

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：二〇一六年三月二十八日

§ 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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金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2016年3月24日复核了本基金中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人诚挚感谢勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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及其更新。

自2016年3月4日起原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳B份额终止上市，原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金名称变更为国联安双佳信用分级证券投资基金(LOF)。原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金报告期：2015年1月1日至2015年6月5日止，国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)报告期：2015年6月5日至2015年12月31日止。

本年度报告摘要自年度报告正文、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，请投资者注意。

§ 2 基金简介

国联安双佳信用分级证券投资基金(LOF)	
基金简称	国联安双佳
交易代码	360611
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月1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
基金类别	国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)
基金募集期	2009年12月10日至2010年1月15日
基金存续期	2010年6月1日至2015年6月5日
基金规模	500,388,392,995份
基金合同存续期	不定期
基金资产净值的每日变动情况	国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)的份额净值
上一日净值	2015-03-22
下一日基金份额净值	国联安双佳A信用分级债券型证券投资基金(LOF)的份额净值
下一日基金份额净值	X0.10
下一日基金份额总额	102,012
下一日基金份额总金额	10,000.00元
下一日基金份额净值的计算公式	401,074,962,079份

注：双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳B基金份额自2015年6月4日起终止上市。

2.2 基金的基本情况	
基金类型	国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)
投资目标	在控制风险的前提下，通过主动投资于信用等级较高的固定收益类金融工具，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国债、企业债、公司债、可转换债券等信用等级较高的固定收益类金融工具，同时根据宏观和微观环境的变化，适时调整并动态地调整投资比例，以获得最大化的投资收益。
业绩基准	中证国债指数
风险收益特征	本基金为债券基金，属中低风险品种，预期收益高于货币市场基金，低于混合基金和股票基金。
下级基金的风险特征	以信用风险、利率风险、流动性风险、操作风险
基金经理	双佳A：陈晓峰；双佳B：王海峰

2.3 基金管理人和基金托管人	
项目	基金管理人
名称	国联安基金管理有限公司
地址	中国光大银行股份有限公司
法定代表人	陆鸣君
信息披露负责人	021-30930206
电子邮箱	customerservice@qlamchina.com
客户服务电话	021-30746940/000000
传真	021-50510102
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

4.1 信息披露方式

网址：<http://www.gjzq.com.cn>或<http://www.cip-baocai.com>

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 本期数据报告期初

报告期初 2015年03月31日

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)

14,910,940,324.00

本期利润 -0.0001

本年末基金净值 -0.00%

3.1.1.2 本期数据报告期末

报告期末 2015年6月5日

国联安双佳信用分级债券型证券投资基金(LOF)

14,910,940,324.00

本期利润 -0.0001

本年末基金净值 -0.00%

3.1.1.3 本期数据报告期变动情况

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的变动。

2.上述基金业绩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，计入费用后实际收益要低于所列示数字。

3.对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 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

报告期

相对业绩基准

差额 (%)

最近三个季度

最近六个月

最近一年

最近两年

最近五年

最近一个季度

最近一年

最近五年