国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳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：中国光大银行股份有限公司
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2012年8月22日
公告日期：2012年8月17日

一、重要声明与提示

《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳B份额上市交易公告书》（以下简称"本公告书"或"本基金上市交易公告书"）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，国联安双佳信用分级债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人的董事会及董事保证本公告书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书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。

中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）、深圳证券交易所对国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳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。

凡本基金上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅分别在2012年5月3日登载于《中国证券报》、《上海证券报》和国联安基金管理有限公司网站（www.vip-funds.com或www.gtja-allianz.com）、在2012年5月4日登载于《证券时报》的《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

基金简称：国联安双佳信用分级债券；场内简称：国安双佳；基金代码：162511

基金简称：国联安双佳A信用分级债券；场内简称：双佳A；交易代码：162512

基金简称：国联安双佳B信用分级债券；场内简称：双佳B；交易代码：150080

2、基金类型：债券型

3、基金运作方式：契约型

本基金《基金合同》生效之日起3年内，双佳A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次申购与赎回业务，双佳B封闭运作并上市交易；本基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

4、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）《基金合同》生效之日起3年内，本基金的基金份额划分为国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳A份额（简称"双佳A"）和国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳B份额（简称"双佳B"），两者的份额配比原则上不超过7:3。

5、本基金的存续期限：不定期。

6、双佳A、双佳B分别通过各自发售机构的销售网点独立进行公开发售。其中，双佳A通过基金管理人直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售，双佳A份额登记在注册登记系统；双佳B通过场外、场内两种方式公开发售，场外发售的双佳B份额登记在注册登记系统，场内发售的双佳B份额登记在证券登记结算系统。本基金《基金合同》生效之日起3年内，双佳A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次申购与赎回业务；双佳B封闭运作并上市交易。

7、双佳A份额的申购与赎回：双佳A自《基金合同》生效后3年内，每满6个月开放一次申购与赎回业务。本基金办理双佳A的申购与赎回的开放日为自《基金合同》生效后3年内每满6个月的最后一个工作日，开放日的具体计算见《基金合同》第四部分中"双佳A的运作"的相关内容。双佳A的销售机构包括基金管理人直销机构和基金管理人委托的场外代销机构。

双佳B封闭运作，其封闭期为自《基金合同》生效之日起至3年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。双佳B封闭期内不接受申购与赎回申请。

8、基金份额折算：本基金《基金合同》生效之日起3年内，本基金《基金合同》生效之日起每满6个月的最后一个工作日，即与双佳A的开放日为同一个工作日，基金管理人将对双佳A进行基金份额折算（但《基金合同》生效之日起3年内第六个双佳A的开放日双佳A不折算），双佳A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的双佳A份额数按折算比例相应增减。

双佳A的基金份额折算具体见《基金合同》第七部分以及基金管理人届时发布的相关公告。

9、基金份额上市：本基金《基金合同》生效后3年内，在双佳B符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，双佳B的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。双佳B上市后，登记在证券登记结算系统中的双佳B份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的双佳B份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

10、基金份额总额：截止至2012年8月15日，本基金的基金份额总额为1，639，938，116.78份，其中，双佳A为1，147，963，163.91份，双佳B为491，974，952.87份。

11、基金份额净值：截止至2012年8月15日，双佳A的基金份额参考净值为1.010元，双佳B的基金份额参考净值为0.965元。

12、本次上市交易的基金份额简称：双佳B

13、本次上市交易的基金份额（即双佳B）总额：32，833，135.00份

14、本次上市交易的基金份额（即双佳B）交易代码：150080

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：2012年8月22日

17、基金管理人：国联安基金管理有限公司

18、基金托管人：中国光大银行股份有限公司

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

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：经中国证券监督管理委员会证监许可［2012］101号文批准募集

2、基金运作方式：契约型

本基金《基金合同》生效之日起3年内，双佳A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次申购与赎回业务，双佳B封闭运作并上市交易；本基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：自2012年5月7日起至2012年5月29日止

