

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金
2010 年半年度报告
2010 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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。本半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。

本基金托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 20 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。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 4 月 16 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	7
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	37
7.1	期末基金资产组合情况.....	37
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6	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.....	43
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8	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.....	43

7.9	投资组合报告附注.....	43
8	基金份额持有人信息.....	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
9	开放式基金份额变动.....	46
10	重大事件揭示.....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	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.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	47
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	47
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件.....	49
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	51
12	备查文件目录.....	51
12.1	备查文件目录.....	51
12.2	存放地点.....	51
12.3	查阅方式.....	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安双禧中证100指数分级证券投资基金		
基金简称	国联安双禧中证100指数分级		
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		
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	882,200,921.92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
下属分级基金的交易代码	150012	150013	162509
报告期末下属分级基金的份额总额	224,488,960.00	336,733,440.00	320,978,521.92

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	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

	<p>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> <p>1、股票组合的构建方法</p> <p>本基金按照成份股在中证100指数中的基准权重构建股票投资组合。如有股票停牌的限制、股票流动性、法律法规限制等因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当替代。</p> <p>2、股票指数化投资日常投资组合管理</p> <p>（1）组合调整原则</p> <p>本基金为指数型基金基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化对基金投资组合进行适时调整以保证基金净值增长率与标的指数间的跟踪误差最小化。</p> <p>（2）投资组合调整方法</p> <p>本基金将对标的指数进行定期与不定期跟踪调整，同时也会结合限制性调整措施对基金资产进行适当调整。</p> <p>（3）跟踪偏离度的监控与管理</p> <p>每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。</p>
业绩比较基准	<p>本基金业绩比较基准为：$95\% \times \text{中证100指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$。</p>
风险收益特征	<p>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。</p> <p>双禧A：低风险低收益。双禧B：高风险高收益。</p>

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	古韵	尹东
	联系电话	021-38992805	010-67595003
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 46 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		符学东	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报及深交所网站
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-1,785,385.40
本期利润	-61,050,470.90

加权平均基金份额本期利润	-0.0625
本期加权平均净值利润率	-6.33%
本期基金份额净值增长率	-6.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配利润	-59,856,208.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0678
期末基金资产净值	822,344,713.66
期末基金份额净值	0.932
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-6.80%

注：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。

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。

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。

本基金基金合同生效之日 2010 年 4 月 16 日至 6 月 30 日尚未完半年。

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

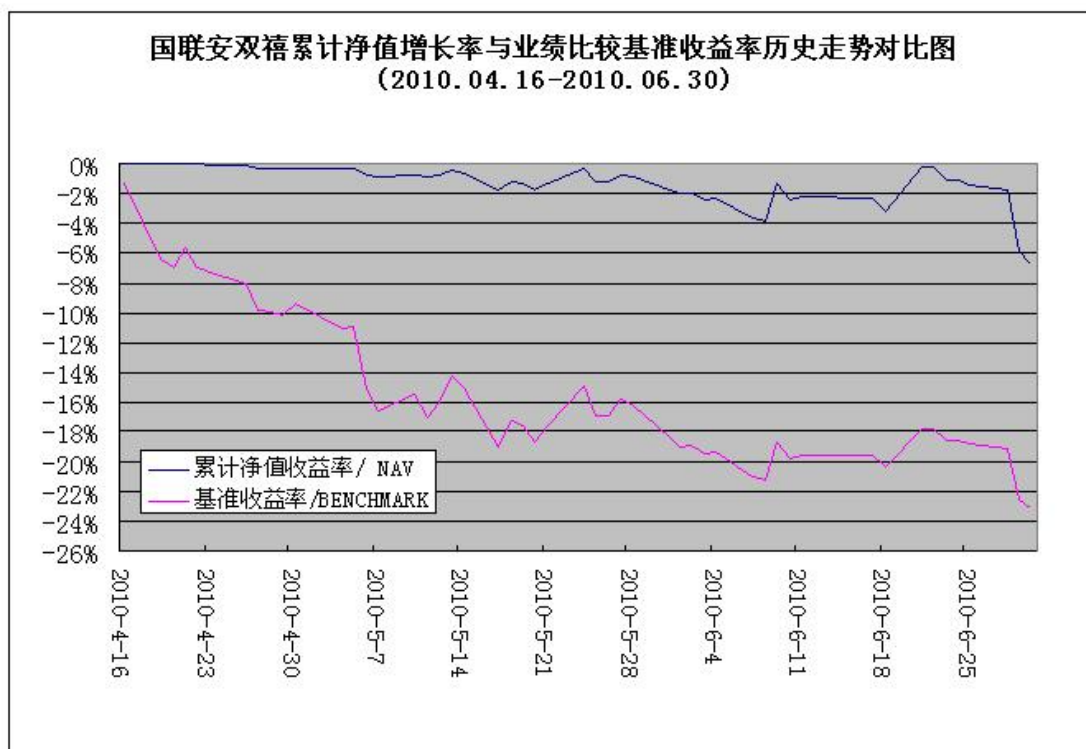
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.19%	1.47%	-5.88%	1.59%	0.69%	-0.12%
自基金成立起至今	-6.80%	0.94%	-23.09%	1.85%	16.29%	-0.91%

