

**国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金**  
**(原国联安安稳保本混合型证券投资基金转型)**  
**2018年年度报告摘要**  
**2018年12月31日**

**基金管理人：国联安基金管理有限公司**

**基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司**

**送出日期：二〇一九年三月三十日**

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月29日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。

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，应阅读年度报告正文。

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，请投资者注意阅读。

2018年3月12日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自2018年3月20日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效。国联安安稳保本混合型证券投资基金报告期自2018年1月1日至2018年3月19日止，国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金报告期自2018年3月20日至2018年12月31日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	国联安安稳灵活配置混合
基金主代码	002367
交易代码	002367
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 20 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	145,332,424.81 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

基金简称	国联安安稳保本混合
基金主代码	002367
交易代码	002367
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 11 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	393,077,300.92 份
基金合同存续期	至 2019 年 3 月 19 日

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健、具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。</p>

	<p>(1) 定量分析</p> <p>本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析,以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。本基金考察的成长指标主要包括:主营收入增长率、净利润增长率。本基金考察的财务指标主要包括:净资产收益率、资产负债率。本基金考察的估值指标主要包括:市盈率、市盈率/净利增长率。</p> <p>(2) 定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法,综合考察评估公司的经营情况,重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备核心优势、经营稳健的公司,并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司,以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,为各种稳健收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。</p> <p>(2) 期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。</p> <p>子弹组合,即使组合的现金流尽量集中分布;杠铃组合,即使组合的现金流尽量呈两极分布;</p> <p>梯形组合,即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。</p> <p>(3) 债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债等利率债券,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。</p> <p>个券选择:基于各个投资品种具体情况,自下而上的资产配置。</p> <p>个券选择应遵循如下原则:</p> <p>相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。</p>
--	---

	<p>(4) 中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略,在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先,确定经济周期所处阶段,研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响,以确定行业总体信用风险的变动情况,并投资具有积极因素的行业,规避具有潜在风险的行业;其次,对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析;最后,结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素,综合评价私募债的信用风险和流动性风险,选择风险与收益相匹配的品种进行配置。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在买入股票等风险资产时,同时投资以其为标的的看跌期权;或者在买入债券等稳健资产时,同时投资看涨期权,以实现控制下行风险、获取上行收益的目标。</p> <p>本基金将在以上理论框架的基础上,运用期权估值模型,根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势,并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>在股指期货投资上,本基金以避险保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中,将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究现货和期货市场的发展趋势,运用定价模型对其进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合仓位,以降低组合风险、提高组合的运作效率。</p> <p>6、国债期货投资管理</p> <p>本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和量化的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其长期平均预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货

	币市场基金
--	-------

## 2.2.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值
投资策略	本基金以 CPPI 策略为主、TIPP 策略为辅进行资产配置和投资组合管理，其中主要通过 CPPI 策略动态调整固定收益资产与风险资产的投资比例，以确保本基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而在实现基金资产保本的前提下，同时获取投资组合的上行收益。
业绩比较基准	2 年期银行定期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的低风险品种

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	胡波
	联系电话	021-38992888	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### 3.1.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2018年3月20日至2018年12月31日
本期已实现收益	-6,399,639.89
本期利润	-37,115,199.49
加权平均基金份额本期利润	-0.2181
本期基金份额净值增长率	-22.33%
3.1.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2071
期末基金资产净值	115,234,232.12
期末基金份额净值	0.7929

注：1、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影响；

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。

4、截至本报告期末，本基金转型不满一年；

### 3.1.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期 2018年1月1日至2018年 3月19日	2017年	2016年
本期已实现收益	-1,734,593.64	-40,881,117.59	98,300,384.23
本期利润	19,713,927.30	39,023,389.88	-1,630,642.40
加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0133	-0.0005
本期基金份额净值增长率	0.87%	1.40%	-0.20%
3.1.2.2 期末数据和指标	报告期末(2018年3月19 日)	2017年末	2016年末

期末可供分配基金份额利润	0.0130	0.0120	-0.0018
期末基金资产净值	401,248,088.25	2,459,176,690.13	3,406,635,793.09
期末基金份额净值	1.0208	1.0120	0.9980

注：1、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影响；

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

#### 3.2.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

##### 3.2.1.1 自基金转型以来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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.35%	1.59%	-5.41%	0.82%	-4.94%	0.77%
过去六个月	-14.60%	1.49%	-5.83%	0.75%	-8.77%	0.74%
自基金转型日起至今	-22.33%	1.37%	-11.67%	0.69%	-10.66%	0.68%

注：1、2018 年 3 月 12 日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自 2018 年 3 月 20 日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

2、本基金的业绩比较基准自 2018 年 3 月 20 日起变更为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%；

3、截至本报告期末，本基金转型不满一年；

4、上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要低于所列数字。

##### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2018 年 3 月 20 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：1、2018 年 3 月 12 日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自 2018 年 3 月 20 日（即保本到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