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：双佳A自2012年5月21日至2012年5月29日通过基金管理人直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售，双佳A份额登记在注册登记系统；双佳B自2012年5月7日至2012年5月18日通过场外、场内两种方式公开发售，场外发售的双佳B份额登记在注册登记系统，场内发售的双佳B份额登记在证券登记结算系统。

7、发售机构：

（1）场内发售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（会员单位名单详见深圳证券交易所网站）。

（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：中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、海通证券股份有限公司、中信银行股份有限公司、齐鲁证券有限公司、华福证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司和华融证券股份有限公司。

8、认购费率

本基金不收取认购费用。

9、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况

经毕马威华振会计师事务所验资，本次募集确认的净认购金额为1，639，679，999.60元人民币，折合基金份额1，639，679，999.60份；认购款项在募集期间产生的银行利息共计258，117.18元人民币，折合基金份额258，117.18份；基金发售结束后，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1，639，938，116.78份。

根据本基金《基金合同》、《招募说明书》、《发售公告》等法律文件的有关规定，本基金募集设立时，双佳A、双佳B的份额配比原则上不超过7:3，本基金管理人对双佳B符合相关认购条件和要求的认购申请予以全部确认，对发售期内双佳A的认购申请采用"末日比例配售"的方式予以部分确认，因此，双佳A的基金份额确认为1，147，963，163.91份；双佳B的基金份额确认为491，974，952.87份。

本次募集所有确认的认购资金及银行利息已于2012年5月31日全额划入本基金在基金托管人中国光大银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11、基金备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及本基金《基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，于2012年6月1日验资完毕，2012年6月1日向中国证监会提交了验资报告，已办理完毕基金备案手续，并于2012年6月4日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

12、基金合同生效日：2012年6月4日

13、基金合同生效日的基金份额总额：1，639，938，116.78份，其中，双佳A为1，147，963，163.91份、双佳B为491，974，952.87份。

（二）双佳B上市交易的主要内容

1、本基金的双佳B份额上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上［2012］273号

2、上市交易日期：2012年8月22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（具体会员名单可在深圳证券交易所网站查询，本基金管理人不就此事项进行公告。）。

4、基金简称：国联安双佳B信用分级债券

场内简称：双佳B

5、基金交易代码：150080

6、本次上市交易（即双佳B场内部分）份额为32，833，135.00份（截止至2012年8月15日）

7、基金资产净值的披露：本基金《基金合同》生效后3年内，在双佳B份额上市交易后，基金管理人于每个工作日的次日通过公司网站等媒介披露，该工作日的本基金份额净值、双佳A和双佳B份额的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。双佳B份额的基金份额参考净值在深圳证券交易所行情发布系统同步揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的双佳B份额办理跨系统转托管到场内（证券登记结算系统）后，可以在深圳证券交易所场内上市流通。

（三）关于双佳B份额开通跨系统转托管业务

根据《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同》及相关法律文件的有关规定，双佳B自2012年5月7日至2012年5月18日通过场外、场内两种方式公开发售，场外发售的双佳B份额登记在注册登记系统，场内发售的双佳B份额登记在证券登记结算系统。自基金合同生效之日起3年内，双佳B份额封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回申请，自2012年8月22日起在深圳证券交易所上市交易。上市后，登记在证券登记结算系统中的双佳B份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的双佳B份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

为保护基金份额持有人的利益，向投资者提供更优质的服务，根据本基金《基金合同》的约定，经本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司申请，双佳B自2012年8月22日起开通跨系统转托管业务，场外认购双佳B的基金份额持有人自2012年8月22日起可通过认购双佳B的场外代销机构或本基金管理人直销机构申请办理双佳B跨系统转托管业务，将基金份额转托管至证券登记结算系统。跨系统转托管的具体业务需按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

