

国泰安益灵活配置混合型证券投资基金
2019 年第 2 季度报告
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 7 月 16 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰安益灵活配置混合
基金主代码	001850
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 23 日
报告期末基金份额总额	224,063,714.04 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要根据上市公司获利能力、成长能力以及估值水</p>

	<p>平来进行个股选择。运用定性和定量相结合的方法，综合分析其投资价值和成长能力，确定投资标的股票，构建投资组合。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风</p>
--	---

	险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001850	004252
报告期末下属分级基金的份额总额	223,313,701.62 份	750,012.42 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)	
	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C
	1.本期已实现收益	1,594,589.19
2.本期利润	4,110,447.64	-155.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0224	-0.0061
4.期末基金资产净值	256,376,027.52	861,470.82
5.期末基金份额净值	1.1481	1.1486

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；

（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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、国泰安益灵活配置混合 A:

阶段	净值增长率 ①	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	1.82%	0.37%	-0.11%	0.75%	1.93%	-0.38%

2、国泰安益灵活配置混合 C:

阶段	净值增长率 ①	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	1.79%	0.37%	-0.11%	0.75%	1.90%	-0.38%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

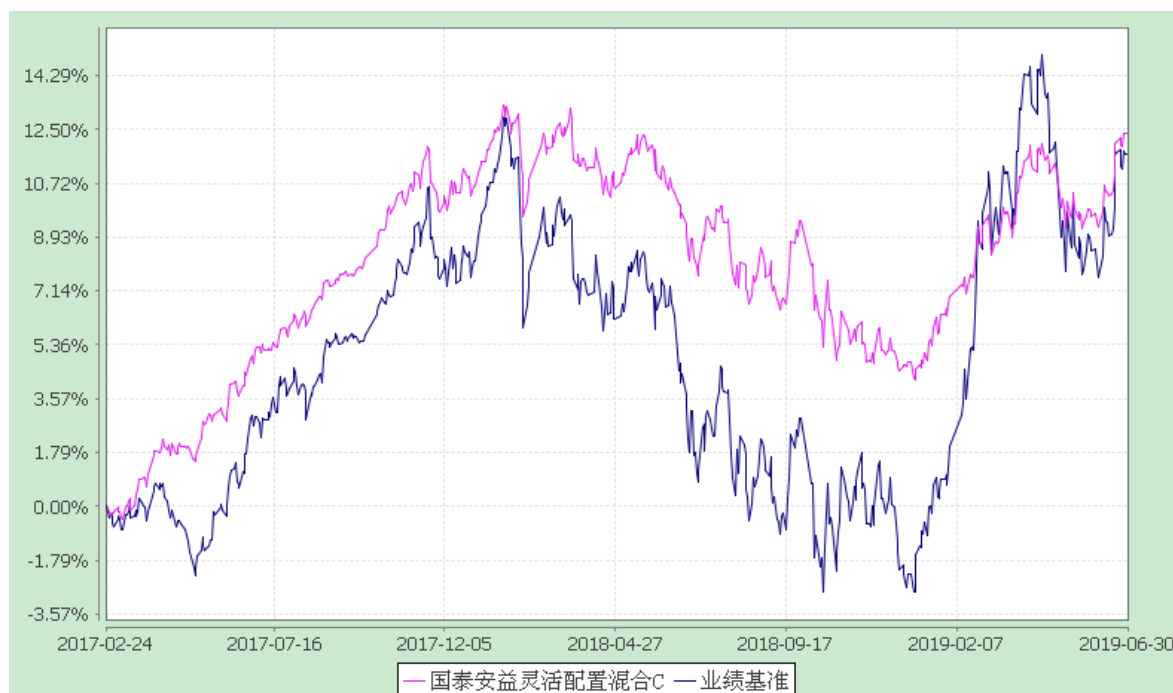
国泰安益灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016 年 12 月 23 日至 2019 年 6 月 30 日)

1. 国泰安益灵活配置混合 A:



注：本基金的合同生效日为 2016 年 12 月 23 日，本基金在 6 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰安益灵活配置混合 C:



