本基金的认购费率按认购金额分档设置，最高不超过 1%。其中，采用场内认购方式认购本基金的，比照执行场外认购费率。

8、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所

#### 9、募集资金总额及入账情况

本基金募集的总净缴存金额（不含手续费）人民币 982,138,906.44 元，确认份额（不含利息转份额）982,019,785.35 份，利息结转份额 119,121.09 份，总确认份额为 982,138,906.44 份。

上述总净缴存金额已于 2010 年 4 月 15 日分别划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的托管专户。

根据本基金基金合同的约定，本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为双禧 100 份额；场内认购的全部份额将按 4：6 的比率确认为双禧 A 份额与双禧 B 份额。按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间募集及利息结转的基金份额共计 982,138,906.44 份，其中场外认购的基金份额确认为 324,434,577.44 份双禧 100 份额；场内认购的基金份额确认为 657,704,329 份，按 4：6 的比率确认为 263,081,728 份双禧 A 份额和 394,622,592 份双禧 B 份额，未能拆分的余额 9 份根据基金合

同约定计入基金资产。

#### 10、基金备案情况

本基金已于 2010 年 4 月 15 日验资完毕，2010 年 4 月 16 日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2010 年 4 月 16 日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2010 年 4 月 16 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：982,138,897.44 份，其中，双禧 100 为 324,434,577.44 份，双禧 A 为 263,081,728 份，双禧 B 为 394,622,592 份。

#### (二) 双禧 A 与双禧 B 上市交易的主要内容

1、本基金的双禧 A 与双禧 B 上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2010】193 号

2、上市交易日期：2010 年 6 月 18 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：双禧 A、双禧 B

5、交易代码：双禧 A 为 150012、双禧 B 为 150013

6、本次上市交易份额：双禧 A 为 263,081,728 份、双禧 B 为 394,622,592 份

7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布该工作日的双禧 100、双禧 A 与双禧 B 的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的双禧 100 办理跨系统转托管到场内（证券登记结算系统）后，可以向具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成双禧 A 和双禧 B，分拆后的双禧 A 和双禧 B 可以在深圳证券交易所场内上市流通。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### (一) 基金份额持有人户数

截至 2010 年 6 月 8 日，基金份额持有人户数：8,042 户，平均每户持有的基金份额为 122,126.20 份，其中，双禧 100 为 3,011 户，平均每户持有的基金份额为 107,749.78 份；双禧 A 为 5,031 户，平均每户持有的基金份额为 52,292.13 份；双禧 B 为 5,031 户，平均每户持有的基金份额为 78,438.20 份。

##### (二) 基金份额持有情况

截至 2010 年 6 月 8 日，基金份额持有情况：机构投资者持有的本次上市交易的双禧 A 与双禧 B 的基金份额分别为 130,026,704 份和 195,040,056 份，分别占本次双禧 A 与双禧 B 上市交易基金份额比例为 49.42%；个人投资者持有的本次上市交易的双禧 A 与双禧 B 的基金份额分别为 133,055,024 份和 199,582,536 份，分别占本次双禧 A 与双禧 B 上市交易基金份额比例为 50.58%。

##### (三) 基金份额前十名持有人情况

截至 2010 年 6 月 8 日，本次上市交易的双禧 A 与双禧 B 前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有双禧 A 份额	占双禧 A 份额比	持有双禧 B 份额	占双禧 B 份额比
----	-------	-----------	-----------	-----------	-----------

1	广发证券股份有限公司	20,002,000	7.60%	30,003,000	7.60%
2	信诚人寿保险有限公司	16,002,160	6.08%	24,003,240	6.08%
3	合众人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品			12,001,040	4.56%
		18,001,560	4.56%		

4	广发华福证券有限责任公司	12,000,360	4.56%	18,000,540	4.56%
5	上海新永溢投资有限责任公司	8,001,600	3.04%	12,002,400	3.04%
6	中国平安保险(集团)股份有限公司	8,000,720	3.04%	12,001,080	3.04%
7	西安华弘证券经纪有限责任公司	8,000,560	3.04%	12,000,840	3.04%
8	株洲千金药业股份有限公司	8,000,560	3.04%	12,000,840	3.04%
9	华宝信托有限责任公司-集合类资金信托 R2008JH030	8,000,480	3.04%	12,000,720	3.04%
10	南京证券有限责任公司	4,000,320	1.52%	6,000,480	1.52%