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

截止至2012年8月15日，基金份额持有人户数：7036户，平均每户持有的基金份额为233，078.19份，其中，双佳A为6781户，平均每户持有的基金份额为169，291.13份；双佳B为255户，平均每户持有的基金份额为1，929，313.54份。

（二）基金份额持有情况

截止至2012年8月15日，双佳B场内基金份额持有情况：机构投资者持有的本次上市交易的双佳B的基金份额为31，003，012.00份，占本次上市交易的双佳B基金份额比例为94.43%；个人投资者持有的本次上市交易的双佳B的基金份额为1，830，123.00份，占本次上市交易的双佳B基金份额比例为5.57%。

（三）场内基金份额前十名持有人情况

截止至2012年8月15日，本次上市交易的双佳B前十名持有人情况具体如下：

序号	持有人名称	持有双佳B份额	占场内总份额的比例
1	嘉禾人寿保险股份有限公司－传统－普通保险	20,001,944.00	60.92%
2	华泰证券－招行－华泰紫金2号集合资产管理	6,000,582.00	18.28%
3	国信－招行－国信金理财收益互换(收益增强	5,000,486.00	15.23%
4	丁霞	210,037.00	0.64%
5	冉娅玲	150,006.00	0.46%
6	陈敏	100,008.00	0.30%
7	韩宗华	100,006.00	0.30%
8	刘传生	100,004.00	0.30%
9	刘承	100,004.00	0.30%
10	庞健敏	100,004.00	0.30%
合计		31,863,081.00	97.03%

（四）基金管理人的从业人员持有本基金的情况

1、截至截止2012年8月15日，本公司基金从业人员持有本基金的情况具体如下：

份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
国联安双佳A信用分级债券	1,993,471.33	0.17%
国联安双佳B信用分级债券	－	－
合计	1,993,471.33	0.12%

2、截至截止2012年8月15日，本公司高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上；本公司基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；

3、截至截止2012年8月15日，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：国联安基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
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
法定代表人：符学东
总经理：邵杰军
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
股东及股权结构：

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

2、内部组织结构及职能

本基金管理人内部共设有养老金与机构理财部、电子商务部、市场发展部、北京办事处、代销部、直销部、国际业务部、产品开发部、投资组合管理部、研究部、量化投资部、债券组合部、基金交易部、专户理财部、综合管理部、财务计划部、基金事务管理部、信息技术部、监察稽核部、风险管理部、人力资源部共二十一个职能部门。

养老金与机构理财部：筹备养老金与机构理财业务；
电子商务部：负责公司网上电子平台的搭建，对高端个人客户直销业务、第三方机构合作销售业务开展、电子商务、客户服务及管理的职能部门；
市场发展部：负责市场策划、与媒体建立并保持良好关系，建立并推广符合公司核心理念的公司形象；对涉及公司和同业的媒体报道进行适时监测；负责设计、制作公司和产品宣传材料、投资者教育材料、媒体广告；
北京办事处：与监管部门协调沟通的部门；
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；
国际业务部：负责公司QDII业务的展开；
产品开发部：负责产品开发和新业务拓展的职能部门；
投资组合管理部：基金的投资决策部门；
研究部：公司的研究支持部门，为基金投资提供决策依据；
量化投资部：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；
债券组合部：负责固定收益产品的投资、研究工作；
基金交易部：公司投资交易的执行部门；
专户理财部：负责专户业务的实施；
综合管理部：负责公司行政管理及后勤保障等工作；
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；
基金事务部：负责基金会计、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；
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：负责人力资源管理的职能部门。

3、人员情况：

截至2012年8月15日，公司共有正式员工106人。

4、信息披露负责人：陆康芸

咨询电话：021-38992888

5、基金管理业务情况简介

截至2012年6月30日，国联安基金管理有限公司旗下共管理17只基金：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、国联安主题驱动股票型证券投资基金、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金、国联安信心增益债券型证券投资基金、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金、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、国联安货币市场证券投资基金、国联安优选行业股票型证券投资基金、国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金、国联安双力中小板综指分级证券投资基金和国联安双佳信用分级债券型证券投资基金。

