

## 国联安货币市场证券投资基金

## 【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：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一二年十月二十五日

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中披露的资料均不存在虚假记载、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2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。  
基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策前，应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金名称	国联安货币
基金代码	253050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月26日
报告期末基金份额总额	401,757,735.82份
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理，定性分析与量化分析相结合，力争为投资者提供稳定的收益。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，在严格控制风险的前提下，通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预期，在此基础上，确定组合久期和资产配置比例，把投资组合曲线形状和先风险资产收益进行品种选择，具体包括以下策略： 1. 利率预期策略 2. 收益曲线策略 3. 资产配置策略 4. 现金流管理策略 5. 套利策略 6. 现金选择策略

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	744,323.50
2.本期利润	744,323.50
3.期末基金资产净值	75,352,664.07
4.期末基金份额净值	1.0000
5.期末基金资产净值	75,352,664.07
6.期末基金份额净值	1.0000
7.期末基金资产净值	75,352,664.07
8.期末基金份额净值	1.0000
9.期末基金资产净值	75,352,664.07
10.期末基金份额净值	1.0000

§ 4 基金经理人	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 5 投资组合报告	
序号	项目
1	固定收益投资
2	权益投资
3	资产支持证券
4	其他资产
5	合计
6	报告期末债券回购余额
7	报告期末买入返售金融资产
8	报告期末其他资产
9	报告期末其他资产
10	报告期末其他资产

§ 6 开放式基金份额变动	
项目	金额(元)
报告期初基金份额总额	64,675,700.87
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72
报告期间基金份额总额	170,575,040.72

§ 7 备查文件目录	
序号	文件名称
1	基金合同
2	基金招募说明书
3	基金托管协议
4	基金销售协议
5	基金投资协议
6	基金投资协议
7	基金投资协议
8	基金投资协议
9	基金投资协议
10	基金投资协议

§ 8 基金管理人	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 9 基金托管人	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 10 基金销售机构	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 11 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 12 基金费用	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 13 基金资产	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 14 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 15 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 16 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 17 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 18 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 19 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 20 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 21 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 22 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 23 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 24 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 25 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 26 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 27 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 28 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 29 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 30 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 31 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 32 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 33 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 34 基金业绩	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

## 国联安双佳信用分级债券型证券投资基金

## 【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：中国光大银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一二年十月二十五日

基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中披露的资料均不存在虚假记载、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。  
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。  
基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策前，应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金名称	国联安双佳信用分级债券(场内简称:国安双佳)
基金代码	162511
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2012年6月4日
报告期末基金份额总额	1,639,938,116.78份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动地投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略。可转债投资策略等积极投资策略。在严格控制利率风险、信用风险及流动性风险的基础上,主动管理寻找价值被低估的固定收益类资产,构建及调整固定收益投资组合,以期获得最大化的债券收益;并通过适当参与二级市场权益类品种投资,力争获取超额收益。
风险收益特征	中债综合指数
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
下属二级基金的基金简称	国联安双佳A信用分级债券(场内简称:双佳A)
下属二级基金的交易代码	162512
报告期末下二级基金份额总额	1,147,963,163.91份
报告期末下二级基金份额总额	1,147,963,163.91份
报告期末下二级基金份额总额	1,147,963,163.91份
报告期末下二级基金份额总额	1,147,963,163.91份
报告期末下二级基金份额总额	1,147,963,163.91份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	744,323.50
2.本期利润	744,323.50
3.期末基金资产净值	75,352,664.07
4.期末基金份额净值	1.0000
5.期末基金资产净值	75,352,664.07
6.期末基金份额净值	1.0000
7.期末基金资产净值	75,352,664.07
8.期末基金份额净值	1.0000
9.期末基金资产净值	75,352,664.07
10.期末基金份额净值	1.0000

§ 4 基金经理人	
姓名	职务
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理
王亚伟	基金经理

§ 5 投资组合报告	
序号	项目
1	固定收益投资
2	权益投资
3	资产支持证券
4	其他资产
5	合计
6	报告期末债券回购余额
7	报告期末买入返售金融资产</