## 五、基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

名称：国联安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 46 楼

法定代表人：符学东

总经理：许小松

成立时间：2003 年 4 月 3 日

注册资本：1.5 亿元人民币

设立批准文号：证监基金字[2003]42 号

工商登记注册的法人营业执照文号：310000400337467（市局）

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

股东及其出资比例：国泰君安证券股份有限公司(51%)、德国安联集团(49%)

内部组织结构及职能：

本基金管理人内部共设有研究部、投资组合管理部、数量策略部、基金交易部、基金事务管理部、信息技术部、财务计划部、综合管理部、产品开发部、市场发展部、代销部、直销部、养老金与机构理财部、监察稽核部、风险管理部、人力资源部共十六个职能部门，并在北京设有办事处。

研究部：公司的研究支持部门，为基金投资提供决策依据；

投资组合管理部：基金的投资决策部门；

数量策略部：负责量化投资的研究、基金的风险与绩效分析、提供数量化技术支持等工作；

基金交易部：公司投资交易的执行部门；

基金事务部：是基金会计、清算及注册登记的职能部门；

信息技术部：为公司正常运转提供信息系统支持及信息安全保障的职能部门；

财务计划部：负责公司财务预决算及成本管理和财务分析等工作；

综合管理部：负责公司行政管理及后勤保障等工作；

产品开发部：负责产品开发和业务拓展的职能部门；

市场发展部：负责市场策划、电子商务、客户服务及管理的职能部门；

代销部：负责基金代销机构的业务协调、基金产品的代销业务等工作；

直销部：负责公司机构直销业务及客户开发、管理的职能部门；

养老金与机构理财部：筹备养老金与机构理财业务；

监察稽核部：负责公司法务、合规管理、内部审计的职能部门；

风险管理部：投资、交易环节风险提示及控制的职能部门；

人力资源部：负责人事管理的职能部门；

北京办事处：与监管部门协调沟通的部门；

人员情况：

截至 2010 年 3 月 31 日，公司共有员工 86 人，所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

信息披露负责人及咨询电话：古韵，(021) 38992888

基金管理业务情况：

截至 2010 年 5 月 30 日，国联安基金管理有限公司旗下共管理 9 只基金：国联安德盛稳健证券投资基金（以下简称“国联安稳健混合”）、国联安主题驱动股票型证券投资基金（以下简称“国联安主题驱动股票”）、国联安德盛小盘精选证券投资基金（以下简称“国联安小盘精选混合”）、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金（以下简称“国联安安心成长混合”）、国联安德盛精选股票证券投资基金（以下简称“国联安精选股票”）、国联安德盛优势股票证券投资基金（以下简称“国联安优势股票”）、国联安德盛红利股票证券投资基金（以下简称“国联安红利股票”）、国联安德盛增利债券证券投资基金（以下简称“国联安增利债券”）以及本基金。国联安稳健混合、国联安小盘精选混合、国联安安心成长混合都是混合型基金。国联安精选股票是股票型基金，主要投资于资金成本低、资本回报率高的、能够为股东创造价值的公司，国联安优势股票的主要投资对象为具有四类竞争优势（资源优势、管理优势、渠道优势和技术优势）的公司，国联安红利股票的主要投资于具有较高预期股息收益率的公司，国联安主题驱动股票的主要挖掘中国经济结构转型中涌现的投资主题，精选符合这些主题的个股进行投资。国联安增利债券则是债券型基金。

本基金基金经理：

冯天戈先生，理学硕士，于 1996 年 5 月加入海南富岛资产管理有限公司任研究员，2001 年 10 月加入长城基金管理有限公司任研究员、基金经理助理，2003 年 5 月加入国泰基金管理有限公司任基金经理助理，2004 年 3 月起任国泰金鹰增长基金基金经理，2006 年 9 月起兼任国泰金鹏蓝筹价值基金基金经理，2007 年 4 月加入工银瑞信基金管理有限公司，2007 年 10 月加入国联安基金管理有限公司，任副投资总监，2008 年 3 月至 2009 年 9 月兼任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理，2008 年 6 月至 2010 年 5 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，2008 年 10 月至 2010 年 5 月兼任国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理。

黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士，于 2002 年 11 月加入兴业证券投资部任投资分析员，2003 年 10 月加入国联安基金管理有限公司任产品开发部经理助理，2008 年 5 月起任国联安基金管理有限公司投资组合管理部债券投资助理，2009 年 2 月至 2010 年 4 月任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 5 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。