6、本基金基金经理

黄志钢先生，经济学硕士，曾任海通期货研究员、国元证券股份有限公司衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司，历任数量策略部金融工程分析师、投资管理部基金经理助理。自2012年3月起至今，黄志钢先生担任国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金经理；自2012年6月起至今，黄志钢先生担任国联安双佳分级信用债券型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：唐双宁
成立时间：1992年8月18日
注册资本：404.3479亿元人民币
电话：010-63639157
基金托管部门负责人：陈昌宏
信息披露负责人：石立平
咨询电话：010-63639157

中国光大银行成立于1992年8月，1997年1月完成股份制改造，2010年8月18日，成功完成IPO并在上海证券交易所挂牌上市。2011年末，公司资产规模达到17，333.46亿元；已在26个省、自治区、直辖市的72个经济中心城市设立分支机构689家，形成了全国性银行的经营网络；公司控股的韶山光大村镇银行和光大金融租赁公司经营情况良好，综合化经营成效显现；阳光理财等产品继续为消费者所认可，新兴业务优势明显；坚持多年的母亲水窖公益活动彰显了公司的社会责任，在社会上具有较大影响；品牌建设屡获殊荣。多年来，伴随中国经济和金融业的发展进程，公司不断改革创新、锐意进取，在为社会和客户提供优质金融服务的同时，取得了良好的经营业绩，已成为一家颇具社会影响力的全国性股份制商业银行和运作规范的公众公司。

中国光大银行总行设投资与托管业务部。自2002年10月，获得证券投资基金托管资格，到目前为止，光大银行获得了所有需要监管机构批准的托管业务资格，成为国内托管业务资质最全、托管业务服务领域最广的托管银行之一。2009年，新一代"风险管理与绩效评估系统"上线运行，为光大银行的托管增值服务提供了强大的技术支持平台，投资绩效评估能力已具有业内领先水平。同时，光大银行始终坚持将增值服务理念植入投资合规监督工作。除按照法律法规和托管合同的要求履行托管职责外，还注重总结各类托管产品交易监督经验，逐渐摸索出与投资管理人互动、协作的动态监督机制，不仅提升了服务价值和成果，也进一步提高了光大银行托管业务的风险控制能力。

2、主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任（主持工作），中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长，中国人民银行沈阳市分行副行长、党组副书记，中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记，中国人民银行信贷管理司司长，中国人民银行货币金银局局长，中国人民银行银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记，中国光大银行董事长、党委书记，光大证券股份有限公司董事长，中国光大控股有限公司董事会主席，中国光大国际有限公司董事会主席。

行长郭友先生，历任国家外汇管理局外汇储备业务中心外汇交易部主任，中国投资公司（新加坡）总经理，中国人民银行外资金融机构管理司副司长，中国光大银行副行长，中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理兼中国光大控股有限公司行政总裁，现任中国光大（集团）总公司副董事长、中国光大银行股份有限公司副董事长、行长。

陈昌宏先生，北京大学法学学士、硕士。曾任中共中央联络部干部，四川光大资产管理公司董事、常务副总经理，中国光大银行昆明分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止2012年6月30日，中国光大银行股份有限公司共托管国投瑞银融华债券型基金、摩根士丹利华鑫基础行业基金、国投瑞银景气行业基金、泰信先行策略基金、光大保德信量化核心基金、大成货币市场基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型基金（LOF）、招商安本增利债券型基金、国投瑞银创新动力基金、大成策略回报股票型基金、博时转债增强型债券型基金、中欧新动力股票型基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金等，托管基金资产份额超过400亿元。同时，开展了证券公司集合资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

（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
法定代表人：蔡廷基
经办注册会计师：王国蓓、戴丽
联系电话：021-22122428
传真：021-62881889