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历史走势对比图

(2010 年 4 月 16 日至 2010 年 6 月 30 日)



注：国联安双禧业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率 (税后)}$
 本基金建仓期自基金合同生效之日 2010 年 4 月 16 日起 6 个月，截至本报告期末本基金尚在
 建仓期。

本基金基金合同生效之日 2010 年 4 月 16 日至 6 月 30 日尚未满半年。

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。本报告期内公司管理着十只开放式基金。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的成功实践，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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯天戈	副投资总	2010-04-16	-	15 年（自	冯天戈先生,理学硕士,

	监、兼本基金基金经理			1995 年 开始)	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 月担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 月任国联安安心成长混合基金基金经理，2008 年 10 月至 2010 年 5 月任国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理，2010 年 4 月起任本基金基金经理。
黄欣	本基金基金经理、兼国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理	2010-04-16	-	8 年（自 2002 年开始）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士，于 2003 年 10 月加入国联安基金管理有限公司，历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 月起任本基金基金经理，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。
--	--	--	--	--	----

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 公平交易制度的执行情况

中国证监会于 2008 年 3 月 20 日颁布《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人组织各相关部门展开认真讨论，并最终制定了相应的工作计划。为了所管理的不同投资组合得到公平的对待，充分保护基金持有人、公司股东和公司的合法权益，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行为监控和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所有指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时采用交易系统内的公平交易模块；自主编程并开发交易监控程序，通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析；定期对投资流程进行独立稽核等。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制和监察稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的投资行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下共有 10 只基金，分别为国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛

小盘精选证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、国联安德盛优势股票证券投资基金、国联安德盛红利股票证券投资基金、国联安德盛增利债券证券投资基金、国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金、国联安主题驱动股票型证券投资基金和国联安信心增益债券型证券投资基金。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的基金，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

双禧分级基金成立于 2010 年 4 月 16 日，综合分析了当时的政策面以及海外欧债危机等因素之后，我们基本判断 6-7 月份市场将出现阶段性底部，会是较好的建仓时机，因此采取了缓慢的建仓策略，在建仓过程中，我们首先买入的是前期中证 100 指数成分股中表现相对稳定的保险、电力设备、食品饮料板块，占比较大但一直跌势未止的银行证券地产等板块则在其后。这个建仓策略使持有人基本规避了近期市场大幅调整带来的风险。从 2010 年 4 月 16 日至双禧基金上市前的 2010 年 6 月 17 日，中证 100 指数下跌 20.59%，双禧基金下跌 2.3%。目前，双禧基金基本上已经完成建仓，仓位达到 90%。

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 0.932 元，本报告期份额净值增长率为-6.80%，同期业绩比较基准收益率为-23.09%。报告期内，自 2010 年 6 月 18 日本分级基金在深圳交易所上市至上半年度末，日均跟踪偏离度为 0.07%，年化跟踪误差为 1.59%，符合基金合同分别约定的跟踪误差不超过 0.35%以及 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

从近期的宏观数据来看，新增贷款情况较为平稳，2010 年 6 月新增贷款 6034 亿元，m1、m2 同比增速略有回落，2010 年 6 月份分别为 24.56%、18.46%（5 月为 29.90%、21.00%）。从其它宏观数据来看：消费者价格指数自 2009 年 8 月份触底后持续反弹，2010 年 6 月已经出现 2.9%的同比正增长，PPI 也从 2009 年 9 月份的-7%上升至 6 月的 6.41%；社会消费品零售总额继续保持稳定，2010 年 6 月社会消费品零售总额同比增长 18.3%，处于较高水平；2010

年 1-6 月份的固定资产投资达 25.5%，低于去年同期的 33.6%。2010 年 6 月份我国出口同比增速为 43.90%；PMI 连续 2 个月出现下降，2010 年 6 月份为 52.1；工业增加值同比增加 13.7%，比上月也继续下降。