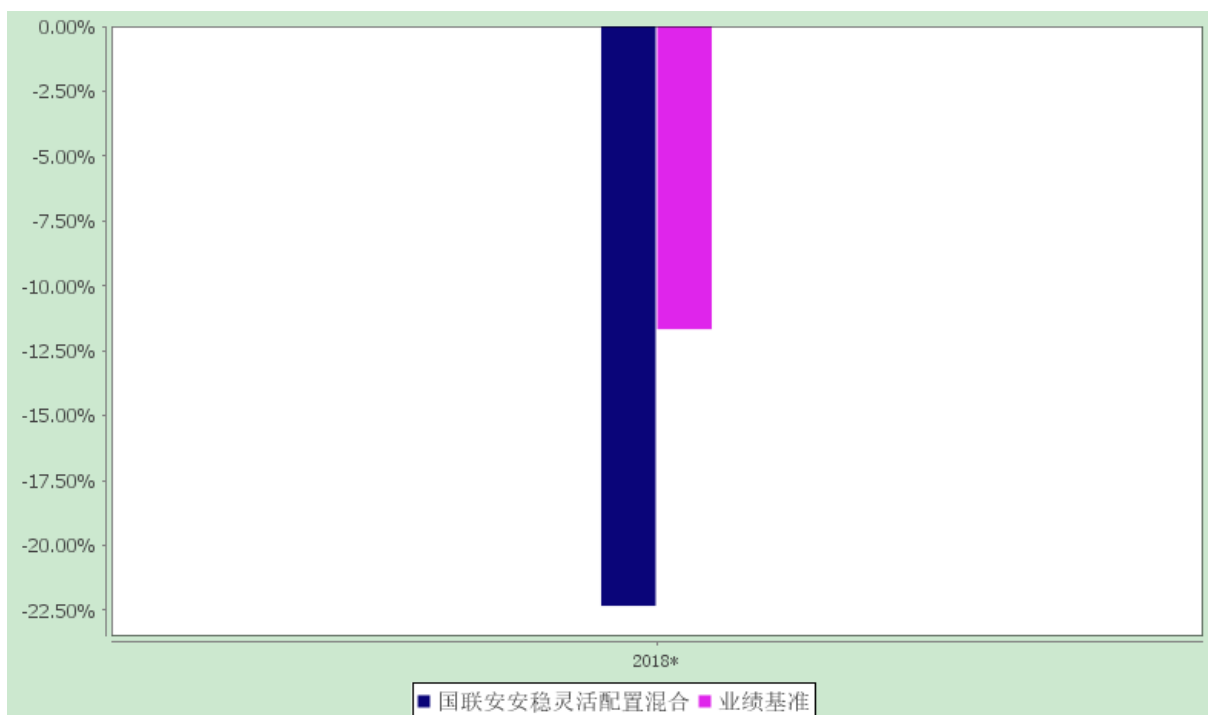
2、本基金的业绩比较基准自 2018 年 3 月 20 日起变更为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 50\% + \text{上证国债指数收益率} \times 50\%$ ；

3、截至本报告期末，本基金转型不满一年。本基金的投资转型期为自本基金转型日起的 6 个月，投资转型期结束时各项资产配置符合合同约定；

4、上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要低于所列数字。

### 3.2.1.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金  
 自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、2018 年 3 月 12 日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自 2018 年 3 月 20 日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

2、\*基金转型当年按实际存续期计算的净值增长率；

3、上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要低于所列数字。

### 3.2.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

#### 3.2.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日	0.87%	0.05%	0.45%	0.01%	0.42%	0.04%
自基金合同生效（2016 年 3 月 11 日）起至基金转型日前一日（2018 年 3	2.08%	0.08%	4.25%	0.01%	-2.17%	0.07%

月 19 日)						
---------	--	--	--	--	--	--

注：1、2018年3月12日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自2018年3月20日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

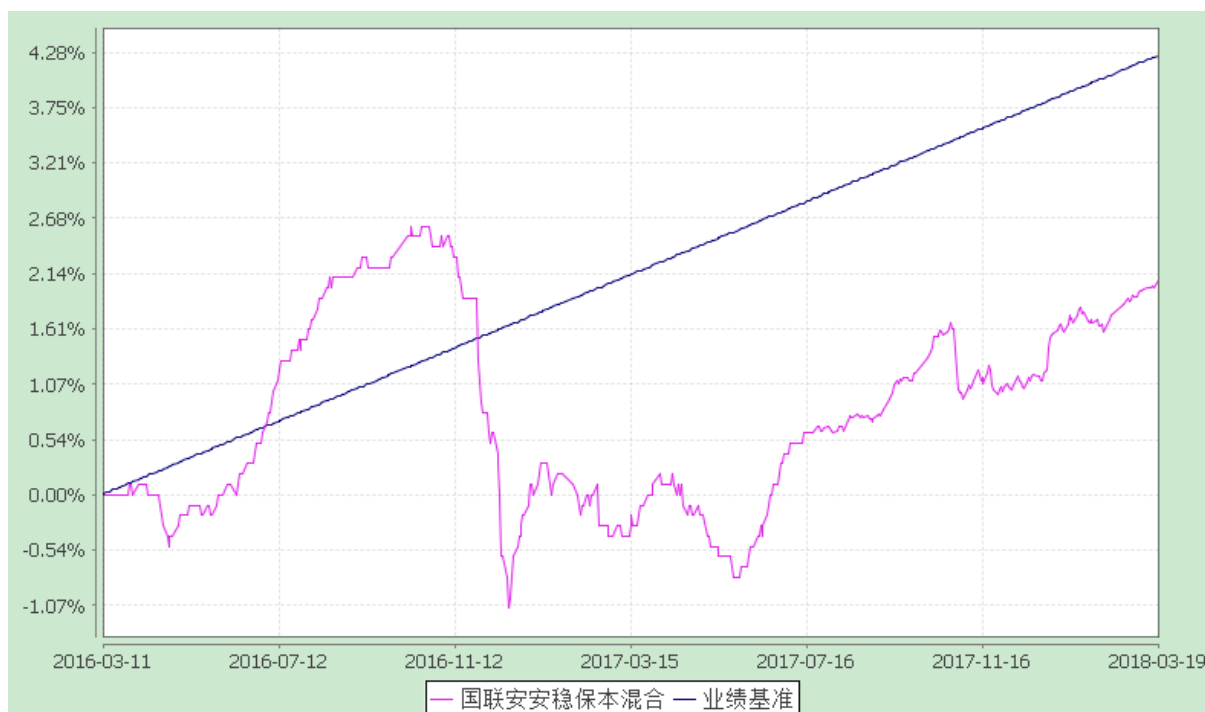
2、国联安安稳保本混合型证券投资基金的业绩比较基准为：2年期银行定期存款基准利率（税后）；