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、义务

（1）基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。本基金《基金合同》生效之日起3年内，双佳A、双佳B的基金份额持有人持有的每一份基金份额按照《基金合同》约定在各自份额级别内具有同等的合法权益；本基金《基金合同》生效后3年期届满，转换为上市开放式基金（LOF）后，每份基金份额具有同等的合法权益。

（2）基金份额持有人的权利

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）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9）法律法规、基金合同规定的其他权利。

（3）基金份额持有人的义务

1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
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、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
5）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
6）遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
7）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
8）法律法规及基金合同规定的其他义务。

2、基金管理人的权利、义务

（1）基金管理人的权利

1）依法募集基金，办理基金备案手续；
2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
3）在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则；
4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
8）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；
9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
16）法律法规、基金合同规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

1）依法申请并募集基金，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基金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）按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基金收益；
7）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；
8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
9）依法接受基金托管人的监督；
10）编制季度、半年度和年度基金报告；
11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
12）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
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）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
17）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；
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的合法权益，应承担赔偿责任，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）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

3、基金托管人的权利和义务

（1）基金托管人的权利

1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
2）依照基金合同的约定获得基金托管费；
3）监督基金管理人对本基金的投资运作；
4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

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）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产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）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和独立；
6）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；
7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
9）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以保密，不得向他人泄露；
10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
11）对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，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；如果基金管理人有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；
12）建立并保存基金份额持有人名册；
13）复核审查基金管理人计算的基金资产净值，双佳A份额、双佳B份额及国联安双佳信用债券型证券投资基金份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双佳A份额与双佳B份额终止运作后的份额转换比例和国联安双佳信用债券型证券投资基金份额的申购、赎回价格；
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）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
18）违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
19）因基金管理人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；
20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

（1）本基金《基金合同》生效之日起3年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由双佳A、双佳B的基金份额持有人独立进行表决。双佳A、双佳B的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

（2）本基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；
（2）转换基金运作方式，但本基金在《基金合同》生效后3年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外；
（3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
（4）更换基金管理人、基金托管人；
（5）变更基金类别；
（6）变更基金投资目标、范围或策略；
（7）变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
（8）本基金与其他基金合并；
（9）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
（10）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（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。

本基金《基金合同》生效之日起3年内，依据《基金合同》享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指"单独或合计持有双佳A、双佳B各自的基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人"或其类似表述。

（11）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
（12）法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费率、基金托管费率、销售服务费和其他应由基金承担的费用；
（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
（5）对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；
（6）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

（1）除法律法规或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。

（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）代表基金份额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，代表基金份额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）代表基金份额10%的基金份额持有人就同一事项书面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，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

（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。

（6）基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式；
（2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
（3）代理投票授权委托书送达时间和地点；
（4）会务常设联系人姓名、电话；
（5）权益登记日；
（6）如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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，基金管理人或基金托管人不派代表出席的，不影响表决效力；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构提供的注册登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（本基金《基金合同》生效之日起3年内，指"有效的双佳A和双佳B各自的基金份额分别合计不少于该级基金总份额的50%"）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（本基金《基金合同》生效之日起3年内，指"有效的双佳A和双佳B各自的基金份额分别合计不少于该级基金总份额的50%"）；
4）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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和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；
5）会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

7、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额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。

3）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：

a、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进行解释和说明。

b、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。

4）代表基金份额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，或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，未获得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。

5）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。

（2）议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

8、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。但在本基金《基金合同》生效之日起3年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由双佳A、双佳B的基金份额持有人独立进行表决，且双佳A、双佳B的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应的基金份额级别内享有平等表决权。

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过（本基金《基金合同》生效之日起3年内，指"参加大会的双佳A和双佳B各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上"）。

2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（本基金《基金合同》生效之日起3年内，指"参加大会的双佳A和双佳B各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上"）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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。