欧洲债务危机以及全球经济下滑导致中国外需不足，出口可能会出现下滑；政府对房地产的调控也将降低国内的固定资产投资增速，从工业增加值和 PMI 指数来看，2 季度以来经济呈下滑趋势。我们判断，为了防止中国经济增速大幅下滑，3 季度政策面上将略有放松。

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《基金合同》的约定，本基金（包括双禧 100 份额、双禧 A 份额、双禧 B 份额）不进行收益分配。

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	43,487,730.61
结算备付金		2,522,406.61
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	770,122,091.46
其中：股票投资		770,122,091.46
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4.1	30,000,000.00
应收证券清算款		10,488,200.40
应收利息	6.4.7.5	25,003.61
应收股利		561,289.03
应收申购款		342,405.09
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	46,000.00
资产总计		857,595,126.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		32,938,681.03
应付管理人报酬		778,766.94
应付托管费		171,328.73
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	863,081.65
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	498,554.80
负债合计		35,250,413.15
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	882,200,921.92
未分配利润	6.4.7.10	-59,856,208.26
所有者权益合计		822,344,713.66
负债和所有者权益总计		857,595,126.81

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.932 元，基金份额总额 882,200,921.92 份。国联安双禧 A 中证 100 指数份额 224,488,960.00；国联安双禧 B 中证 100 指数份额 336,733,440.00；国联安双禧中证 100 指数份额 320,978,521.92。

该基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日生效，本报告实际报告期间为：2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日。

6.2 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：2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010 年 4 月 16 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-57,319,538.03

1.利息收入		922,875.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	894,089.72
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		28,786.04
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		875,290.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12.1	-2,899,888.35
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	3,775,178.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-59,265,085.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	147,381.65
减：二、费用		3,730,932.87
1. 管理人报酬		1,982,222.25
2. 托管费		436,088.90
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,164,359.69
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	148,262.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-61,050,470.90

注：该基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日生效，本报告实际报告期间为：2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日。

6.3 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：2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 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）	982,138,897.44	-	982,138,897.44

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-61,050,470.90	-61,050,470.90
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）	-99,937,975.52	1,194,262.64	-98,743,712.88
其中：1. 基金申购款	1,469,471.68	-32,813.21	1,436,658.47
2. 基金赎回款	-101,407,447.20	1,227,075.85	-100,180,371.35
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）	882,200,921.92	-59,856,208.26	822,344,713.66

注：该基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日生效，本报告实际报告期间为：2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：许小松，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

6.4 报表附注

6.4.1 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。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。

本基金于 2010 年 3 月 18 日至 2010 年 4 月 9 日募集，募集资金总额人民币 982,138,906.44 元，其中场外销售人民币 324,434,577.44 元，交易所场内销售人民币 477,687,329.00 元，场内直销人民币 180,017,000.00 元。折合 982,138,906.44 份基金份额。有效认购户数为 8,043 户，其中场外认购户数 3,011 户，交易所场内认购户数 5,025

户，场内直销认购户数 7 户。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了 KPMG-B(2010)CR No. 0017 号验资报告。

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，本基金的投资范围是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%。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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2010 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)均划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(i) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。收到股权分置改革过程中由流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 债券投资

买入交易所或银行间的债券均于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获配日按支付的全部价款确认为债券投资，于权证实际取得日按附注 6.4.4.4(a)(iii)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(b) 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。

(c) 其他金融负债

其他金融负债按公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。对存在活跃市场的金融资产和金融负债，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。当金融资产和金融负债不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、指数收益法、现金流量折现法以及期权定价模型等。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值，另外对金融资产的特殊情况处理如下：

(a) 股票投资

(i) 对因特殊事项长期停牌的股票，如该停牌股票对基金资产净值产生重大影响，则采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。即在估值日，以公开发布的相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率计算该股票当日的公允价值。

(ii) 送股、转增股、配股和公开增发新股等未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同时股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

(iii) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(iv) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同时股票的收盘价估值。

(v) 非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同时股票的收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所上市的同时股票的收盘价估值；若在证券交易所上市的同时股票的收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，其两者之间的差价按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例确认为估值增值。

(b) 债券投资

(i) 交易所上市实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价估值，交易所上市未实行净价列示的债券按估值原则确认的相应交易日的收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

(ii) 对交易所发行未上市的国债、企业债、公司债，按成本估值；对在交易所发行未上市的可转换证券，自债券确认日至上市期间的每个估值日，按证券业协会下证券投资基金估值工作小组公布的参考价格估值。

(iii) 全国银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。对全国银行间债券市场未上市，且中央国债登记结算公司未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(iv) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易，按债券所处市场分别估值。