3、上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要低于所列数字。

### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 国联安安稳保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016年3月11日至2018年3月19日)



注：1、国联安安稳保本混合型证券投资基金（以下简称“安稳保本”）的业绩比较基准为：2年期银行定期存款基准利率（税后）；

2、国联安安稳保本混合型证券投资基金的基金合同于2016年3月11日生效，建仓期为自基金

合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

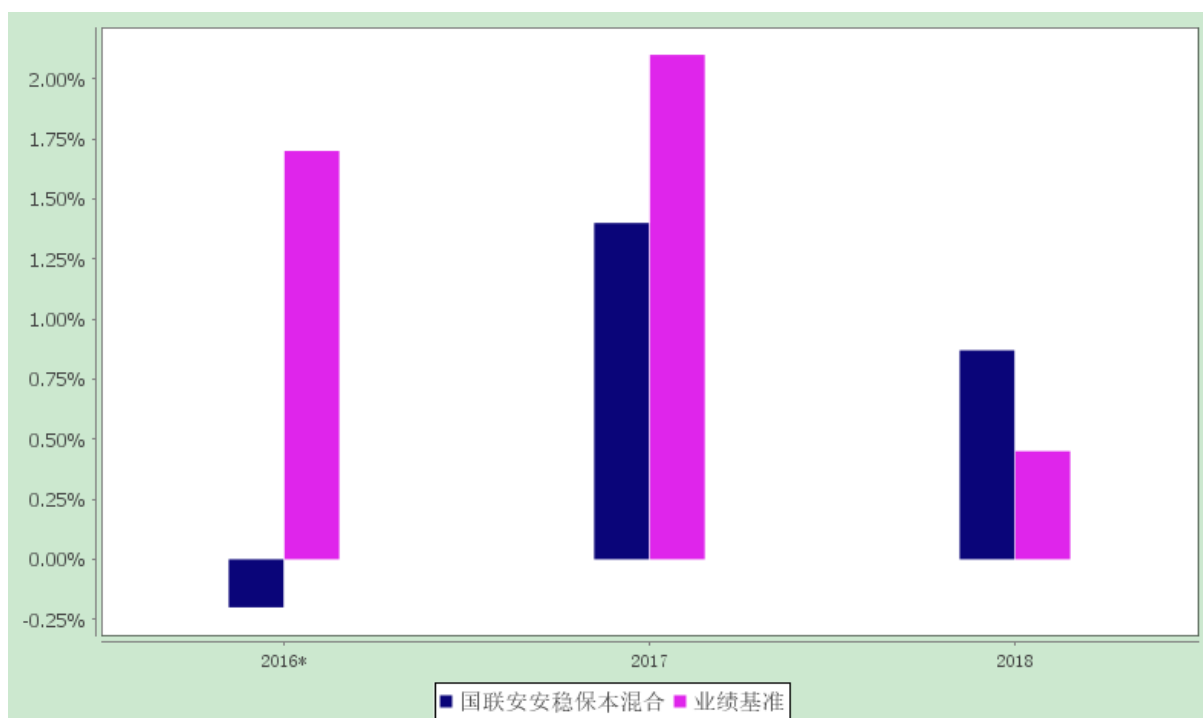
3、2018 年 3 月 12 日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自 2018 年 3 月 20 日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

4、上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要低于所列数字。

### 3.2.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 国联安安稳保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、2018 年 3 月 12 日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自 2018 年 3 月 20 日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

2、\*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

3、上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要低于所列数字。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 3.3.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

本基金本报告期内未实施利润分配。本基金基金合同于 2018 年 3 月 20 日生效，截至报告期末不满一年。

#### 3.3.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

本基金过去三年未实施利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理四十只开放式基金。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈丹	本基金基金经理、兼任国联安鑫乾混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫隆混合型证券投资基金基金经理、国联安保本混合型证券投资基金基金经理、国联安双佳信用债券型证券投资基金	2017-09-26	2018-11-06	8年（自2010年起）	沈丹女士，硕士研究生。2010年8月至2015年2月在中国人保资产管理股份有限公司担任交易员；2015年3月至2017年2月在江苏常熟农村商业银行股份有限公司任投资经理。2017年3月加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2017年8月至2018年11月兼任国联安鑫乾混合型证券投资基金和国联安鑫隆混合型证券投资基金的基金经理，2017年8月至2018年6月兼任国联安鑫怡混合型证券投资基金的基金经理，2017年9月至2018年

	基金经理、国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。				11月兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年9月起兼任国联安保本混合型证券投资基金的基金经理，2018年7月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）的基金经理，2018年11月起兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。
邹新进	本基金基金经理、兼任国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理、国联安价值优选股票型证券投资基金基金经理、权益投资部总经理。	2018-03-20	-	14年(自2004年起)	邹新进先生，硕士研究生。2004年7月至2007年7月在中信建投证券有限责任公司（前身为华夏证券有限责任公司）担任分析师。2007年7月加入国联安基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、研究部副总监，现任权益投资部总经理。2010年3月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金的基金经理，2012年2月至2013年4月兼任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理，2018年3月起兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年9月20日起兼任国联安价值优选股票型证券投资基金的基金经理。
王超伟	本基金基金经理助理。	2016-01-13	-	10年（自2008年起）	-

