

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：二〇一四年三月三十一日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本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、完整性承担责任。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资人阅读阅读。

本基金报告期为2013年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

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(场内简称:国联双佳)

基金代码 162631

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2012年6月4日

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

基金类型 债券型基金

基金费率 616,696,763.40%

基金合同存续期 10年

基金募集场所的证券交易场所 深圳证券交易所

上市日期 2012-06-22

基金合同期限 3年定期开放，本基金转换为上市开放式基金(LOP)。

2.2 基金产品说明书

基金产品风险收益特征 在严控信用风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取高于业绩比较基准的稳定回报。

基金投资策略 在严格控制信用风险的前提下，精选具有较高信用级别的企业债、公司债、可转债、短期融资券、资产支持证券等固定收益类品种，构建以信用利差和久期配置策略为基础的债券投资组合，力争在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 中债综合指数

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，其预期风险及预期收益均低于货币市场基金，但高于股票型基金和混合型基金。

下属分级基金的收益分配原则 双佳A、国联安双佳信用分级债(以下简称“双佳B”)两级份额，其中双佳A封闭运作并上市交易；本基金《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封闭运作并暂停上市交易；本基金《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。

风险收益特征 本基金转换为上市开放式基金(LOP)。

2.3 基金管理人员和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 国联安基金管理有限公司 中国光大银行股份有限公司

姓名 陆康君 张建春

信息披露负责人 电话 021-38998086

电子邮箱 customer.service@gl-allianz.com

客户服务电话 021-38787667/4007003635

传真 021-50151582

010-63639132

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 http://www.gla-allianz.com/www.vip-funds.com

基金年度报告备置地点 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号国联大厦9楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1 期间数据和指标 2013年 2012年1月4日至2012年12月31日(基金合同生效日)至2012年12月31日

本期已实现收益 76,650,416.04 22,140,383.62

本期利润 35,015,676.62 21,872,509.65

加权平均基金份额本期利润 0.0345 0.0140

本期基金份额净值增长率为 2.45% 1.34%

3.1.2 期末数据和指标 2013年末 2012年末

期末可供分配基金份额利润 0.0085 -0.0059

期末基金资产净值 623,844,247.36 1,072,960,965.09

期末所有者权益 1,098 0.994

注：1、本基金已实现收益指本基金本周期内收入，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用的余额，本期内实现收益以上期公允价值变动收益、扣除停牌股票按公允价值调整后的余额。2、上述基金绩效指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后即影响基金的收益率。

3、对期末可供分配利润，采取期末资产负债表中列示的分配比例计算。

4、本基金基金合同于2012年6月4日生效，截止报告期末本基金成立不满两年。

5、基金净值的表现

3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率 (%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.16% 0.16% -2.48% 0.10% -0.48% 0.06%

过去六个月 -3.71% 0.15% -4.45% 0.09% 0.83% 0.06%

过去一年 2.45% 0.16% -3.75% 0.08% 6.20% 0.08%

过去三年 - - - - - -

成立以来 3.82% 0.14% -4.86% 0.07% 8.68% 0.07%

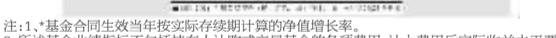
注：1、本基金业绩比较基准为中债综合指数；

2、本基金基金合同于2012年6月4日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月内，建仓期结束时各项比例符合合同约定。

3、上述基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金 累计净值增长率变化率及同期业绩比较基准收益率历史走势图 (2012年6月4日至2013年12月31日)



注：1、基金合同生效后按实际持续期计算的净值增长率。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

3.3.1 基金利润分配情况表

3.3.2 基金利润分配次数及每十份基金份额对应的现金分红金额

3.3.3 基金利润分配政策

3.4 基金管理人报告

3.5 基金经理的声明

3.6 基金管理人对公平交易制度的专项说明

3.7 基金管理人遵照法律法规规定，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”)，并用以规范包括投资研究、研究人员、投资决策、交易执行及投资管理在内的各个环节。

本基金基金管理人建立了健全的公平交易制度，分别对待不同投资组合，确保各投资组合在授权范围内得到公平对待，不因担任基金经理人、投资经理人等职务而给予特殊待遇。本基金基金管理人建立了专门的公平交易制度，对不同投资组合实行公平交易制度，确保各投资组合在授权范围内得到公平对待，不因担任基金经理人、投资经理人等职务而给予特殊待遇。

本基金基金管理人制定了《公平交易制度》，并用以规范包括投资研究、研究人员、投资决策、交易执行及投资管理在内的各个环节。

本基金基金管理人建立了健全的公平交易制度，分别对待不同投资组合，确保各投资组合在授权范围内得到公平对待，不因担任基金经理人、投资经理人等职务而给予特殊待遇。

本基金基金管理人建立了专门的公平交易制度，对不同投资组合实行公平交易制度，确保各投资组合在授权范围内得到公平对待，不因担任基金经理人、投资经理人等职务而给予特殊待遇。

本基金基金管理人制定了《公平交易制度》，并用以