(c) 权证投资

(i) 首次公开发行未上市的权证, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

(ii) 配售及认购分离交易可转债所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前, 采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量, 则按成本计量。

(iii) 因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可视具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

实际成本与估值的差异计入“公允价值变动收益/(损失)”科目。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时, 申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益, 包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量, 并于年末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除权除息日确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的规定,基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率逐日计提。

根据《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的规定,基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金（包括双禧 100 份额、双禧 A 份额、双禧 B 份额）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 份额与双禧 B 份额的运作，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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内，本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内，本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内，本基金无差错。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《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》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、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：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 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。
- (4) 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 2005 年 6 月 13 日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50% 计算个人所得税。
- (5) 自 2005 年 1 月 24 日起，基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%

的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起, 该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 调整证券(股票)交易印花税税率, 由 0.3%降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 证券交易印花税改为单边征收, 即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1%的税率征收。

(6) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
活期存款	43,487,730.61
定期存款	-
其他存款	-
合计	43,487,730.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2010年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	829,387,176.96	770,122,091.46	-59,265,085.50
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	829,387,176.96	770,122,091.46	-59,265,085.50

6.4.7.3 衍生金融资产

本基金本报告期末未持有衍生金融资产。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所市场	30,000,000.00	-
合计	30,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	9,120.81
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	882.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	15,000.00
应收申购款利息	-
其他	-
合计	25,003.61

注：此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的权证交易保证金的期末应收利息。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	46,000.00
合计	46,000.00

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	863,081.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	863,081.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2010 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	124,140.73
预提信息披露费	55,538.52
审计费	29,231.12
指数使用费	39,644.43
合计	498,554.80

6.4.7.9 实收基金

国联安双禧 A 中证 100 指数

项目	本期 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	263,081,728.00	263,081,728.00
本期申购	412,096.00	412,096.00
本期赎回（以“-”号填列）	- 39,004,864.00	- 39,004,864.00
本期末	224,488,960.00	224,488,960.00

国联安双禧 B 中证 100 指数

项目	本期 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	394,622,592.00	394,622,592.00
本期申购	618,144.00	618,144.00
本期赎回（以“-”号填列）	- 58,507,296.00	- 58,507,296.00
本期末	336,733,440.00	336,733,440.00

国联安双禧中证 100 指数

项目	本期 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	324,434,577.44	324,434,577.44
本期申购	98,981,631.68	98,981,631.68
本期赎回（以“-”号填列）	-102,437,687.20	-102,437,687.20
本期末	320,978,521.92	320,978,521.92

注：1、本基金合同生效日为 2010 年 4 月 16 日，截至 2010 年 6 月 30 日本基金成立未滿半年；

2、本基金在募集期间认购本金 982,043,785.35 元，利息收入 95,112.09 元，折算为 95,112.09 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、国联安双禧 A 中证 100 指数和国联安双禧 B 中证 100 指数的本期申购是指由双禧 100 的“分拆”行为带来的该类基金份额的增加，本期赎回是指因双禧 A 和双禧 B 的“合并”行为导致的该类基金份额的减少。国联安双禧中证 100 指数的本期申购份额包含双禧 A 和双禧 B 的份额合并入的份额 97,512,160.00；本期赎回份额包含双禧 A 和双禧 B 的份额分拆出的份额 1,030,240.00。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,785,385.40	-59,265,085.50	-61,050,470.90
本期基金份额交易产生的变动数	26,165.83	1,168,096.81	1,194,262.64
其中：基金申购款	-870.32	-31,942.89	-32,813.21
基金赎回款	27,036.15	1,200,039.70	1,227,075.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,759,219.57	-58,096,988.69	-59,856,208.26

注：本基金基金合同生效之日 2010 年 4 月 16 日至 6 月 30 日尚未满半年，合同生效日无已实现利润。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	890,804.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,285.55
其他	-
合计	894,089.72

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	98,419,278.48
减：卖出股票成本总额	101,319,166.83
买卖股票差价收入	-2,899,888.35

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期末无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2010年4月16日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,775,178.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,775,178.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2010年4月16日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
1. 交易性金融资产	-59,265,085.50
——股票投资	-59,265,085.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-59,265,085.50

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2010年4月16日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
基金赎回费收入	125,225.81
其他	22,155.84
合计	147,381.65

注：1、本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

2、其他包含场内基金分拆以后多余的份额无法平均分配给基金持有人而计入收入的 9.00 元；基金成立之时的补提一天利息收入 19,642.78 元；基金成立之时给基金持有人利息转份额的利息与实际场内场外结息金额的利差收入 2,504.06 元。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2010年4月16日（基金合同生效日） 至 2010年6月30日
交易所市场交易费用	1,164,359.69
银行间市场交易费用	-
合计	1,164,359.69

