

国寿安保华兴灵活配置混合型  
证券投资基金  
2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14

6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 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.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
11.1 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.....	46

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国寿安保华兴灵活配置混合
基金主代码	005683
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 28 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	136,939,173.22 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用多种投资策略,在经济结构转型、产业升级大背景下,积极挖掘沪港深市场中潜在的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票及债券投资外,本基金还可通过投资衍生工具等,进一步为基金组合规避风险、增强收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险/收益的投资品种。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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	国寿安保基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95588
传真	010-50850776	010-66105798
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	100033	100140
法定代表人	王军辉	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,004,065.37
本期利润	18,127,264.14
加权平均基金份额本期利润	0.1253
本期加权平均净值利润率	12.30%
本期基金份额净值增长率	12.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	164,064.39
期末可供分配基金份额利润	0.0012
期末基金资产净值	142,277,723.89
期末基金份额净值	1.0390
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.90%

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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

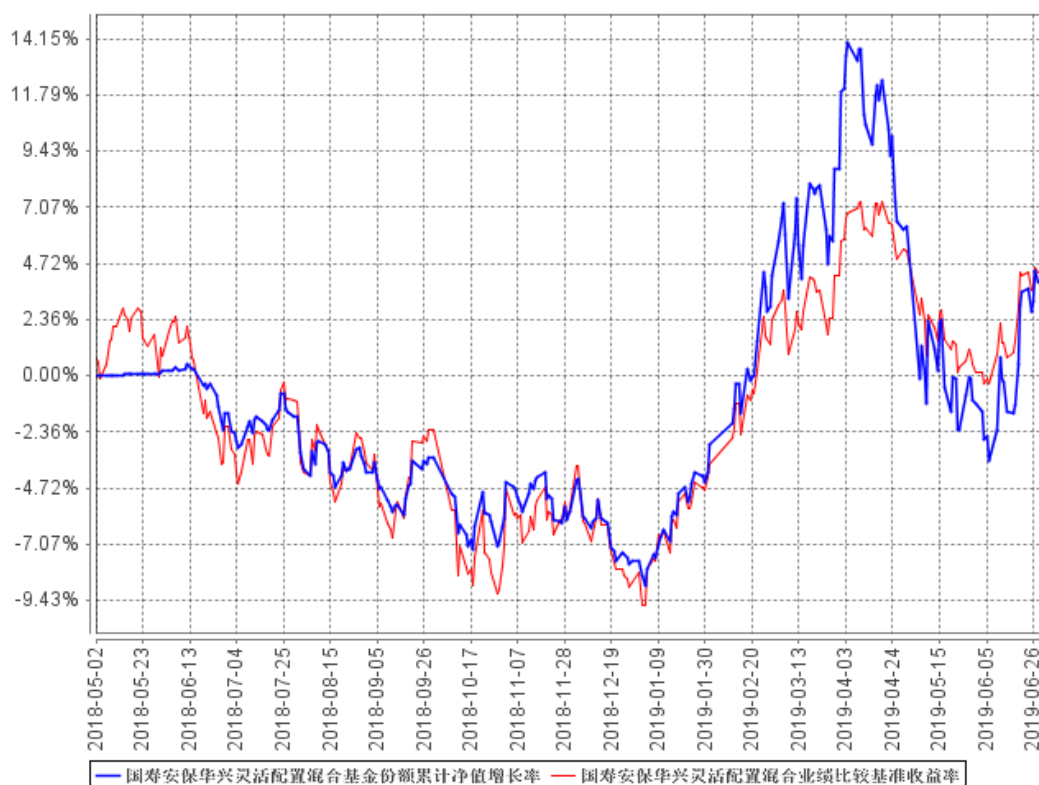
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.13%	1.20%	4.21%	0.71%	0.92%	0.49%
过去三个月	-4.42%	1.53%	0.18%	0.79%	-4.60%	0.74%

过去六个月	12.65%	1.35%	13.77%	0.82%	-1.12%	0.53%
过去一年	5.56%	1.02%	6.60%	0.87%	-1.04%	0.15%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.95%	4.36%	0.85%	-0.46%	0.10%

### 3.2.2 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

国寿安保华兴灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 4 月 28 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期 2018 年 4 月 28 日至 2019 年 6 月 30 日。

## § 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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可(2013)1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安资



