

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：二〇一二年四月二十一日

**S 1 重要提示**  
基金管理人的董事会及监事会在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、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4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、风险收益特征、资产净值、以及重大遗漏。  
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。

本报告期未从他处获得经济利益。  
本报告期内1月1日起至3月31日止。

### S 2 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)

基金主代码 162509

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2010年4月16日

报告期末基金份额总额 3,559,057,611.58份

本基金已进行被动式指数化投资，通过严谨的数据化管理提高投资纪律约束，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%，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法的指数方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照行业的指数成份股或其权重来拟合复制标的指数，并根据拟合的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制跟踪标的指数。本基金力争使基金净值收益率与业绩比较基准之差的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对中证100指数的有效跟踪。

当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，或因某些特殊原因导致指数成分不足时，或因其他原因导致无法有效复制跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和补充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内。

业绩比较基准 95%×中证100指数收益+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

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

国联安双禧A”指100 国联安双禧B”指100 国联安双禧中证100指数(场内简称：双禧 双禧指数(场内简称：双禧100))

A) 1500012 1500013 162509

B) 1,334,942,968.00份 2,002,414,452.00份 221,700,191.58份

C) 低风险低收益 高风险高收益

D) 风险收益特征 均高于货币市场基金和债券型基金。

E) 投资目标 在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

F) 投资策略 本基金综合考虑基金组合的流动性需求，资金安全和投资风险管理的基础上，根据对宏观经济、货币政策、财政政策以及债券市场的股票市场价格相对投资价值和风险的分析，在法规及基金经理对本基金的比例限制内，动态调整现金类资产(债券资产和权益类资产)在基金资产中的配置比例，以达到在较低的较高风险收益。

G) 业绩比较基准 本基金主要采取指数策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发展和利用市场摊派提供的投资机会，实现组合增值。

H) 主要财务指标 本基金属于债券型基金，属于证券市场上低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

I) 基金管理人 国联安基金管理有限公司

J) 基金托管人 中信银行股份有限公司

K) 报告期未出现影响投资者决策的重大事件 本报告期无重大事件。

L) 其他重要事项 本报告期无重大事项。

M) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

N) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

O) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

P) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

Q) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

R) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

S) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

T) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

U) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

V) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

W) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

X) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

Y) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

Z) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

AA) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

BB) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

CC) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

DD) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

EE) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

FF) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

GG) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

HH) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

II) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

JJ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

KK) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

LL) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

MM) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

NN) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

OO) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

PP) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

QQ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

RR) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

SS) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

TT) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

UU) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

VV) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

WW) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

XX) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

YY) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

ZZ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

AA) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

BB) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

CC) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

DD) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

EE) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

FF) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

GG) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

HH) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

II) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

JJ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

KK) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

LL) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

MM) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

NN) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

OO) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

PP) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

QQ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

RR) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

SS) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

TT) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

UU) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

VV) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

WW) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

XX) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

YY) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

ZZ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

AA) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

BB) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

CC) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

DD) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

EE) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

FF) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

GG) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

HH) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

II) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

JJ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

KK) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

LL) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

MM) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

NN) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

OO) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

PP) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

QQ) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

RR) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

SS) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

TT) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

UU) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

VV) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

WW) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

XX) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边交易量未

YY) 报告期内，公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价时间向反向交易成交较少的单边