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
审计费用		29,231.12
信息披露费		55,538.52
银行划款费用		3,947.96
上市费		19,000.00
其他		900.00
指数使用费		39,644.43
合计		148,262.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	773,029,207.48	75.45%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内与关联方无权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内与关联方无债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内与关联方无债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30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	649,267.44	75.23%	649,267.44	75.23%

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金（按股票成交金额的十万分之三收取）

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金（按股票成交金额的十万分之三收取）

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,982,222.25
其中：支付销售机构的客户维护费	78,595.41

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	436,088.90

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本期间未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金管理人于本期间未持有过本基金，其它关联方于本会计期末未持有本基金。

6.4.10.5 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 2010年4月16日（基金合同生效日）至 2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	43,487,730.61	890,804.17

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

根据《基金合同》的约定，本基金（包括双禧 100 份额、双禧 A 份额、双禧 B 份额）不需进行收益分配。

6.4.12 期末（2010 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，应当承诺获得网下配售的股票持有期限不少于 3 个月，持有期自公开发行的股票上市之日起计算。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2010 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购首发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 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 单 价	数量 (股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
000001	深发展 A	2010-06-30	重大资产重	17.51	-	-	866,067	15,316,464.53	15,164,833.17	-

			组 事 项						
601318	中 国 平 安	2010-06-29	重 大 资 产 重 组 事 项	44.55	-	-	829, 595	39,153,333.87	36,958,457.25

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于

具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	43,487,730.61	-	-	-	-	-	43,487,730.61
结算备付金	2,522,406.61	-	-	-	-	-	2,522,406.61
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	770,122,091.46	770,122,091.46
买入返	30,000,000.00	-	-	-	-	-	30,000,000.00

售金融资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,488,200.40	10,488,200.40
应收利息	-	-	-	-	-	25,003.61	25,003.61
应收股利	-	-	-	-	-	561,289.03	561,289.03
应收申购款	-	-	-	-	-	342,405.09	342,405.09
其他资产	-	-	-	-	-	46,000.00	46,000.00
资产总计	76,010,137.22	-	-	-	-	781,584,989.59	857,595,126.81
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,938,681.03	32,938,681.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	778,766.94	778,766.94
应付托管费	-	-	-	-	-	171,328.73	171,328.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	863,081.65	863,081.65
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	498,554.80	498,554.80
负债总计	-	-	-	-	-	35,250,413.15	35,250,413.15
利率敏感资产	76,010,137.22	-	-	-	-	746,334,576.44	822,344,713.66

感度缺口							
------	--	--	--	--	--	--	--

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照资产及负债的剩余到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
	市场利率下降25个基点	-	-
	市场利率上升25个基点	-	-

注：本基金于 2010 年 6 月末持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	770,122,091.46	93.65
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	770,122,091.46	93.65

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 93.65%、无债券投资和权证投资。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2010 年 6 月 30 日，由于本基金成立时间很短，尚处于建仓初期，因此未以基金与业

绩基准之间的相关性进行市场价格风险的敏感性分析。

7 投资组合报告

7.1 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	770,122,091.46	89.80
	其中：股票	770,122,091.46	89.80
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,000.00	3.50
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	46,010,137.22	5.37
6	其他各项资产	11,462,898.13	1.34
7	合计	857,595,126.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	采掘业	95,970,490.97	11.67
C	制造业	146,403,085.47	17.80
C0	食品、饮料	32,072,697.64	3.90
C1	纺织、服装、皮毛	3,313,839.60	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,652,070.87	1.30
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	40,943,436.69	4.98
C7	机械、设备、仪表	59,421,040.67	7.23

C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	34,240,918.56	4.16
E	建筑业	21,960,624.61	2.67
F	交通运输、仓储业	32,152,406.69	3.91
G	信息技术业	21,397,378.99	2.60
H	批发和零售贸易	13,826,091.00	1.68
I	金融、保险业	360,097,496.94	43.79
J	房地产业	32,744,730.12	3.98
K	社会服务业	4,768,467.00	0.58
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,544,933.11	0.43
	合计	767,106,623.46	93.28

7.2.2 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	采掘业	-	-
C	制造业	1,062,864.00	0.13
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,062,864.00	0.13
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,952,604.00	0.24
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,015,468.00	0.37