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《国联安安稳保本混合型证券投资基金》（基金转型前）、《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（基金转型后）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财产，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规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，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。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部对银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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、投资建议和投资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；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，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等。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5%的情况。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的不同投资组合同向交易的

交易价差进行了分析, 执行了 95%置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验, 同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析, 未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

对于中国股市来说, 2018 年是非常困难的一年, 是内忧外患的一年。除了一月份市场延续 2017 年走势有所表现外, 二月份开始在国内外风险事件频发下市场整体大跌, 特别是五月下旬之后, 随着金融去杠杆(内因)的持续推进, 债券违约事件频发, 民营经济的资金流动性出现巨大危机; 加上中美贸易摩擦(外因)加剧, 市场对中国经济的中长期基本面产生信任危机, 整体市场情绪急转直下, 大盘连续下探低点。直到年底, 随着中央一系列会议的纠偏和应对, 市场才有所企稳。结构上, 大小盘分化仍然严重, 以上证 50 为代表的大市值股票因有国家信用的背书成为市场资金的避难所, 相对抗跌; 而大部分中小市值公司股值则大幅下挫。

本基金在一季度由原保本基金转型为灵活配置混合型基金, 并在二季度内完成建仓。在行业配置上, 本基金重点以稳定的医药板块为主, 并较大力度的参与了集中度提升的家居、地产、农化等板块以及新材料等新兴板块, 同时适度配置了低估值的周期类板块。由于仓位相对较高, 基金报告期内收益一般。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金转型日起至本报告期末(2018 年 3 月 20 日至 2018 年 12 月 31 日), 本基金的份额净值增长率为-22.33%, 同期业绩比较基准收益率为-11.67%。

自本报告期初起至本基金转型日前一日(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日), 原国联安安稳保本混合型证券投资基金的份额净值增长率为 0.87%, 同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年, 本基金认为宏观基本面下行已经是普遍预期, 但稳增长的逆周期政策效果和改革的力度可能会超出预期。中央经济工作会议提出的“促进形成强大国内市场”可能会越来越现实, 外



部的影响也将会变弱。另一方面，中美贸易摩擦将是“持久战”，2019年市场将会更加理性的看待这个问题；换一个角度看，这也将对中国进一步的改革开放提供倒逼的压力。而目前A股估值已处于历史底部区域，科创板的加速推进也将带来风险偏好的提升。所以，本基金认为当前是中长期投资的较好位置。

在行业配置上，本基金将从性价比的角度出发，重点关注集中度提升同时估值相对较低的医药流通、地产、农化等板块；同时，鉴于预期2019年风险偏好的提升和科创板等证券市场制度的创新，将适时适度配置部分科技成长板块（5G、部分化工新材料等）和券商板块。

本基金坚信，通过勤勉尽职的工作，持续挖掘优质上市公司进行长期投资，本基金将努力为基金持有人带来一定的中长期投资回报，来分享中国经济持续快速成长的成果。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员1/2以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国联安安稳保本混合型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金(由“国联安安稳保本混合型证券投资

基金”转型而来)的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对国联安安稳保本混合型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金(由“国联安安稳保本混合型证券投资基金”转型而来)的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

### 6.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2018年12月31日的资产负债表、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,注册会计师王国蓓、钱茹雯签字出具了毕马威华振审字第1900076号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### 6.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2018年3月19日的资产负债表、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,注册会计师王国蓓、钱茹雯签字出具了毕马威华振审字第1900060号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

7.1.1 资产负债表

会计主体：国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日
资产：	-
银行存款	8,970,247.60
结算备付金	7,463.64
存出保证金	32,551.59
交易性金融资产	106,632,064.90
其中：股票投资	106,611,544.90
基金投资	-
债券投资	20,520.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	256,520.40
应收利息	4,783.02
应收股利	-
应收申购款	2,141.97
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>115,905,773.12</b>
	<b>本期末 2018年12月31日</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
负债：	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	157,071.02

应付管理人报酬	153,059.85
应付托管费	25,509.97
应付销售服务费	-
应付交易费用	20,896.59
应交税费	3.44
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	315,000.13
<b>负债合计</b>	<b>671,541.00</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>
实收基金	145,332,424.81
未分配利润	-30,098,192.69
<b>所有者权益合计</b>	<b>115,234,232.12</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>115,905,773.12</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7929 元，基金份额总额 145,332,424.81 份。

### 7.1.2 利润表

会计主体：国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 20 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2018 年 3 月 20 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-34,284,110.05</b>
1.利息收入		488,449.10
其中：存款利息收入	<b>7.1.4.7.11</b>	294,892.88
债券利息收入		71,189.68
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		122,366.54
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,058,122.92
其中：股票投资收益	<b>7.1.4.7.12</b>	-6,268,731.25
基金投资收益		-
债券投资收益	<b>7.1.4.7.13</b>	-1,290.69
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	<b>7.1.4.7.14</b>	-

股利收益	<b>7.1.4.7.15</b>	2,211,899.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	<b>7.1.4.7.16</b>	-30,715,559.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	<b>7.1.4.7.17</b>	1,123.37
<b>减：二、费用</b>		<b>2,831,089.44</b>
1. 管理人报酬		1,842,880.83
2. 托管费		307,146.79
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	<b>7.1.4.7.18</b>	408,002.84
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		7.12
7. 其他费用	<b>7.1.4.7.19</b>	273,051.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-37,115,199.49</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-37,115,199.49</b>