本投资有限公司)，其持有股份 14.97%。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 48 只证券投资基金及部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2,070.27 亿元，其中证券投资基金管理规模为 1,538.97 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
张琦	股票投资总监、股票投资部总监及基金经理	2018 年 4 月 28 日	-	14 年	2005 年 1 月至 2015 年 5 月，任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理等职，2015 年 6 月加入国寿安保基金管理有限公司，现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监，国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保目标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保健康科学混合型证券投资基金、国寿安保消费新蓝海灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金及国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李捷	基金经理	2018 年 4 月 28 日	-	12 年	李捷先生，硕士。曾任德勤华永会计师事务所高级审计师，中国国际金融有限公司分析员，财富里昂证券有限责任公司投资分析师。2013 年 12 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任国寿安保灵活优选混合型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳瑞混合型证券投资基金及国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金

合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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 公平交易制度的执行情况**

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### **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**

2019 年上半年，A 股市场整体呈现先扬后抑的走势，上证综指累计上涨约 19.45%，深圳成指上涨约 26.78%，创业板综上涨约 20.94%。上半年表现较好的行业分别为食品饮料、非银金融、农林牧渔、家用电器、计算机等，其余行业表现相对较弱。港股市场在 2019 年上半年也随全球市场出现一定的反弹。

2019 年上半年，权益市场在经历了 2018 年大幅调整后，出现了较大的预期修复和调整行情，市场整体呈现先扬后抑走势。国寿安保华兴基金较好的把握住了市场机会，逐步提升了权益配置比例。基金组合中权益配置主要集中在优质的行业和公司。其中，A 股市场配置比例相对较高的行业包括：电子、家电、机械设备、医药生物、汽车等；港股市场配置比例相对较高的行业包括：金融业、消费、科技等。截至 2019 年 6 月 30 日，基金组合中持有的股票市值占资产净值比例约为 90%，持有的债券市值比例约为 7.7%。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0390 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.65%，业绩比较基准收益率为 13.77%。

#### 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 年下半年，我们认为，虽然中美谈判仍存在一定的不确定性，但国内政策面仍有进一步支持经济高质量发展的空间。若海外的不确定能够消除，同时，随着国内一系列资本市场和经济改革的逐步落地，市场仍有望延续上半年稳中向好的格局。从中期看，中国经济发展的动能仍然充足，经济发展模式从重“总量”到重“质量”的转变将支持更多附加值高的行业发展，这也将给 A 股和港股资本市场带来更多的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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，本基金托管人在对国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金的托

管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国寿安保基金管理有限公司编制和披露的国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,443,081.37	2,371,331.92
结算备付金		95,619.94	1,027,946.63
存出保证金		63,019.41	54,707.13
交易性金融资产	6.4.7.2	140,016,652.15	126,045,476.88
其中：股票投资		129,007,254.50	56,166,382.94
基金投资		-	-
债券投资		11,009,397.65	69,879,093.94
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	400,000.00	11,200,000.00
应收证券清算款		1,591,632.63	565,559.99
应收利息	6.4.7.5	132,322.66	1,132,389.16
应收股利		267,988.20	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		144,010,316.36	142,397,411.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,407,121.55	2.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		170,484.99	183,658.25
应付托管费		28,414.17	30,609.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	37,743.54	19,011.70
应交税费		30.72	4,426.96
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	88,797.50	100,000.00
负债合计		1,732,592.47	337,708.69
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	136,939,173.22	154,027,878.70
未分配利润	6.4.7.10	5,338,550.67	-11,968,175.68
所有者权益合计		142,277,723.89	142,059,703.02
负债和所有者权益总计		144,010,316.36	142,397,411.71

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0390 元，基金份额总额 136,939,173.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月28日(基 金合同生效日)至 2018年6月30日
<b>一、收入</b>		19,675,731.79	-1,776,500.05
1.利息收入		507,719.97	1,035,524.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,217.77	547,364.31

债券利息收入		464,099.40	58,407.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,402.80	429,753.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,037,116.52	149,777.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-630,912.13	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,282,335.78	6,069.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,385,692.87	143,708.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,123,198.77	-3,228,526.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,696.53	266,723.74
<b>减：二、费用</b>		1,548,467.65	697,666.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,096,304.79	528,502.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	182,717.51	88,083.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	178,222.92	47,461.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		955.08	53.57
7. 其他费用	6.4.7.20	90,267.35	33,565.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,127,264.14	-2,474,166.29
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		18,127,264.14	-2,474,166.29