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

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	600036	招商银行	3,448,603	44,866,325.03	5.46
2	601318	中国平安	829,595	36,958,457.25	4.49
3	601328	交通银行	5,939,593	35,696,953.93	4.34
4	600016	民生银行	5,249,824	31,761,435.20	3.86
5	601166	兴业银行	1,211,724	27,906,003.72	3.39
6	600000	浦发银行	1,920,642	26,120,731.20	3.18
7	600030	中信证券	2,068,937	24,206,562.90	2.94
8	601601	中国太保	907,795	20,670,492.15	2.51
9	601088	中国神华	919,716	20,206,160.52	2.46
10	000002	万科A	2,699,607	18,303,335.46	2.23
11	601398	工商银行	4,228,297	17,166,885.82	2.09
12	600900	长江电力	1,227,078	15,326,204.22	1.86
13	000001	深发展A	866,067	15,164,833.17	1.84
14	601169	北京银行	1,226,062	14,872,132.06	1.81
15	002024	苏宁电器	1,212,815	13,826,091.00	1.68
16	600519	贵州茅台	105,280	13,408,460.80	1.63
17	601988	中国银行	3,934,522	13,338,029.58	1.62
18	000858	五粮液	543,880	13,178,212.40	1.60
19	600050	中国联通	2,364,231	12,601,351.23	1.53
20	601857	中国石油	1,047,572	10,737,613.00	1.31
21	601628	中国人寿	418,221	10,330,058.70	1.26
22	600837	海通证券	1,125,024	10,192,717.44	1.24
23	600015	华夏银行	864,996	9,618,755.52	1.17
24	600028	中国石化	1,160,873	9,078,026.86	1.10
25	601899	紫金矿业	1,468,755	8,915,342.85	1.08
26	601006	大秦铁路	1,085,381	8,867,562.77	1.08
27	000063	中兴通讯	457,174	8,796,027.76	1.07
28	600019	宝钢股份	1,464,774	8,627,518.86	1.05
29	000983	西山煤电	439,540	7,982,046.40	0.97
30	600547	山东黄金	198,473	7,224,417.20	0.88
31	000651	格力电器	379,983	7,143,680.40	0.87
32	600048	保利地产	638,023	6,526,975.29	0.79
33	601186	中国铁建	858,514	6,181,300.80	0.75
34	601390	中国中铁	1,480,190	6,142,788.50	0.75

35	000527	美的电器	534,676	6,095,306.40	0.74
36	002202	金风科技	388,020	6,033,711.00	0.73
37	600089	特变电工	400,908	5,877,311.28	0.71
38	601668	中国建筑	1,673,012	5,872,272.12	0.71
39	600104	上海汽车	475,420	5,833,403.40	0.71
40	600489	中金黄金	110,297	5,697,943.02	0.69
41	601919	中国远洋	638,888	5,577,492.24	0.68
42	000568	泸州老窖	194,402	5,486,024.44	0.67
43	601766	中国南车	1,095,482	5,280,223.24	0.64
44	000792	盐湖钾肥	133,115	5,191,485.00	0.63
45	600031	三一重工	284,061	5,189,794.47	0.63
46	600795	国电电力	1,528,612	4,998,561.24	0.61
47	601600	中国铝业	534,264	4,899,200.88	0.60
48	601009	南京银行	482,915	4,848,466.60	0.59
49	600585	海螺水泥	297,597	4,794,287.67	0.58
50	000069	华侨城A	433,497	4,768,467.00	0.58
51	600011	华能国际	752,388	4,762,616.04	0.58
52	601111	中国国航	462,801	4,757,594.28	0.58
53	000157	中联重科	284,837	4,628,601.25	0.56
54	000709	河北钢铁	1,242,102	4,608,198.42	0.56
55	601168	西部矿业	465,171	4,554,024.09	0.55
56	600018	上港集团	1,171,749	4,464,363.69	0.54
57	601898	中煤能源	510,291	4,281,341.49	0.52
58	600875	东方电气	92,790	4,041,004.50	0.49
59	000825	太钢不锈	794,467	4,035,892.36	0.49
60	601699	潞安环能	128,337	4,014,381.36	0.49
61	000783	长江证券	363,366	3,924,352.80	0.48
62	002142	宁波银行	348,806	3,843,842.12	0.47
63	601618	中国中冶	938,719	3,764,263.19	0.46
64	600005	武钢股份	874,516	3,751,673.64	0.46
65	000898	鞍钢股份	514,097	3,691,216.46	0.45
66	600832	东方明珠	439,273	3,544,933.11	0.43
67	601998	中信银行	642,526	3,469,640.40	0.42
68	600362	江西铜业	141,180	3,396,790.80	0.41
69	600309	烟台万华	231,809	3,382,093.31	0.41
70	600177	雅戈尔	321,732	3,313,839.60	0.40
71	601666	平煤股份	253,022	3,306,997.54	0.40
72	601958	金钼股份	269,686	3,282,078.62	0.40
73	600009	上海机场	268,558	3,193,154.62	0.39
74	000878	云南铜业	175,344	3,138,657.60	0.38
75	600642	申能股份	403,163	3,104,355.10	0.38