### 7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 20 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	393,077,300.92	8,170,787.33	401,248,088.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-37,115,199.49	-37,115,199.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-247,744,876.11	-1,153,780.53	-248,898,656.64
其中：1.基金申购款	8,559,696.06	-269,356.75	8,290,339.31
2.基金赎回款	-256,304,572.17	-884,423.78	-257,188,995.95
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	145,332,424.81	-30,098,192.69	115,234,232.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孟朝霞，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 基金基本情况

国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由国联安安稳保本混合型证券投资基金转型而成。国联安安稳保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准国联安安稳保本混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]3157 文)批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安安稳保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 3 月 11 日生效。根据《国联安安稳保本混合型证券投资基金基金合同》和《国联安安稳保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，本基金于 2018 年 3 月 19 日第一个保本周期届满，自 2018 年 3 月 20 日起转型为非保本的混合型基金，基金名称变更为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”。转型后的《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金转型后首日基金规模为 393,077,300.92 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》的有关规定，本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%，在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **7.1.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### **7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.1.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、自 2018 年 3 月 20 日(转型后首日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.1.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.1.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **7.1.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### **7.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### **7.1.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务

总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

- (d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所



得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日 (含) 以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.1.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司 (“太平洋资管”)	基金管理人的股东 (自 2018 年 5 月 4 日起)
国泰君安证券股份有限公司 (“国泰君安”)	基金管理人的股东 (截止至 2018 年 5 月 3 日)、基金销售机构
安联集团	基金管理人的股东

注：自 2018 年 5 月 4 日起，本基金管理人的控股股东由国泰君安证券股份有限公司变更为太平洋资产管理有限责任公司，因此自 2018 年 5 月 4 日起，国泰君安证券股份有限公司不再属于本基金的关联方。

#### 7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期内所披露的与国泰君安证券股份有限公司之间的关联方交易均为发生在截至 2018 年 5 月 3 日止期间的交易，所披露的与太平洋资产管理有限责任公司之间的关联方交易均为发生在自 2018 年 5 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日止期间的交易。

##### 7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.1.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 7.1.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 7.1.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 7.1.4.8.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

#### 7.1.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内无应支付关联方的佣金。

#### 7.1.4.8.2 关联方报酬

##### 7.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月20日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,842,880.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,000,837.11

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

##### 7.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月20日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	307,146.79

注：支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金。

##### 7.1.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

#### 7.1.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月20日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	8,970,247.60	246,855.35

注：本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2018 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 7,463.64 元。

#### 7.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.1.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.1.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### 7.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.1.4.10.1 公允价值

###### 7.1.4.10.1.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 106,611,544.90 元，第二层次的余额为人民币 20,520.00 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.1.4.10.1.2 其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

7.2.1 资产负债表

会计主体：国联安安稳保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 3 月 19 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 3 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日-
资产：	-	-
银行存款	158,416,515.42	4,258,261.09
结算备付金	866,738.25	5,022,795.43
存出保证金	73,984.21	57,695.23
交易性金融资产	168,311,930.00	2,445,057,629.42

其中：股票投资	11,831,000.00	74,744,211.36
基金投资	-	-
债券投资	156,480,930.00	2,370,313,418.06
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	188,000,000.00	-
应收证券清算款	32,019,769.90	3,864,346.46
应收利息	4,383,790.53	36,489,500.67
应收股利	-	-
应收申购款	-	308.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>552,072,728.31</b>	<b>2,494,750,536.56</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018年3月19日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日-</b>
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	25,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	149,408,938.68	7,227,367.42
应付管理人报酬	926,747.60	2,529,227.62
应付托管费	154,457.93	421,537.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	136,123.01	13,667.55
应交税费	20,862.30	-
应付利息	-	-8,913.37
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	177,510.54	390,959.25
<b>负债合计</b>	<b>150,824,640.06</b>	<b>35,573,846.43</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	393,077,300.92	2,430,118,118.00
未分配利润	8,170,787.33	29,058,572.13
<b>所有者权益合计</b>	<b>401,248,088.25</b>	<b>2,459,176,690.13</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>552,072,728.31</b>	<b>2,494,750,536.56</b>

注：报告截止日 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日)，基金份额净值 1.0208 元，基金份额总额 393,077,300.92 份。

## 7.2.2 利润表

会计主体：国联安安稳保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日-
<b>一、收入</b>		<b>26,967,356.28</b>	<b>90,795,966.94</b>
1.利息收入		22,632,164.34	149,091,110.59
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	825,699.96	1,213,180.60
债券利息收入		19,507,330.00	147,279,953.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,299,134.38	597,976.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,377,074.48	-140,173,453.67
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	28,199,275.00	21,000,967.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.2.4.7.13	-45,548,579.03	-161,838,495.35
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.2.4.7.14	-	-
股利收益	7.2.4.7.15	-27,770.45	664,074.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	21,448,520.94	79,904,507.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	263,745.48	1,973,802.55
<b>减：二、费用</b>		<b>7,253,428.98</b>	<b>51,772,577.06</b>
1. 管理人报酬		5,629,003.60	35,463,002.49
2. 托管费		938,167.26	5,910,500.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.2.4.7.18	240,821.45	256,907.51
5. 利息支出		331,474.57	9,726,672.32
其中：卖出回购金融资产支出		331,474.57	9,726,672.32
6. 税金及附加		20,162.17	-

7. 其他费用	7.2.4.7.19	93,799.93	415,494.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>19,713,927.30</b>	<b>39,023,389.88</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>19,713,927.30</b>	<b>39,023,389.88</b>