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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）	154,027,878.70	-11,968,175.68	142,059,703.02

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,127,264.14	18,127,264.14
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）	-17,088,705.48	-820,537.79	-17,909,243.27
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-17,088,705.48	-820,537.79	-17,909,243.27
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）	136,939,173.22	5,338,550.67	142,277,723.89
项目	上年度可比期间 2018年4月28日(基金合同生效日)至2018年6月30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）	233,430,478.74	-	233,430,478.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,474,166.29	-2,474,166.29
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）	-71,000,346.16	-73,146.77	-71,073,492.93
其中：1.基金申购款	52,109.89	-585.52	51,524.37
2.基金赎回款	-71,052,456.05	-72,561.25	-71,125,017.30
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）	162,430,132.58	-2,547,313.06	159,882,819.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
左季庆

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
王文英

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
韩占锋

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]170号文《关于准予国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于2018年3月29日至2018年4月25日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2018)验字第61090605\_A05号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年4月28日正式生效，首次设立募集规模为233,430,478.74份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、权证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）。在法律法规允许且与托管行协商一致的情况下，本基金可参与融资业务。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0-95%，其中投资于国内依法发行上市的股票比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票比例占股票资产的0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的投资范围包括港股通标的股票，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。



## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣

等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计

入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,443,081.37
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,443,081.37

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,583,321.44	129,007,254.50	5,423,933.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,009,397.65	374,658.04
	银行间市场	-	-
	合计	11,009,397.65	374,658.04
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	134,218,061.05	140,016,652.15	5,798,591.10

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	400,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	329.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	55.42
应收债券利息	131,926.26
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.60
合计	132,322.66

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	37,743.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	37,743.54

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	88,797.50
合计	88,797.50

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,027,878.70	154,027,878.70
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-17,088,705.48	-17,088,705.48
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	136,939,173.22	136,939,173.22

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-962,448.86	-11,005,726.82	-11,968,175.68
本期利润	1,004,065.37	17,123,198.77	18,127,264.14
本期基金份额交易产生的变动数	122,447.88	-942,985.67	-820,537.79
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	122,447.88	-942,985.67	-820,537.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,064.39	5,174,486.28	5,338,550.67

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	7,872.01
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,671.85
其他	673.91
合计	11,217.77

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	41,033,877.32
减：卖出股票成本总额	41,664,789.45
买卖股票差价收入	-630,912.13

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,282,335.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,282,335.78

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	73,216,811.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,558,322.25
减：应收利息总额	1,376,153.00
买卖债券差价收入	1,282,335.78

##### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,385,692.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,385,692.87

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	17,123,198.77
——股票投资	16,674,687.50
——债券投资	448,511.27
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	17,123,198.77

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	7,585.21
转换费收入	111.32
合计	7,696.53

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	178,222.92



银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	178,222.92

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,044.72
银行费用	1,469.85
其他	-
合计	90,267.35

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
工商银行股份有限公司（简称“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	中国人寿保险集团公司（基金管理人的最终控制人）控制的公司

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交

易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年4月28日(基金合同 生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,096,304.79	528,502.00
其中：支付销售机构的客户维护费	36,539.36	32,844.42

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月28日(基金合同 生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	182,717.51	88,083.70

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年4月28日(基金合同生效日)至2018年6月30日
基金合同生效日(2018年4月28日)持有的基金份额	-	14,568,210.29
期初持有的基金份额	14,568,210.29	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	14,568,210.29	14,568,210.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.6400%	8.9700%

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019年6月30日		2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国人寿	80,002,600.00	58.4200%	80,002,600.00	51.9400%

### 6.4.10.5 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年4月28日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,443,081.37	7,872.01	14,053,393.33	59,205.16