（二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

主要人员情况：

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

基金托管业务经营情况：

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2009 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 143 只证券投资基金，其中封闭式基金 6 只，开放式基金 137 只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010 年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

（三）基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所

注册地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法人代表：蔡廷基

经办注册会计师：王国蓓、陈彦君

联系电话：(021) 53594666

## 六、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1、基金份额持有人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让其持有的双禧 A 份额与双禧 B 份额，依法申请赎回其持有的双禧 100 份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉

讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (3) 发售基金份额；
- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时报告中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理双禧 100 份额申购和赎回申请；
- (8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产净值、双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双禧 A 份额与双禧 B 份额终止运作后的份额转换比例和双禧 100 份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理双禧 100 份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(2) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

(3) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(4) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(5) 依法召集基金份额持有人大会；

(6) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双禧 A 份额与双禧 B 份额终止运作后的份额转换比例和双禧 100 份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- A、终止基金合同；
- B、转换基金运作方式；

- C、变更基金类别；
- D、变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- E、变更基金份额持有人大会程序；
- F、更换基金管理人、基金托管人；
- G、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- H、本基金与其他基金的合并；
- I、终止双禧 A 份额与双禧 B 份额的运作；
- J、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- K、单独或合计持有双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金总份额 10% 以上（含 10%，下同）基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- L、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- M、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- A、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- B、在法律法规和本基金合同规定的范围内变更双禧 100 份额的申购费率、调低赎回费率；
- C、因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- D、对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- E、基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- F、按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 单独或合计代表双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 单独或合计代表双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应

当配合，不得阻碍、干扰。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- A、会议召开的时间、地点；
- B、会议拟审议的主要事项；
- C、会议形式；
- D、议事程序；
- E、有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- F、代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- G、表决方式；
- H、会务常设联系人姓名、电话；
- I、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- J、召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

#### (1) 会议方式

A、基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

B、现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

C、通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

D、会议的召开方式由召集人确定。

#### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

##### A、现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a、对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50% (含 50%，下同)；

b、到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

##### B、通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a、召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公

告；

b、召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

c、召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

d、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额占权益登记日各自基金总份额的 50%以上；

e、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

A、议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

B、基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

C、对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

D、单独或合并持有权益登记日双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

E、基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

### (2) 议事程序

#### A、现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自基金份额持有人和代理人以所

持表决权的 50%以上选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

#### B、通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 日公布提案,在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

#### 6、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

##### A、一般决议

一般决议,一般决议须经参加大会的双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额表决权的 50%以上通过方为有效;除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

##### B、特别决议

特别决议,特别决议应当经参加大会的双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止双禧 A 份额与双禧 B 份额的运作、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### 7、计票

##### (1)现场开会

A、如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

B、监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

C、如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 8、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

## 9、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### (三) 基金收益分配原则、执行方式

本基金（包括双禧 100、双禧 A、双禧 B）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止双禧 A 与双禧 B 的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### (四) 与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 3、基金合同生效后的指数许可使用费

指数许可使用费是指指数许可使用基点费，指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；基金合同生效当年，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.02%/年。

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，基金管理人应于每年 1 月，4 月，7 月，10 月的最后一个工作日前，按照双方确认的金额向中证指数有限公司支付上一季度的指数许可使用基点费。

如果基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用基点费的下限，则该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人承担。

2、除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （五）基金财产的投资方向和投资限制

##### 1、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。

##### 2、投资范围

本基金资产投资于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。

本基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

##### 3、投资限制

###### （1）组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

A、本基金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%；

B、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

C、本基金持有的同一权证不超过该权证的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

D、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

E、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

F、法律法规及中国证监会规定的其他限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易

日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## (2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- A、承销证券；
- B、向他人贷款或者提供担保；
- C、从事承担无限责任的投资；
- D、买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- E、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- F、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- G、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- H、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- I、法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 2、基金资产净值的公告方式

本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和双禧 100、双禧 A 与双禧 B 的基金份额净值；

在双禧 A、双禧 B 上市交易或者开始办理双禧 100 申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日双禧 100、双禧 A 与双禧 B 各自的基金份额净值和基金份额累计净值；

基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和双禧 100、双禧 A 与双禧 B 的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、以及双禧 100、双禧 A 与双禧 B 各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## (七) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 中国证监会规定的其他情况。