9、计票

（1）现场开会

1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，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（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）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中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果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者基金份额持有人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。

4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

（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。

10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

（4）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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关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

1、收益分配原则

（1）本基金《基金合同》生效之日3年内的收益分配原则

本基金《基金合同》生效之日起3年内，本基金的收益分配原则如下：

1）本基金《基金合同》生效之日起3年内，本基金不进行收益分配；
2）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（2）转换为上市开放式基金（LOF）后的收益分配原则

本基金《基金合同》生效后3年期届满，转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的收益分配原则如下：

1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；

2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

场外转入或申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式，如投资者在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式，则按默认的收益分配方式处理；

场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4）每一基金份额享有同等分配权；

5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例等内容。

3、收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

4、收益分配中发生的费用

（1）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

（2）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构可将该基金份额持有人的现金红利按除权日经除权后的基金份额净值转为基金份额。

（四）作为基金管理人、基金托管人报酬的管理费、托管费以及与基金财产管理、运用有关的其他费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.70%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.70%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.20%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

（3）基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金销售服务费仅在基金合同生效起至三年届满日收取，三年届满日后，本基金不收取销售服务费。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.35%÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、不列入基金费用的项目

本条第1款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失不列入基金费用。

3、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会，基金管理人应于新的费率实施日3个工作日前在指定媒体公告。

（五）基金财产的投资方向和投资限制

1、投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）和债券回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与A股股票（包含中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）的新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%；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%。

本基金所指信用债券是指企业债券、公司债券、短期融资券、金融债券（不包括政策性金融债）、次级债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）等非国家信用的固定收益类金融工具。

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。

2、投资禁止行为

（1）禁止用本基金财产从事以下行为：

1）承销证券；
2）向他人贷款或提供担保；
3）从事承担无限责任的投资；
4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
5）向基金管理人、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债券；
6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

3、投资限制

（1）本基金的投资组合将遵循以下限制：

1）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%。
2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券发行数量的10%。
3）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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。
4）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。
5）本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%；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%。
6）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。
7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。
8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金投资的资产支持证券信用级别评级应为BBB以上（含BBB）。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。
9）法律法规的其他限制。

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。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

2、基金资产的估值方法

（1）股票估值方法

1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

3）有明确锁定期股票的估值

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，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

（2）固定收益证券的估值办法

1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

3）未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

4）在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（3）权证估值：

1）配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

2）认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

（4）本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

（5）本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

（6）在任何情况下，基金管理人采用上述1-5项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（7）国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

3、公告方式

《基金合同》生效后，在双佳A的首次开放日或者双佳B上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及双佳A和双佳B的基金份额参考净值。

在双佳A的首次开放或者双佳B上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值、双佳A和双佳B的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值以及双佳A和双佳B的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值、双佳A和双佳B的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

本基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值；基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

（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、基金合同的变更

按照法律法规或本基金合同的规定，基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。以下基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意：

（1）终止基金合同；
（2）转换基金运作方式，但本基金在《基金合同》生效后3年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外；
（3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
（4）更换基金管理人、基金托管人；
（5）变更基金类别；
（6）变更基金投资目标、范围或策略；
（7）变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
（8）本基金与其他基金合并；
（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同的其他事项。
（10）法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更后公布，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费率、基金托管费率、销售服务费和其他应由基金承担的费用；
（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
（4）基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
（5）对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；
（6）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；
（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
（3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

（2）基金财产清算组

1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2）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。

3）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。

（3）清算程序

1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
4）对基金财产进行评估和变现；
5）制作清算报告；
6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
8）对基金财产进行分配。

（4）清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金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。

（5）基金剩余财产的分配

1）本基金在《基金合同》生效之日起3年内清算时的基金清算财产分配

本基金《基金合同》生效之日起3年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，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，将优先满足双佳A的本金及应计收益分配，剩余部分（如有）由双佳B的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

2）转换为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金《基金合同》生效后3年期届满，转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，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。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