注：本基金的合同生效日为 2016 年 12 月 23 日，本基金在 6 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2017 年 2 月 24 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
樊利安	本基金的基金经理、国泰民益灵活配置混合（LOF）、国泰睿吉灵	2016-12-23	-	13 年	硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月至 2018 年 8

	<p>活配置混合、国泰浓益灵活配置混合、国泰融丰外延增长灵活配置混合 (LOF)、国泰兴益灵活配置混合、国泰普益灵活配置混合、国泰融信灵活配置混合 (LOF)、国泰多策略收益灵活配置、国泰民福策略价值灵活配置混合的基金经理、研究部总监</p>			<p>月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 3 月至 2019 年 1 月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 5 月起兼任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 6 月至 2018 年 2 月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 6 月起兼任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 6 月至 2017 年 1 月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金 (由金泰证券投资基金转型而来) 的基金经理, 2016 年 5 月至 2017 年 11 月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 8 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 11 月至 2018 年 12 月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 9 月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 8 月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月起兼任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 6 月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金</p>
--	---	--	--	---

				<p>的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月起兼任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月起任研究部总监。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持

有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年二季度，市场经历了较大幅度下跌，同时风格差异较大。最终上证指数下跌 3.62%，深证成指下跌 7.35%，创业板指下跌 10.75%，食品饮料、金融、采掘等板块相对优势明显。从行业来看，食品饮料、金融服务有正收益，其他板块均有不同程度的下跌，跌幅较大的板块有家居、文化传媒等，部分股票跌幅较大。

二季度中美贸易战再次升温至技术封锁，预期恶化；国内宏观经济数据稳中有降，同时包商事件引发资金担忧。两者叠加，导致市场整体下跌明显。

本基金以绝对收益策略为主，二季度较为及时的调整了股票仓位、结构，并积极准备参与科创板新股投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰安益 A 在 2019 年第二季度的净值增长率为 1.82%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

国泰安益 C 在 2019 年第二季度的净值增长率为 1.79%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

G20 会谈后，中美贸易战阶段性有所缓和；基于美国经济下行的压力，美联储释放了降息预期。国内方面，包商事件得以缓解，资金预期改善；市场对降准降息的预期加强。但是同时，国内外宏观经济增速下行的预期并未发生改变。因此，尽管短期风险得以释放，市场仍然在谨慎中前行。

基于此，我们 2019 年第三季度的配置仍然沿着两个方向，一是精选符合未来发展方向、业绩增长确定，性价比有优势的成长股；二是选择业绩稳定增长、估值合理、具有高股息率的白马蓝筹。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现过超过连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。截至本报告期末，本基金的基金份额持有人数量已恢复至两百人以上。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	74,208,263.85	28.81
	其中：股票	74,208,263.85	28.81
2	固定收益投资	148,357,300.00	57.59
	其中：债券	148,357,300.00	57.59
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	29,000,134.50	11.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,963,439.10	1.54

7	其他各项资产	2,060,394.32	0.80
8	合计	257,589,531.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	4,203,031.35	1.63
C	制造业	34,364,512.05	13.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,109,425.00	1.60
E	建筑业	2,000,925.00	0.78
F	批发和零售业	816,800.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,005,360.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	971,603.76	0.38
J	金融业	23,377,755.15	9.09
K	房地产业	3,335,744.94	1.30
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	74,208,263.85	28.85

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	6,946	6,834,864.00	2.66
2	601318	中国平安	66,141	5,860,754.01	2.28

3	600036	招商银行	130,900	4,709,782.00	1.83
4	600030	中信证券	173,800	4,138,178.00	1.61
5	600887	伊利股份	89,827	3,001,120.07	1.17
6	600276	恒瑞医药	44,440	2,933,040.00	1.14
7	600585	海螺水泥	70,500	2,925,750.00	1.14
8	601398	工商银行	425,400	2,505,606.00	0.97
9	601288	农业银行	684,600	2,464,560.00	0.96
10	600048	保利地产	174,300	2,224,068.00	0.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,992,000.00	7.77
	其中：政策性金融债	19,992,000.00	7.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,054,000.00	15.57
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	88,311,300.00	34.33
9	其他	-	-
10	合计	148,357,300.00	57.67