76	600550	天威保变	162,856	3,071,464.16	0.37
77	600320	振华重工	492,149	3,007,030.39	0.37
78	600649	城投控股	346,256	2,967,413.92	0.36
79	600029	南方航空	462,083	2,901,881.24	0.35
80	000024	招商地产	192,090	2,858,299.20	0.35
81	000728	国元证券	226,663	2,753,955.45	0.33
82	600188	兖州煤业	165,215	2,712,830.30	0.33
83	601866	中海集运	709,305	2,390,357.85	0.29
84	000562	宏源证券	162,926	2,386,865.90	0.29
85	600583	海油工程	433,909	2,152,188.64	0.26
86	600688	S 上石化	272,054	2,078,492.56	0.25
87	600150	中国船舶	36,988	2,049,505.08	0.25
88	600208	新湖中宝	424,289	2,023,858.53	0.25
89	600663	陆家嘴	114,846	1,929,412.80	0.23
90	601808	中海油服	165,018	1,825,099.08	0.22
91	000027	深圳能源	182,832	1,740,560.64	0.21
92	601991	大唐发电	194,660	1,341,207.40	0.16
93	601727	上海电气	171,555	1,170,005.10	0.14
94	000046	泛海建设	137,684	1,102,848.84	0.13

7.3.2 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所有股票投资明细

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	601688	华泰证券	100,000	1,283,000.00	0.16
2	601299	中国北车	219,600	1,062,864.00	0.13
3	600999	招商证券	32,600	669,604.00	0.08

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	51,016,182.12	6.20
2	601328	交通银行	43,420,056.58	5.28
3	601318	中国平安	41,957,184.44	5.10
4	600016	民生银行	37,648,342.92	4.58
5	601166	兴业银行	31,794,631.03	3.87
6	600000	浦发银行	30,572,474.89	3.72

7	600030	中信证券	28,441,058.60	3.46
8	601088	中国神华	24,293,858.84	2.95
9	601601	中国太保	22,120,495.08	2.69
10	000002	万 科 A	21,907,301.76	2.66
11	601398	工商银行	19,399,975.06	2.36
12	601169	北京银行	17,206,895.62	2.09
13	000001	深发展 A	16,972,371.65	2.06
14	600900	长江电力	16,811,927.28	2.04
15	601988	中国银行	16,055,311.50	1.95
16	600519	贵州茅台	15,957,833.28	1.94
17	000858	五 粮 液	14,924,606.31	1.81
18	002024	苏宁电器	14,338,154.23	1.74
19	600837	海通证券	13,942,663.67	1.70
20	600050	中国联通	13,524,610.31	1.64

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	5,968,026.35	0.73
2	000402	金 融 街	5,081,755.81	0.62
3	600036	招商银行	5,070,306.60	0.62
4	600016	民生银行	3,648,663.45	0.44
5	600000	浦发银行	3,025,901.05	0.37
6	601333	广深铁路	3,025,833.68	0.37
7	601318	中国平安	2,810,810.52	0.34
8	600010	包钢股份	2,367,873.38	0.29
9	600808	马钢股份	2,350,890.98	0.29
10	601088	中国神华	2,215,733.74	0.27
11	601628	中国人寿	2,180,532.72	0.27
12	000002	万 科 A	2,105,128.96	0.26
13	601166	兴业银行	1,966,524.65	0.24
14	002202	金风科技	1,949,990.48	0.24
15	600547	山东黄金	1,802,953.95	0.22
16	601186	中国铁建	1,783,517.15	0.22
17	000001	深发展 A	1,707,939.93	0.21
18	600900	长江电力	1,630,484.38	0.20
19	600026	中海发展	1,613,896.28	0.20
20	601857	中国石油	1,514,190.70	0.18

7.4.3 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	930,706,343.79
卖出股票的收入（成交）总额	98,419,278.48

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

7.9.2 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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	10,488,200.40
3	应收股利	561,289.03
4	应收利息	25,003.61
5	应收申购款	342,405.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	46,000.00
8	其他	-
9	合计	11,462,898.13