### 7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安安稳保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年3月19日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3月19日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,430,118,118.00	29,058,572.13	2,459,176,690.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,713,927.30	19,713,927.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,037,040,817.08	-40,601,712.10	-2,077,642,529.18
其中：1.基金申购款	122,199.45	2,055.70	124,255.15
2.基金赎回款	-2,037,163,016.53	-40,603,767.80	-2,077,766,784.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	393,077,300.92	8,170,787.33	401,248,088.25
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,412,610,670.63	-5,974,877.54	3,406,635,793.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,023,389.88	39,023,389.88

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-982,492,552.63	-3,989,940.21	-986,482,492.84
其中：1.基金申购款	540,045.34	927.72	540,973.06
2.基金赎回款	-983,032,597.97	-3,990,867.93	-987,023,465.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,430,118,118.00	29,058,572.13	2,459,176,690.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孟朝霞，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 基金基本情况

国联安安稳保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准国联安安稳保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可 [2015] 3157 文）批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安安稳保本混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 3 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 3,702,040,228.17 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安安稳保本混合型证券投资基金基金合同》和《国联安安稳保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，主要分为稳健资产和风险资产。稳健资产主要包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中小企业私募债、中期票据、可转换债券、可分离债券、次级债、债券回购、短期融资券（含超级短期融资券）、国债期货、资产支持证券、银行存款以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具、货币市场工具及现金。风险资产主要包括股票、权证(含期权)以及股指期货等权益类品种。本基金的投资组合比例为：风险资产占基金资产的比例不高于 40%；稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不



低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：2 年期银行定期存款基准利率（税后）。

根据《国联安安稳保本混合型证券投资基金基金合同》和《国联安安稳保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，本基金于 2018 年 3 月 19 日第一个保本周期届满，自 2018 年 3 月 20 日起转型为非保本的混合型基金，基金名称变更为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **7.2.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

本基金自 2018 年 3 月 20 日起转型为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，存续期为不定期，因此本财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

#### **7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.2.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日)的财务状况、自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.2.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **7.2.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴

20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.2.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东、基金销售机构
安联集团	基金管理人的股东

#### 7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.2.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年3月19日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	-	-	43,079,557.65	33.53%

##### 7.2.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年3月19日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债

		券成交总 额的比例		券成交总 额的比例
国泰君安	204,337,331.24	86.36%	362,804,423.42	68.20%

注：“占当期债券成交总额的比例”中当期债券成交总额取1月1日至12月31日数据，下同。

#### 7.2.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年3月19日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例
国泰君安	-	-	32,296,491,000.00	70.11%

#### 7.2.4.8.1.4 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 7.2.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年3月19日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	39,516.36	33.46%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从国泰君安获得证券研究综合服务。

#### 7.2.4.8.2 关联方报酬

##### 7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年3月19日	2017年1月1日至2017年12月31日-
当期发生的基金应支付的管理费	5,629,003.60	35,463,002.49
其中：支付销售机构的客户维护费	1,727,967.39	12,066,561.54

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年3月19日	2017年1月1日至2017年12月31日-
当期发生的基金应支付的托管费	938,167.26	5,910,500.36

注：支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未持有过本基金。

##### 7.2.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 7.2.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年3月19日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	158,416,515.42	813,889.86	4,258,261.09	821,497.36

注：本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2018 年 3 月 19 日（保本周期届满日）的相关余额为人民币 866,738.25 元。（2017 年 12 月 31 日余额：人民币 5,022,795.43 元）

#### **7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### **7.2.4.9 期末（2018年3月19日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日),本基金未有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

##### **7.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

于 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

于 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日),本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### **7.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 3 月 19 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元,因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### **7.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **7.2.4.10.1 公允价值**

###### **7.2.4.10.1.1 以公允价值计量的资产和负债**

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 11,831,000.00 元，第二层次的余额为人民币 156,480,930.00 元，无属于第三层次的余额 (2017 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 76,061,019.61 元，第二层次的余额为人民币 2,368,996,609.81 元，无属于第三层次的余额)。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 3 月 19 日(保本周期届满日)，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2017 年 12 月 31 日：无)。

**7.2.4.10.1.2 其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)**

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**§8 投资组合报告**

**8.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金**

**8.1.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	106,611,544.90	91.98
	其中：股票	106,611,544.90	91.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,520.00	0.02
	其中：债券	20,520.00	0.02
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,977,711.24	7.75
8	其他各项资产	295,996.98	0.26
9	合计	115,905,773.12	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

## 8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,543,600.00	3.08
C	制造业	48,214,617.00	41.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,727.90	0.05
F	批发和零售业	24,958,300.00	21.66
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	12,233,600.00	10.62
K	房地产业	14,787,900.00	12.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,812,800.00	2.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	106,611,544.90	92.52



注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 8.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

### 8.1.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600511	国药股份	440,000	10,230,000.00	8.88
2	000028	国药一致	220,000	9,116,800.00	7.91
3	600048	保利地产	660,000	7,781,400.00	6.75
4	600486	扬农化工	200,000	7,532,000.00	6.54
5	000671	阳光城	1,350,000	7,006,500.00	6.08
6	002142	宁波银行	330,000	5,352,600.00	4.64
7	000910	大亚圣象	460,000	4,742,600.00	4.12
8	600997	开滦股份	835,100	4,735,017.00	4.11
9	002191	劲嘉股份	600,000	4,686,000.00	4.07
10	601688	华泰证券	280,000	4,536,000.00	3.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600511	国药股份	14,665,909.06	12.73
2	000910	大亚圣象	13,943,338.74	12.10
3	600486	扬农化工	10,949,041.00	9.50
4	000671	阳光城	10,294,825.00	8.93
5	002643	万润股份	9,552,542.00	8.29
6	600048	保利地产	8,840,373.00	7.67
7	000028	国药一致	8,632,729.72	7.49
8	000001	平安银行	8,361,480.00	7.26
9	300054	鼎龙股份	8,127,762.00	7.05
10	000400	许继电气	7,978,011.00	6.92
11	002142	宁波银行	7,865,390.00	6.83
12	600380	健康元	7,536,000.00	6.54