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此

账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,443,081.37	-	-	-	1,443,081.37
结算备付金	95,619.94	-	-	-	95,619.94
存出保证金	63,019.41	-	-	-	63,019.41
交易性金融资产	11,009,397.65	-	-	129,007,254.50	140,016,652.15
买入返售金融资产	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,591,632.63	1,591,632.63
应收利息	-	-	-	132,322.66	132,322.66
应收股利	-	-	-	267,988.20	267,988.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,011,118.37	-	-	130,999,197.99	144,010,316.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,407,121.55	1,407,121.55
应付管理人报酬	-	-	-	170,484.99	170,484.99
应付托管费	-	-	-	28,414.17	28,414.17
应付交易费用	-	-	-	37,743.54	37,743.54
应交税费	-	-	-	30.72	30.72
其他负债	-	-	-	88,797.50	88,797.50
负债总计	-	-	-	1,732,592.47	1,732,592.47
利率敏感度缺口	13,011,118.37	-	-	129,266,605.52	142,277,723.89
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	2,371,331.92	-	-	-	2,371,331.92
结算备付金	1,027,946.63	-	-	-	1,027,946.63
存出保证金	54,707.13	-	-	-	54,707.13
交易性金融资产	46,337,434.80	20,175,327.69	3,366,331.45	56,166,382.94	126,045,476.88
买入返售金融资产	11,200,000.00	-	-	-	11,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	565,559.99	565,559.99
应收利息	-	-	-	1,132,389.16	1,132,389.16
资产总计	60,991,420.48	20,175,327.69	3,366,331.45	57,864,332.09	142,397,411.71
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2.07	2.07
应付管理人报酬	-	-	-	183,658.25	183,658.25
应付托管费	-	-	-	30,609.71	30,609.71
应付交易费用	-	-	-	19,011.70	19,011.70
应交税费	-	-	-	4,426.96	4,426.96
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	337,708.69	337,708.69
利率敏感度缺口	60,991,420.48	20,175,327.69	3,366,331.45	57,526,623.40	142,059,703.02

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款等，所持有的债券占基金净资产比例低于 20%。除此之外的金融资产和金融负债均不计息。因此市场利率的变动对于本资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	20,468,340.57	-	20,468,340.57

应收股利	-	267,988.20	-	267,988.20
资产合计	-	20,736,328.77	-	20,736,328.77
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	20,736,328.77	-	20,736,328.77
项目	上年度末			
	2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	9,803,363.70	-	9,803,363.70
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	9,803,363.70	-	9,803,363.70
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,803,363.70	-	9,803,363.70

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	所有港币均相对人民币升值 5%	1,036,816.44	490,168.19
	所有港币均相对人民币贬值 5%	-1,036,816.44	-490,168.19

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大的市场价格风险由所



持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于国内依法发行上市的股票比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于 2019 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	129,007,254.50	90.67	56,166,382.94	39.54
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	11,009,397.65	7.74	69,879,093.94	49.19
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	140,016,652.15	98.41	126,045,476.88	88.73

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	+5%	10,521,381.11	3,622,236.40
	-5%	-10,521,381.11	-3,622,236.40

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 131,737,229.61 元（上年度末：63,354,771.38 元），属于第二层次的余额为人民币 8,279,422.54

元（上年度末：62,690,705.50 元），本报告期末及上年度末均无属于第三层次的余额。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	129,007,254.50	89.58
	其中：股票	129,007,254.50	89.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,009,397.65	7.64
	其中：债券	11,009,397.65	7.64
	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	400,000.00	0.28
	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	1,538,701.31	1.07
8	其他各项资产	2,054,962.90	1.43
9	合计	144,010,316.36	100.00

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 20,468,340.57 元，占基金净资产的比例为 14.39%。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	990,588.85	0.70
C	制造业	81,070,709.78	56.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	233,100.00	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	683,240.00	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,050,443.76	7.77
J	金融业	10,037,954.94	7.06
K	房地产业	1,684,320.00	1.18
L	租赁和商务服务业	1,329,750.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	433,400.00	0.30
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	1,002,300.00	0.70
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	108,538,913.93	76.29

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	4,483,978.88	3.15
C 消费者常用品	1,374,204.86	0.97
D 能源	201,477.33	0.14
E 金融	2,899,429.73	2.04
F 医疗保健	2,387,661.14	1.68
G 工业	3,573,801.72	2.51
H 信息技术	3,656,693.84	2.57