（6）基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

（7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

（八）争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

1、本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

2、深圳证券交易所在国联安双佳信用分级债券型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》设定的认购费率或佣金比例用收取认购费。

（二）基金发售后至上市交易公告书公告前的重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前未发生重要财务事项。

（三）基金资产负债表

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金截止2012年8月15日资产负债表（未经审计），具体如下：

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金 2012年8月15日资产负债表	
资产	2012年8月15日
资产	
银行存款	9,918,585.97
结算备付金	7,129,268.44
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	1,748,938,281.18
其中：股票投资	
债券投资	1,748,938,281.18
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	30,695,170.49
应收利息	17,630,310.35
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	1,814,561,616.43
负债和所有者权益	2012年8月15日
负债	
卖出回购金融资产款	179,000,000.00
应付证券清算款	
应付管理人报酬	469,068.42
应付托管费	134,019.56
应付销售费	234,534.20
应付交易费用	6,214.00
应付税费	404,800.00
应付赎回款	
其他负债	346,871.73
负债合计	180,595,507.91
所有者权益	
实收基金	1,639,938,116.78
未分配利润	-5,972,008.26
所有者权益合计	1,633,966,108.52
负债及所有者权益总计	1,814,561,616.43

注：1、报告截止日2012年8月15日，双佳A的基金份额参考净值1.010元，双佳B的基金份额参考净值0.965元。
2、除特别注明外，金额单位为人民币元（下同）。

八、基金投资组合

截止至2012年8月15日，国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的投资组合如下（本报告中财务资料未经审计）：

（一）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		
债券	1,748,938,281.18	96.38
权证		
银行存款及清算备付金	17,047,854.41	0.94
其他资产	48,575,480.84	2.68
合计	1,814,561,616.43	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

本基金于2012年8月15日未持有股票投资。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金于2012年8月15日未持有股票投资。

（四）按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,014,069.80	0.25
2	央行票据		
3	金融债券	69,773.000.00	4.27
	其中：政策性金融债	69,773.000.00	4.27
4	企业债券	1,151,046,093.51	70.44
5	企业短期融资券	389,743,000.00	23.85
6	中期票据		
7	可转债	134,362,117.87	8.22
8	其他		
9	合计	1,748,938,281.18	107.04

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1280182	12津南债	1,000,000	100,540,000.00	6.15
2	126011	08石化债	1,000,000	95,350,000.00	5.84
3	1080011	10萍乡城投债	800,000	81,872,000.00	5.01
4	1280147	12桂林债	700,000	70,882,000.00	4.34
5	1280160	12惠投债	700,000	69,769,000.00	4.27

（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，或在本公告书编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	30,695,170.49
3	应收股利	
4	应收利息	17,630,310.35
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	48,575,480.84

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例
1	110007	博汇转债	8,305,053.90	0.51
2	110011	歌华转债	11,082,204.00	0.68
3	110012	海运转债	2,447,748.40	0.15
4	110013	国投转债	4,471,600.00	0.27
5	110015	石化转债	30,081,000.00	1.84
6	110016	川投转债	14,353,111.50	0.88
7	110017	中海转债	10,542,400.00	0.65
8	113001	中行转债	29,349,000.00	1.80
9	113002	工行转债	18,823,056.00	1.15
10	125089	深机转债	4,906,944.07	0.30

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2012年8月15日未持有股票投资，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

根据《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号<年度报告的内容与格式>》及相关法律法规的规定，除下述事件外，本基金发售后至上市交易公告书公告前未发生的对基金份额持有人有较大影响的重大事件：

2012年6月5日，基金管理人发布国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同生效公告。国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同于2012年6月4日正式生效。

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有重大违规行为，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、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、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佳信用分级债券型证券投资基金募集的文件
（二）《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同》
（三）《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金招募说明书》
（四）《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金托管协议》
（五）关于申请募集国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照
（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
二〇一二年八月十七日