

国联安双禧中证100指数分级证券投资基金

2012 第三季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金产品概况
基金简称:国联安双禧中证100指数分级(场内简称:双禧100)
基金代码:162509
基金运作方式:契约型开放式

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不超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%。

投资策略
本基金采用完全复制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复制标的指数的构成,并根据标的指数的变动进行相应调整。

业绩比较基准
95%\*中证100指数收益率+5%\*活期存款利率(税后)
基金管理人:国联安基金管理有限公司

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧A中证100指数(场内简称:双禧A)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧B中证100指数(场内简称:双禧B)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧C中证100指数(场内简称:双禧C)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧D中证100指数(场内简称:双禧D)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧E中证100指数(场内简称:双禧E)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧F中证100指数(场内简称:双禧F)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧G中证100指数(场内简称:双禧G)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧H中证100指数(场内简称:双禧H)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安双禧I中证100指数(场内简称:双禧I)

4.4 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
2012年第三季度,国内宏观经济没有出现明显改善的态势,通货膨胀率有所回升,投资者所预期的政策放松一波三折。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
截止报告期末,本基金份额净值为80.570元,本报告期份额净值增长率为-6.39%,同期业绩比较基准收益率为-1.05%,本报告期基金份额净值增长率低于业绩比较基准收益率为5.34%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 3,381,808,915.27 94.20

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 7,892,639.64 0.22

5.2.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
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 601318 中国平安 3,743,513 157,002,935.22 4.40

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 160118 民生银行 25,237,200 142,590,180.00 3.99

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

国联安优选行业股票型证券投资基金

2012 第三季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金产品概况
基金简称:国联安优选行业股票
基金代码:257070
基金运作方式:契约型开放式

投资目标
本基金主要投资于流动性周期、企业盈利周期和通货膨胀周期中的景气行业,优选景气行业中具有成长性、高成长性的企业,在控制风险的前提下,努力实现超越业绩比较基准的长期稳定回报。

投资策略
本基金采用自上而下的行业配置和自下而上的个股选择相结合的方法,前瞻性地把握中国经济增长和结构转型过程中行业景气度的变化,以定量分析和定性分析相结合的方法,动态优选不同经济周期中的景气行业,并结合行业投资理念,挖掘行业的成长性个股,获取超额收益。

业绩比较基准
沪深300指数\*80%+上证国债指数\*20%
风险收益特征
较高预期风险,较高预期收益

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
基金简称:国联安优选行业股票

复震荡中呈现下行的趋势。
在操作上,本基金适时减持了周期性行业,基本保持了消费与新型产业为核心的投资组合。在持仓选择上,本基金加大了成长股投资比例,主要集中在个股的选择上。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
截止报告期末,本基金的份额净值增长率为-0.77%,同期业绩比较基准收益率为-5.29%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 534,855,322.33 79.34

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔 17,988,431.98 2.70

5.2.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
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 600519 贵州茅台 159,290 39,153,482.00 5.87

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 160118 民生银行 25,237,200 142,590,180.00 3.99

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。