I 电信服务	1,055,416.07	0.74
J 公用事业	-	-
K 房地产	835,677.00	0.59
合计	20,468,340.57	14.39

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600031	三一重工	360,172	4,711,049.76	3.31
2	600276	恒瑞医药	50,400	3,326,400.00	2.34
3	600030	中信证券	138,000	3,285,780.00	2.31
4	600570	恒生电子	44,200	3,012,230.00	2.12
5	002508	老板电器	100,000	2,714,000.00	1.91
6	000333	美的集团	50,023	2,594,192.78	1.82
7	601939	建设银行	310,000	2,306,400.00	1.62
8	000651	格力电器	39,000	2,145,000.00	1.51
9	300253	卫宁健康	150,000	2,127,000.00	1.49
10	600498	烽火通信	75,000	2,089,500.00	1.47
11	603678	火炬电子	100,000	2,015,000.00	1.42
12	600036	招商银行	55,000	1,978,900.00	1.39
13	002690	美亚光电	60,000	1,956,000.00	1.37
14	300558	贝达药业	45,000	1,867,500.00	1.31
15	300408	三环集团	90,000	1,750,500.00	1.23
16	600741	华域汽车	80,000	1,728,000.00	1.21
17	603228	景旺电子	42,989	1,719,989.89	1.21
18	002918	蒙娜丽莎	144,500	1,692,095.00	1.19
19	600048	保利地产	132,000	1,684,320.00	1.18
20	002583	海能达	200,000	1,678,000.00	1.18
21	000338	潍柴动力	136,000	1,671,440.00	1.17
22	002475	立讯精密	67,000	1,660,930.00	1.17
23	000858	五粮液	14,000	1,651,300.00	1.16
24	000921	海信科龙	130,000	1,622,400.00	1.14
25	002202	金风科技	71,400	887,502.00	0.62
25	02208	金风科技	95,200	715,170.62	0.50
26	600519	贵州茅台	1,600	1,574,400.00	1.11
27	02333	长城汽车	320,000	1,573,535.81	1.11
28	600066	宇通客车	120,000	1,562,400.00	1.10

29	600690	青岛海尔	88,000	1,521,520.00	1.07
30	00700	腾讯控股	4,900	1,519,823.77	1.07
31	600887	伊利股份	45,000	1,503,450.00	1.06
32	600406	国电南瑞	80,000	1,491,200.00	1.05
33	600845	宝信软件	52,000	1,480,960.00	1.04
34	601877	正泰电器	64,000	1,477,760.00	1.04
35	603156	养元饮品	39,340	1,458,727.20	1.03
36	601336	新华保险	26,500	1,458,295.00	1.02
37	000786	北新建材	80,000	1,450,400.00	1.02
38	603688	石英股份	110,000	1,386,000.00	0.97
39	600563	法拉电子	33,000	1,358,610.00	0.95
40	603912	佳力图	90,000	1,333,800.00	0.94
41	601888	中国国旅	15,000	1,329,750.00	0.93
42	601689	拓普集团	83,000	1,271,560.00	0.89
43	01114	BRILLIANCE CHI	160,000	1,216,041.98	0.85
44	300098	高新兴	150,000	1,197,000.00	0.84
45	01177	中国生物制药	170,000	1,194,842.18	0.84
46	002415	海康威视	42,000	1,158,360.00	0.81
47	300124	汇川技术	50,000	1,145,500.00	0.81
48	02382	舜宇光学科技	16,000	1,135,816.99	0.80
49	600703	三安光电	100,000	1,128,000.00	0.79
50	002250	联化科技	100,000	1,109,000.00	0.78
51	01800	中国交通建设	180,000	1,106,788.21	0.78
52	300296	利亚德	140,000	1,096,200.00	0.77
53	603385	惠达卫浴	120,010	1,086,090.50	0.76
54	601058	赛轮轮胎	360,000	1,069,200.00	0.75
55	00966	中国太平	58,000	1,066,323.85	0.75
56	02319	蒙牛乳业	40,000	1,064,388.60	0.75
57	00762	中国联通	140,000	1,055,416.07	0.74
58	300347	泰格医药	13,000	1,002,300.00	0.70
59	000513	丽珠集团	30,000	996,900.00	0.70
60	601318	中国平安	11,000	974,710.00	0.69
61	600885	宏发股份	40,000	972,000.00	0.68
62	603515	欧普照明	29,900	964,275.00	0.68
63	002050	三花股份	91,000	960,050.00	0.67
64	600176	中国巨石	100,000	953,000.00	0.67
65	01157	中联重科	210,000	947,657.72	0.67
66	300383	光环新网	55,000	922,350.00	0.65
67	600585	海螺水泥	22,000	913,000.00	0.64