### 2、基金财产的清算

#### (1) 基金财产清算组

A、基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

B、基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

C、基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- A、基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- B、基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- C、对基金财产进行清理和确认；
- D、对基金财产进行估价和变现；
- E、聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- F、聘请律师事务所出具法律意见书；
- G、将基金财产清算结果报告中国证监会；
- H、参加与基金财产有关的民事诉讼；
- I、公布基金财产清算结果；
- J、对基金剩余财产进行分配；
- K、基金财产清算期限为六个月。

#### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- A、支付清算费用；
- B、交纳所欠税款；
- C、清偿基金债务；
- D、根据基金合同终止日双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自净值分别计算双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在双禧 100 份额、双禧 A 份额与双禧 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的双禧 A 份额与双禧 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### (八) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

(十) 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 七、基金财务状况

深圳证券交易所国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费用收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金截止 2010 年 6 月 8 日资产负债表（未经审计）如下：

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

2010 年 6 月 8 日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

2010 年 6 月 8 日

### 资产

银行存款	274,045,772.33
结算备付金	2,522,406.61
存出保证金	-
交易性金融资产	769,824,441.21
其中：股票投资	769,824,441.21
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	877,781.61
应收股利	641,638.96
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	1,047,912,040.72

### 负债

应付证券清算款	102,786,457.25
应付管理人报酬	210,221.99
应付托管费	46,248.84
应付交易费用	679,061.81
应付税费	-
应付赎回款	-
其他负债	88,504.60
负债合计	103,810,494.49

#### 所有者权益

实收基金	982,138,897.44
未分配利润	-38,037,351.21
所有者权益合计	944,101,546.23

负债及所有者权益总计 1,047,912,040.72

(2010年6月8日基金份额净值 0.961元)

#### 八、基金投资组合

截止到2010年6月8日,国联安双禧中证100指数分级证券投资基金的投资组合如下:

##### (一) 期末基金资产组合情况

资产项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
股票	769,824,441.21	73.46
债券	-	-
权证	-	-
银行存款及清算备付金	276,568,178.94	26.39
其他资产	1,519,420.57	0.14
合计	1,047,912,040.72	100.00

##### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-
B 采掘业	104,371,849.87	11.06
C 制造业	158,808,375.87	16.82
C0 食品、饮料	31,515,678.54	3.34
C1 纺织、服装、皮毛	3,239,148.00	0.34
C2 木材、家具	-	-
C3 造纸、印刷	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	11,338,388.83	1.20
C5 电子	-	-
C6 金属、非金属	44,725,586.51	4.74
C7 机械、设备、仪表	66,042,159.99	7.00
C8 医药、生物制品	-	-
C99 其他制造业	1,947,414.00	0.21
D 电力、煤气及水的生产和供应业	32,161,612.35	3.41
E 建筑业	23,443,793.25	2.48
F 交通运输、仓储业	36,710,899.16	3.89
G 信息技术业	20,181,550.28	2.14
H 批发和零售贸易	14,272,902.60	1.51
I 金融、保险业	336,331,529.23	35.62
J 房地产业	33,265,394.50	3.52
K 社会服务业	5,277,440.00	0.56
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	4,999,094.10	0.53

合计 769,824,441.21 81.54

(三) 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	600036	招商银行	3,393,402	42,485,393.04	4.50
2	601318	中国平安	850,104	37,642,605.12	3.99
3	600016	民生银行	5,189,762	31,449,957.72	3.33
4	601328	交通银行	5,001,259	30,757,742.85	3.26
5	601166	兴业银行	1,118,869	25,588,534.03	2.71
6	600000	浦发银行	1,460,382	25,410,646.80	2.69
7	600030	中信证券	1,077,720	21,112,534.80	2.24
8	601088	中国神华	895,868	20,533,294.56	2.17
9	601398	工商银行	4,019,600	16,480,360.00	1.75
10	000002	万科A	2,196,900	15,597,990.00	1.65

(四) 期末按券种分类的债券投资组合

本基金于2010年6月8日未持有债券投资。

(五) 期末债券投资前五名明细

本基金于2010年6月8日未持有债券投资。

(六) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	641,638.96
4	应收利息	877,781.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,519,420.57

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2010年6月8日未持有转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2010年6月8日前十名股票中不存在流通受限情况。