7.9.4 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。

7.9.5.1 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	601318	中国平安	36,958,457.25	4.49	重大资产重组事项

7.9.5.2 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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	3,779	59,404.33	124,373,769.00	55.40%	100,115,191.00	44.60%
国联安双禧 B 中证 100 指数	4,311	78,110.29	164,912,938.00	48.97%	171,820,502.00	51.03%
国联安双禧中证 100 指数	2,866	111,995.30	183,574,815.60	57.19%	137,403,706.32	42.81%
合计	10,956	80,522.17	472,861,522.60	53.60%	409,339,399.32	46.40%

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。

8.2 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	信诚人寿保险有限公司—分红一个险分红	17,587,762.00	7.83%
2	中英人寿保险有限公司	16,269,552.00	7.25%
3	信诚人寿保险有限公司	16,002,160.00	7.13%
4	首创安泰人寿保险有限公司	9,135,651.00	4.07%
5	广发华福证券有限责任公司	8,500,000.00	3.79%
6	中国平安保险（集团）股份有限公司	8,000,720.00	3.56%
7	西安华弘证券经纪有限责任公司	8,000,560.00	3.56%
7	株洲千金药业股份有限公司	8,000,560.00	3.56%
9	华宝信托有限责任公司—集合类资金信托 R2008JH030	8,000,480.00	3.56%
10	中信证券股份有限公司	7,420,296.00	3.31%

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	信诚人寿保险有限公司	24,003,240.00	7.13%
2	合众人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	20,001,560.00	5.94%
3	广发华福证券有限责任公司	17,490,000.00	5.19%
4	上海新永溢投资有限责任公司	12,002,400.00	3.56%
5	中国平安保险（集团）股份有限公司	12,001,080.00	3.56%
6	西安华弘证券经纪有限责任公司	12,000,840.00	3.56%
6	株洲千金药业股份有限公司	12,000,840.00	3.56%
8	华宝信托有限责任公司—集合类资金信托 R2008JH030	12,000,720.00	3.56%
9	李建军	6,000,360.00	1.78%
10	国元证券—农行—国元黄山 1 号限定性集合资产管理计划	6,000,240.00	1.78%
10	国元证券—农行—国元黄山 2 号集合资产管理计划	6,000,240.00	1.78%

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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	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	247,542.25	0.08%
	合计	247,542.25	0.03%

9 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	1,469,471.68
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	101,407,447.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-38,592,768.00	-57,889,152.00	96,481,920.00
本报告期期末基金份额总额	224,488,960.00	336,733,440.00	320,978,521.92

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会决议。

10.2 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	773,029,207.48	75.45%	649,267.44	75.23%	-
华泰证券股份有限公司	1	251,545,884.29	24.55%	213,814.21	24.77%	-

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、上述交易单元均在本报告期内新增。

10.7.2 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	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				的比例
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	110,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金合同生效的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-4-17
2	关于旗下基金增加国金证券为代销机构的公 告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-4-23
3	关于增加注册资本和修改章程的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-4-30
4	办公地址变更公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-5-10
5	关于旗下基金增加东莞证券为代销机构的公 告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-5-10
6	办公地址变更的提示性公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-5-14
7	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	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-5-28
8	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	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-1
9	关于旗下基金参加中信银行个人网上银行申	中国证券报、上海	2010-6-1

	购费率优惠活动的公告	证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	
10	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	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-7
11	关于国联安双禧中证100指数分级证券投资基金之基础份额开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-10
12	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	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-10
13	关于开通国联安双禧中证100指数分级证券投资基金之基础份额跨系统转托管业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-10
14	关于国联安双禧中证100指数分级证券投资基金开通份额配对转换的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-10
15	国联安双禧中证100指数分级证券投资基金之A份额、B份额上市交易提示性公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-18
16	关于国联安双禧中证100指数分级证券投资基金开通部分银行卡网上直销业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-25
17	关于旗下部分基金参加中投证券开放式基金网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-28
18	关于旗下部分基金参加安信证券开放式基金网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-28
19	关于在安信证券推出基金定期定额投资计划的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-28
20	关于旗下部分基金参加交通银行开放式基金	中国证券报、上海	2010-6-30

	网上交易申购费率优惠活动的公告	证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	
21	关于国联安双禧中证100指数分级证券投资基金增加份额配对转换办理机构的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 公司网站和深交所 网站	2010-6-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

2010 年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、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

12.2 存放地点

上海市陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

12.3 查阅方式

网址：<http://www.gtja-allianz.com>、<http://www.vip-funds.com>

国联安基金管理有限公司
二〇一〇年八月二十五日