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111913012	19 浙商银行 CD012	400,000	38,776,000.00	15.07
2	111905019	19 建设银行 CD019	300,000	29,127,000.00	11.32
3	011901314	19 华电江苏 SCP004	200,000	20,028,000.00	7.79
4	011901364	19 深圳地铁	200,000	20,026,000.00	7.79

		SCP004			
5	190201	19 国开 01	200,000	19,992,000.00	7.77

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国开行、中信证券、招商银行、建设银行、浙商银行、民生银行”违规情况外），没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

国开行多家分行，因办理信贷业务严重不审慎、违法提供担保等原因，收到银保监的公开批评或不高于 150 万元罚款的公开处罚。

中信证券江苏分公司在 2018 年 12 月 18 日因违反反洗钱规定，受到中国人民银行南京分行公开处罚，处以罚金 20 万元。

根据招商银行 2018 年 7 月到 2019 年 6 月期间发布的公告，招商银行南宁、厦门、哈尔滨、大连、淄博等分支机构因授信调查不全面、未能有效识别反映集团客户授信集中风险、表内并购贷款理财资金为房地产开发项目支付土地转让价款或为已缴交地价款项目提供再融资、授信不审慎造成信用风险暴露、贷款三差不禁止、贷款资金被挪用等行为，受到当地银保监会警告、责令改正、罚款等公开处罚。

建设银行及下属多家分、支行，因信息披露虚假或严重误导性陈述等原因被当地银保监处以警告及最高 250 万元的罚款。

民生银行多家分、支行因贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金；因以贷收贷，掩盖资产真实质量；以贷转存，虚增存贷款规模；微联保授信业务贷前调查不尽职；信息披露虚假或严重误导性陈述等原因被央行、银保监处以警告及最高 220 万元的罚款或禁止从业处分。2018 年 12 月 7 日，因贷款业务严重违反审慎经营规则，被银保监会罚款 200 万元，因内控管理严重违反审慎经营规则、同业投资违规接受担保、同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资、本行理财产品之间风险隔离不到位、个人理财资金违规投资、票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用、为非保本理财产品提供保本承诺，被银保监会罚款 3160 万元。2019 年 4 月 4 日，民生银行青岛分行因违法违规发放贷款，被银保监处以没收违法所得 356.30 万元，并处违法所得 1 倍罚款 356.30 万元，罚没合计 712.60 万元的行政处罚决定。2019 年 6 月 18 日，民生银行太原分行因存在贷款用途不合规，理财业务不规范，不按要求报送报表报告等资料行为，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条、第四十八条规定，中国民生银行股份有限公司太原分行被银保监会山西银保监局责令改正，并罚款 480 万元，副行长夏斌、金融市场部总经理傅胜坤被给予“警告”处分。

浙商银行多家分行，因信息披露虚假或严重误导性陈述等原因被当地银保监处以最高 190 万元的罚款。浙商银行股份有限公司，2018 年 12 月 7 日，因“涉及的七项理财违规行为包括：一、投资同业理财产品未尽职审查；二、为客户缴交土地出让金提供理财资金融资；三、投资非保本理财产品违规接受回购承诺；四、理财产品销售文本使用误导性语言；五、个人理财资金违规投资；

六、理财产品相互交易，业务风险隔离不到位；七为非保本理财产品提供保本承诺。”被银保监处以 5550 万元罚款。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2 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情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	67,374.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,132,876.16
5	应收申购款	860,143.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,060,394.32

5.11.4 报告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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C
本报告期期初基金份额总额	135,114,439.80	18,992.14

报告期基金总申购份额	88,274,837.53	748,709.98
减：报告期基金总赎回份额	75,575.71	17,689.70
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	223,313,701.62	750,012.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2019年4月1日至2019年6月30日	135,008,000.00	-	-	135,008,000.00	60.25%
	2	2019年4月25日至2019年6月30日	-	52,756,615.70	-	52,756,615.70	23.55%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰安益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同

- 3、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

9.2存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层。

9.3查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一九年七月十八日