13	601600	中国铝业	6,825,000.00	5.92
14	000425	徐工机械	5,855,000.00	5.08
15	002191	劲嘉股份	5,798,700.00	5.03
16	600713	南京医药	5,604,080.00	4.86
17	002159	三特索道	5,500,090.76	4.77
18	600997	开滦股份	5,170,600.00	4.49
19	601699	潞安环能	5,149,024.00	4.47
20	000513	丽珠集团	5,136,274.00	4.46
21	601688	华泰证券	4,979,801.00	4.32
22	000902	新洋丰	4,794,647.00	4.16
23	002572	索菲亚	4,779,700.00	4.15
24	002022	科华生物	4,129,880.76	3.58
25	000639	西王食品	3,939,728.22	3.42
26	600188	兖州煤业	3,931,698.09	3.41
27	601788	光大证券	3,761,950.00	3.26
28	603686	龙马环卫	3,674,400.00	3.19
29	600337	美克家居	3,499,774.40	3.04
30	601168	西部矿业	3,455,756.00	3.00
31	600406	国电南瑞	3,417,993.80	2.97
32	600019	宝钢股份	3,201,336.53	2.78
33	600567	山鹰纸业	2,983,000.00	2.59
34	002366	台海核电	2,834,757.00	2.46

#### 8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300054	鼎龙股份	8,916,920.00	7.74
2	000400	许继电气	6,673,063.00	5.79
3	000001	平安银行	4,880,650.00	4.24
4	002572	索菲亚	4,454,764.00	3.87
5	000910	大亚圣象	4,372,382.00	3.79
6	002643	万润股份	4,198,862.50	3.64
7	600380	健康元	3,904,974.00	3.39
8	603686	龙马环卫	3,768,732.00	3.27
9	600406	国电南瑞	3,425,102.00	2.97
10	600188	兖州煤业	3,334,212.00	2.89
11	600019	宝钢股份	3,304,007.32	2.87
12	601788	光大证券	3,185,100.00	2.76
13	600567	山鹰纸业	2,798,500.00	2.43
14	601699	潞安环能	2,656,863.00	2.31
15	002159	三特索道	2,627,101.24	2.28

16	601600	中国铝业	2,178,000.00	1.89
17	600486	扬农化工	1,992,093.00	1.73
18	002366	台海核电	1,862,400.00	1.62
19	600030	中信证券	1,810,800.00	1.57
20	002142	宁波银行	1,747,256.00	1.52

### 8.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	223,636,620.97
卖出股票的收入（成交）总额	91,898,184.53

注：不考虑相关交易费用。

### 8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,520.00	0.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,520.00	0.02

### 8.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1280296	12 如东东泰债	1,000	20,520.00	0.02

### 8.1.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.1.9 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。

### 8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

### 8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.1.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

#### 8.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.1.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

### 8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除华泰证券外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

华泰证券（601688）的发行主体华泰证券股份有限公司因违反银行间市场相关自律管理规则于 2018 年 9 月 30 日被中国银行间市场交易商协会处以警告处分并责令整改。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

8.1.12.2 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。

#### 8.1.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	32,551.59
2	应收证券清算款	256,520.40
3	应收股利	-
4	应收利息	4,783.02
5	应收申购款	2,141.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	295,996.98

#### 8.1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

### 8.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,831,000.00	2.14
	其中：股票	11,831,000.00	2.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	156,480,930.00	28.34
	其中：债券	156,480,930.00	28.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	188,000,000.00	34.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	159,283,253.67	28.85
8	其他各项资产	36,477,544.64	6.61
9	合计	552,072,728.31	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,899,000.00	1.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,932,000.00	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,831,000.00	2.95

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 8.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

## 8.2.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000028	国药一致	100,000	5,932,000.00	1.48
2	002572	索菲亚	170,000	5,899,000.00	1.47

## 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000028	国药一致	12,053,066.48	0.49
2	000513	丽珠集团	7,245,613.60	0.29
3	002142	宁波银行	7,032,486.30	0.29
4	300054	鼎龙股份	4,674,861.00	0.19
5	000639	西王食品	2,306,511.00	0.09
6	002925	盈趣科技	68,670.00	0.00
7	300737	科顺股份	61,023.35	0.00
8	300740	御家汇	39,615.18	0.00
9	300739	明阳电路	28,142.60	0.00

### 8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002456	欧菲科技	20,055,682.50	0.82
2	002508	老板电器	16,738,123.55	0.68
3	300296	利亚德	14,571,619.00	0.59
4	000002	万科A	11,216,150.00	0.46
5	002142	宁波银行	8,188,445.00	0.33
6	000513	丽珠集团	7,371,322.00	0.30
7	000028	国药一致	5,932,971.76	0.24
8	002572	索菲亚	5,409,310.35	0.22
9	300054	鼎龙股份	4,253,070.00	0.17
10	002821	凯莱英	2,685,217.60	0.11
11	000639	西王食品	1,921,376.00	0.08
12	603660	苏州科达	993,762.00	0.04
13	002925	盈趣科技	312,524.80	0.01
14	300737	科顺股份	94,642.19	0.00
15	300740	御家汇	88,075.20	0.00
16	300735	光弘科技	80,308.48	0.00
17	002918	蒙娜丽莎	73,256.40	0.00
18	300664	鹏鹞环保	71,380.40	0.00
19	300739	明阳电路	50,543.10	0.00
20	002923	润都股份	48,978.36	0.00