68	603816	顾家家居	28,000	893,760.00	0.63
69	00388	香港交易所	3,600	873,396.82	0.61
70	002236	大华股份	60,000	871,200.00	0.61
71	002088	鲁阳节能	70,000	857,500.00	0.60
72	00817	中国金茂	200,000	835,677.00	0.59
73	002035	华帝股份	68,000	828,240.00	0.58
74	02388	中银香港	30,000	811,486.35	0.57
75	01766	中国中车	140,000	804,185.17	0.57
76	000401	冀东水泥	45,000	792,450.00	0.56
77	002439	启明星辰	29,000	780,100.00	0.55
78	300137	先河环保	88,000	733,040.00	0.52
79	603801	志邦家居	35,000	691,600.00	0.49
80	002271	东方雨虹	30,290	686,371.40	0.48
81	600258	首旅酒店	38,000	683,240.00	0.48
82	002078	太阳纸业	100,000	681,000.00	0.48
83	00425	敏实集团	36,000	666,606.35	0.47
84	603989	艾华集团	34,916	659,214.08	0.46
85	600600	青岛啤酒	13,000	649,090.00	0.46
86	01099	国药控股	26,400	638,633.16	0.45
87	03888	金山软件	40,000	594,650.16	0.42
88	600426	华鲁恒升	40,000	594,400.00	0.42
89	00175	吉利汽车	50,000	587,612.88	0.41
90	300476	胜宏科技	50,000	565,000.00	0.40
91	01093	石药集团	50,000	554,185.80	0.39
92	601088	中国神华	15,000	305,700.00	0.21
92	01088	中国神华	14,000	201,477.33	0.14
93	601699	潞安环能	60,000	476,400.00	0.33
94	002311	海大集团	15,000	463,500.00	0.33
95	02238	广汽集团	60,000	440,181.86	0.31
96	603259	药明康德	5,000	433,400.00	0.30
97	00968	信义光能	120,000	406,402.92	0.29
98	601799	星宇股份	5,000	394,800.00	0.28
99	002832	比音勒芬	8,000	381,360.00	0.27
100	002709	天赐材料	15,000	363,000.00	0.26
101	300760	迈瑞医疗	1,507	245,942.40	0.17
102	600886	国投电力	30,000	233,100.00	0.16
103	00291	华润啤酒	6,000	195,812.32	0.14
104	603197	保隆科技	10,000	192,300.00	0.14
105	600686	金龙汽车	25,000	188,000.00	0.13

106	603833	欧派家居	1,500	161,430.00	0.11
107	01299	友邦保险	2,000	148,222.71	0.10
108	601225	陕西煤业	15,000	138,600.00	0.10
109	00506	中国食品	40,000	114,003.94	0.08
110	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.06
111	600968	海油发展	19,687	69,888.85	0.05
112	603915	国茂股份	2,103	48,936.81	0.03
113	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
114	603217	元利科技	584	39,268.16	0.03
115	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
116	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
117	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
118	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02
119	603863	松炆资源	806	18,602.48	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300558	贝达药业	2,683,883.00	1.89
2	002508	老板电器	2,569,488.00	1.81
3	002583	海能达	2,177,428.19	1.53
4	000921	海信科龙	2,165,413.00	1.52
5	603678	火炬电子	2,158,271.00	1.52
6	300523	辰安科技	1,951,995.00	1.37
7	300253	卫宁健康	1,884,045.00	1.33
8	002444	巨星科技	1,781,176.67	1.25
9	002918	蒙娜丽莎	1,762,310.50	1.24
10	600276	恒瑞医药	1,723,307.00	1.21
11	600703	三安光电	1,704,392.00	1.20
12	002690	美亚光电	1,703,795.00	1.20
13	603688	石英股份	1,696,526.00	1.19
14	600048	保利地产	1,692,550.00	1.19
15	603912	佳力图	1,485,046.20	1.05
16	01800	中国交通建设	1,483,745.31	1.04
17	000002	万科A	1,448,249.25	1.02

