

国联安双禧中证100指数分级证券投资基金

2013 第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

重要提示
基金管理人、基金托管人、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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年7月15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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

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:253030
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份
投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)
风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

重要提示
基金管理人、基金托管人、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不受本金损失。

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:253030
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份
投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金

2013 第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

重要提示
基金管理人、基金托管人、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不受本金损失。

基金产品概况
基金简称:国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金
基金代码:253061
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份
投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:一年期银行定期存款税后收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险和收益高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2012年2月22日
报告期末基金份额总额:1,952,207,668.62份

投资策略:在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

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》、《国联安信心增长定期开放债券型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资产,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约定,无损害基金份额持有人的利益行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人遵照相关法律法规和内部规章制度,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到的实施效果与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、投资建议决策等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指令,确保指令价位的相同指令价位不同但由市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析,对投资流程独立稽核。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价反向交易成交较少的单边交易未发现有超过该证券当日成交5%的情况,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易的专项说明
本报告期内未发现有可能会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 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内,国内宏观经济企稳回升,二季度经济数据超预期,3月份和4月份季节性旺季之后,中期预期经济复苏力度减弱,同时受几个月通胀数据持续高于预期,也印证了通胀增长乏力。目前中国经济面临的短期仍然存,在地方债务压力、房地产产业链持续受约,以及进出口贸易受制于汇率和劳动力成本上升,从新一届政府采取的政策来看,结构性改革更为紧迫,而财政政策和货币政策都保持适度中性,即在短期经济疲软的情况下,也没有出现明显宽松。因此,宏观经济可能短期企稳而中期趋势依然偏弱,本基金仍保持支持债券资产。

6月份曾出现资金紧张的局面,也是造成市场情绪悲观的一种表现,结构性变化包括银行体系的改革和监管,因此,即使在经济增速下降,通胀数据低于预期的情况下,货币政策也没有明显放松。在度过6月份的资金紧张之后,下半年资金面或有缓解,但宽松程度难以达到今年第一季度水平,因此,债券收益率水平难有大幅下降,本基金组合资产的持有以国债为主,关注信用风险的变化,并会增强信用资质资产。

本报告期内,国联安信心增长债券A的净值增长率为-1.82%,同期业绩比较基准收益率为0.75%;国联安信心增长债券B的净值增长率为-1.82%,同期业绩比较基准收益率为0.75%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 权益投资
5.1.2 基金投资
5.1.3 固定收益投资
5.1.4 资产支持证券
5.1.5 买入返售金融资产

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末债券品种类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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债券投资明细

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十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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注
5.10.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

5.9.6 开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 国联安定期开放债券A, 国联安定期开放债券B

报告期末基金份额总额: 1,498,995,613.14份
报告期末基金份额总额: 453,212,055.48份

报告期末基金份额总额: 1,498,995,613.14份
报告期末基金份额总额: 453,212,055.48份

7.1 备查文件目录
7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

7.2 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同
7.3 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书
7.4 国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议
7.5 基金管理人业务资格条件和营业执照
7.6 基金托管人业务资格条件和营业执照
7.7 中国证监会要求的其他文件

国联安信心增益债券型证券投资基金

2013 第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

重要提示
基金管理人、基金托管人、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不受本金损失。

基金产品概况
基金简称:国联安信心增益债券型证券投资基金
基金代码:253062
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份
投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

基金合同生效日:2010年6月22日
报告期末基金份额总额:1,301,140,760.68份

投资策略:在控制风险的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准:中证100指数收益率\*55%+活期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。

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》、《国联安信心增益债券型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资产,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约定,无损害基金份额持有人的利益行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人遵照相关法律法规和内部规章制度,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到的实施效果与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、投资建议决策等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指令,确保指令价位的相同指令价位不同但由市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析,对投资流程独立稽核。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价反向交易成交较少的单边交易未发现有超过该证券当日成交5%的情况,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易的专项说明
本报告期内未发现有可能会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 报告期内基金的投资策略