6、本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

九、重大事件揭示

国联安双禧中证100指数分级证券投资基金发售后至上市交易公告书公告前已发生的对基金份额持有人有较大影响的重大事件:

1、2010年4月2日,基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于运用公司人才激励基金认购国联安双禧中证100指数分级证券投资基金的公告。本基金管理人拟于2010年4月

7 日通过代销机构国泰君安证券股份有限公司认购国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 898 万元，认购费按招募说明书列明的费率收取。

2、2010 年 4 月 17 日，基金管理人发布国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同生效公告。国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日正式生效。

3、2010 年 4 月 23 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于旗下基金增加国金证券为代销机构的公告。国金证券自国联安双禧中证 100 指数分级基金开放申购之日起代理销售该基金。

4、2010 年 4 月 30 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于增加注册资本和修改章程的公告。本公司注册资本由人民币壹亿元（RMB100,000,000 元）增加至人民币壹亿伍仟万元（RMB150,000,000 元）。本公司注册资本增加后，股东及股东出资比例均保持不变：国泰君安股份有限公司占注册资本总额的 51%、安联集团占注册资本总额的 49%。

5、2010 年 5 月 10 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司办公地址变更公告。因业务发展需要，国联安基金管理有限公司于 2010 年 5 月 17 日由上海市世纪大道 88 号 46 楼迁入新的地址办公，公司原客服电话保持不变。新的办公地址和联系方式如下：

办公地址：上海市陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

邮政编码：200121

电话总机：021-3899 2888

公司传真：021-5015 1880

客服中心电话：400-700-0365(免长途电话费)，021-3878 4766

公司网站：[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com)，[www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)

6、2010 年 5 月 10 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞证券为代销机构的公告。东莞证券自国联安双禧中证 100 指数分级基金开放申购之日起代理销售该基金。

7、2010 年 5 月 14 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司办公地址变更的提示性公告。

8、2010 年 5 月 28 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国银行为代销机构及在中国银行开通定投和基金转换业务的公告。中国银行自国联安双禧中证 100 指数分级基金开放申购之日起代理销售该基金及开通该基金的定投业务。

9、2010 年 6 月 1 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行个人网上银行申购费率及定投申购费率优惠活动的公告。国联安双禧中证 100 指数分级基金自开放申购之日起参加中国银行个人网上银行申购费率及定投申购费率优惠活动。投资者通过中国银行网上交易系统购买本基金，其购买手续费享有优惠，原前端申购费率高于 0.6% 的，前端申购费率按 8 折优惠（即实收申购费率=原申购费率×0.8），优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6% 执行；原前端申购费率低于 0.6% 的，则按原申购费率执行（原费率详见本公司发布的本基金招募说明书）。2、投资者通过中国银行网上交易系统委托定期定额申购基金的，原前端申购费率高于 0.6% 的，前端申购费率按 8 折优惠（即实收申购费率=原申购费率×0.8），优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6% 执行；原前端申购费率低于 0.6% 的，则按原申购费率执行。3、投资者通过中国银行柜台系统现场委托定期定额申购本基金的，原前端申购费率高于 0.6% 的，前端申购费率按 8 折优惠（即实收申购费率=原申购费率×0.8），优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6% 执行；原前端申购费率低于 0.6% 的，则按原申购费率执行。

10、2010 年 6 月 1 日，基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加中信银行个人网上银行申购费率优惠活动的公告。国联安双禧中证 100 指数分级基金自开放申购

之日起参加中信银行个人网上银行申购费率优惠活动。投资者通过中信银行网上银行申购本基金,享有申购费率优惠:(1)原申购费率高于0.6%,优惠费率7折起,但优惠费率不低于0.6%;(2)原申购费率低于0.6%,按照原费率执行。(3)只针对正常申购期的开放式基金的前端收费模式,不包括定投、基金的后端收费模式和基金募集期的认购费率。

11、2010年6月7日,基金管理人发布国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金在申银万国证券推出基金定期定额投资计划的公告。国联安双禧中证100指数分级证券投资基金自开放申购之日起开通定投业务。

#### 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

#### 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

#### 十二、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

- (一)中国证监会核准国联安双禧中证100指数分级证券投资基金募集的文件
- (二)《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金合同》
- (三)《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金托管协议》
- (四)关于申请募集国联安双禧中证100指数分级证券投资基金之法律意见书
- (五)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六)基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七)《国联安基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (八)中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所,基金投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

国联安基金管理有限公司

2010年6月10日