18	601336	新华保险	1,446,555.00	1.02
19	300098	高新兴	1,360,671.00	0.96
20	00700	腾讯控股	1,342,809.50	0.95

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300523	辰安科技	1,982,658.20	1.40
2	601601	中国太保	1,660,653.00	1.17
3	002444	巨星科技	1,517,081.00	1.07
4	601669	中国电建	1,508,600.00	1.06
5	000002	万科A	1,467,670.00	1.03
6	002717	岭南园林	1,131,512.00	0.80
7	600048	保利地产	1,080,100.00	0.76
8	000963	华东医药	1,026,906.00	0.72
9	002146	荣盛发展	916,700.00	0.65
10	600019	宝钢股份	877,000.00	0.62
11	300558	贝达药业	790,150.00	0.56
12	000921	海信科龙	782,982.00	0.55
13	600398	海澜之家	781,600.00	0.55
14	00998	中信银行	772,868.44	0.54
15	601939	建设银行	765,600.00	0.54
16	300059	东方财富	763,000.00	0.54
17	603633	徕木股份	740,619.80	0.52
18	601021	春秋航空	711,020.00	0.50
19	002262	恩华药业	700,271.00	0.49
20	001979	招商蛇口	699,050.00	0.49

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	97,830,973.51
卖出股票收入（成交）总额	41,033,877.32



注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 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	4,849,800.00	3.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,372,646.00	2.37
	其中：政策性金融债	3,372,646.00	2.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,786,951.65	1.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,009,397.65	7.74

## 7.6 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	019611	19 国债 01	23,500	2,348,120.00	1.65
2	108901	农发 1801	14,000	1,401,400.00	0.98
3	019608	18 国债 26	12,000	1,200,240.00	0.84
4	108602	国开 1704	10,600	1,070,706.00	0.75
5	113015	隆基转债	8,000	1,021,920.00	0.72

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 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	63,019.41
2	应收证券清算款	1,591,632.63
3	应收股利	267,988.20
4	应收利息	132,322.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,054,962.90

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113015	隆基转债	1,021,920.00	0.72
2	128027	崇达转债	516,802.89	0.36
3	128016	雨虹转债	318,360.00	0.22
4	128046	利尔转债	195,112.26	0.14
5	110049	海尔转债	168,448.00	0.12
6	113515	高能转债	122,048.40	0.09
7	127005	长证转债	57,410.10	0.04

### 7.12.5 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的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
340	402,762.27	129,568,446.04	94.62%	7,370,727.18	5.38%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,119,573.49	3.0100%

### 8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月28日）基金份额总额	233,430,478.74
本报告期期初基金份额总额	154,027,878.70
本报告期期间基金总申购份额	-
减：本报告期期间基金总赎回份额	17,088,705.48
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	136,939,173.22

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本报告期内，基金管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中信证券	2	55,177,951.83	41.11%	51,387.54	46.59%	-
太平洋证券	1	53,399,200.06	39.79%	33,711.48	30.56%	-
国泰君安	2	25,639,362.29	19.10%	25,204.05	22.85%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

(5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务形成支持；

(6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中信证券	4,274,349.00	5.55%	-	-	-	-
太平洋证券	71,583,739.25	92.90%	108,200,000.00	100.00%	-	-
国泰君安	1,199,882.28	1.56%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
2	国寿安保旗下基金参加交通银行手机银行 2019 年交易费率优惠活动的公告	上证报及公司网站	2019 年 3 月 30 日
3	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告	上证报及公司网站	2019 年 3 月 30 日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
5	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上证报及公司网站	2019 年 4 月 22 日
6	关于国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换	上证报及公司网站	2019 年 4 月 26 日

	及定期定额投资业务的公告		
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	上证报及公司网站	2019 年 5 月 17 日
8	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2019 年第 1 号）	上证报及公司网站	2019 年 6 月 11 日
9	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	上证报及公司网站	2019 年 6 月 27 日
10	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠的公告	上证报及公司网站	2019 年 6 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20190101~20190630	94,570,810.29	-	-	94,570,810.29	69.06%
	2	20190226~20190630	30,000,350.00	-	1,500,350.00	28,500,000.00	20.81%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。</p> <p>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，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

### 12.3 查阅方式

- 12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfoods.com.cn](http://www.gsfoods.com.cn)
- 12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2019 年 8 月 28 日