### 8.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	33,509,989.51
卖出股票的收入（成交）总额	100,339,369.75

注：不考虑相关交易费用。

### 8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	40,930.00	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	156,440,000.00	38.99
9	其他	-	-
10	合计	156,480,930.00	39.00

### 8.2.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111785726	17 成都农商银行 CD045	800,000	78,240,000.00	19.50
2	111785495	17 厦门国际银行 CD179	800,000	78,200,000.00	19.49
3	1280296	12 如东东泰债	1,000	40,930.00	0.01

### 8.2.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



## 8.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.2.9 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。

## 8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

## 8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.2.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

### 8.2.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.2.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 本报告期（2018年1月1日至2018年3月19日）内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除17 厦门国际银行 CD179 外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

17 厦门国际银行 CD179（111785495）的发行主体厦门国际银行由于监管数据错报，违规为股东办理股权质押类信贷业务，贷款审查不到位、信贷资金被挪用，违规发放项目贷款等事项被中国银监会厦门监管局处以罚款。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

8.2.12.2 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。

### 8.2.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	73,984.21
2	应收证券清算款	32,019,769.90
3	应收股利	-
4	应收利息	4,383,790.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,477,544.64

#### 8.2.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2018年3月20日-2018年12月31日)

##### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,009	72,340.68	0.00	0.00%	145,332,424.81	100.00%

##### 9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末, 基金管理人的从业人员未持有本基金。

##### 9.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末, 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0; 本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

(报告期: 2018年1月1日-2018年3月19日)

### 9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,623	108,494.98	0.00	0.00%	393,077,300.92	100.00%

### 9.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末, 基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末, 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0; 本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

### 10.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2018年3月20日-2018年12月31日)

单位: 份

基金合同生效日(2018年3月20日)基金份额总额	393,077,300.92
本报告期期初基金份额总额	393,077,300.92
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,559,696.06
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	256,304,572.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	145,332,424.81

注: 总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额; 总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

### 10.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

(报告期: 2018年1月1日-2018年3月19日)

单位: 份

基金合同生效日(2016年3月11日)基金份额总额	3,702,040,228.17
---------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	2,430,118,118.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	122,199.45
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,037,163,016.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	393,077,300.92

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2018年3月30日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，刘轶先生不再担任公司督察长职务，由总经理孟朝霞女士代行督察长职务。

2、2018年4月27日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司董事、独立董事变更公告》，于业明先生、杨一君先生、Jiachen Fu女士和 Eugen Loeffler先生担任公司第五届董事会董事，公司总经理孟朝霞女士继续担任公司第五届董事会董事；贝多广先生、岳志明先生担任公司第五届董事会独立董事，胡斌先生继续担任公司第五届董事会独立董事。庾启斌先生、汪卫杰先生不再担任本公司董事；程静萍女士不再担任本公司独立董事。

3、2018年4月27日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更公告》，于业明先生担任公司董事长及法定代表人，庾启斌先生不再担任公司董事长及法定代表人。

4、2018年4月28日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，满黎先生不再担任公司副总经理职务。

5、2018年9月21日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李华先生担任公司督察长职务，总经理孟朝霞女士不再代为履行督察长职责。

6、2018年9月21日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，蔡蓓蕾女士担任公司副总经理兼市场总监职务。

7、2018年11月6日，基金管理人发布《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，沈丹女士不再担任本基金的基金经理。

8、本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信

息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

自2018年3月20日起“国联安安稳保本混合型证券投资基金”转型为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自该日起生效，基金投资策略相应变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金本报告期支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为6.5万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续3年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，中国证券监督管理委员会上海监管局就现场检查中发现的问题下发《关于对国联安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。对此，本基金管理人高度重视，制定并落实相关整改措施，及时向中国证券监督管理委员会上海监管局提交整改报告，顺利通过了该局的整改验收。

2、本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

##### 11.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	170,675,225.85	54.49%	155,536.96	53.95%	-
天风证券股份有限公司	1	142,574,390.74	45.51%	132,778.81	46.05%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用,选用标准为:

A 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范,近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求,并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后,与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议,通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名:

A 提供的研究报告质量和数量;

B 研究报告被基金采纳的情况;

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;

E 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名,同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单,基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求,基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

**11.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	561,100,000.00	100.00%	-	-

注：本基金本报告期内未在租用的证券公司交易单元上进行其他证券投资。

## 11.7.2 国联安安稳保本混合型证券投资基金

### 11.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	132,658,146.13	99.26%	120,892.02	99.24%	-
天风证券股份有限公司	1	993,762.00	0.74%	925.44	0.76%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

11.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	204,337,331.24	86.36%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	9,360,767.50	3.96%	1,895,000,000.00	26.35%	-	-
天风证券股份有限公司	22,899,683.41	9.68%	5,297,500,000.00	73.65%	-	-



## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 国联安安稳保本混合型证券投资基金

#### 12.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日-2018年3月12日	500,134,000.00	0.00	500,134,000.00	0.00	0.00%
	2	2018年3月13日-2018年3月14日	300,026,000.00	0.00	300,026,000.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者(“高比例投资者”)大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回,中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险,赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费,相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产,可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后,可能导致基金规模较小,从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2018年5月4日发布公告,经本基金管理人股东会第五十五次会议决议通过,并经中国证券监督管理委员会批复核准(证监许可[2018]557号),本基金管理人原股东国泰君安证券股份有限公司将所持51%股权转让给太平洋资产管理有限责任公司。上述事项涉及的相关工商变更登记等事宜,已按规定办理完毕。变更后,本基金管理人的股东为太平洋资产管理有限责任公司和安联集团。

国联安基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日