

**国联安添利增长债券型证券投资基金**  
**(原国联安鑫盈混合型证券投资基金转型)**

**2019年半年度报告**

**2019年6月30日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

## 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。

基金托管人中国建设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。

本基金由国联安鑫盈混合型证券投资基金转型而成。国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2019年4月29日以通讯方式召开，大会审议并通过《关于国联安鑫盈混合型证券投资基金转型相关事项的议案》。自4月30日起，“国联安鑫盈混合型证券投资基金”转型为“国联安添利增长债券型证券投资基金”，《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》同时生效。

本报告中，原国联安鑫盈混合型证券投资基金报告期自2019年1月1日至2019年4月29日止，国联安添利增长债券型证券投资基金报告期自2019年4月30日（基金合同生效日）至2019年6月30日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.1.1 国联安添利增长债券型证券投资基金.....                  | 5  |
| 2.1.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金.....                    | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6  |
| 2.2.1 国联安添利增长债券型证券投资基金.....                  | 6  |
| 2.2.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金.....                    | 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> .....                 | 7  |
| 3.1 国联安添利增长债券型证券投资基金.....                    | 7  |
| 3.1.1 主要会计数据和财务指标.....                       | 7  |
| 3.1.2 基金净值表现.....                            | 8  |
| 3.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金.....                      | 10 |
| 3.2.1 主要会计数据和财务指标.....                       | 10 |
| 3.2.2 基金净值表现.....                            | 11 |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 17 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....              | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 18 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 19 |
| 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.....       | 19 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 19 |
| 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..... | 19 |
| 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.....      | 19 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 20 |
| 6.1 国联安添利增长债券型证券投资基金.....                    | 20 |
| 6.1.1 资产负债表.....                             | 20 |
| 6.1.2 利润表.....                               | 21 |
| 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 22 |
| 6.1.4 报表附注.....                              | 23 |
| 6.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金.....                      | 43 |
| 6.2.1 资产负债表.....                             | 43 |
| 6.2.2 利润表.....                               | 45 |
| 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 46 |
| 6.2.4 报表附注.....                              | 47 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 66 |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.1 国联安添利增长债券型证券投资基金                    | 66        |
| 7.1.1 期末基金资产组合情况                        | 66        |
| 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                  | 67        |
| 7.1.3 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     | 67        |
| 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动                   | 67        |
| 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                  | 67        |
| 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细    | 68        |
| 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 68        |
| 7.1.8 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 | 68        |
| 7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细    | 68        |
| 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明             | 68        |
| 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明             | 68        |
| 7.1.12 投资组合报告附注                         | 69        |
| 7.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金                      | 69        |
| 7.2.1 期末基金资产组合情况                        | 69        |
| 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                  | 70        |
| 7.2.3 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     | 70        |
| 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动                   | 70        |
| 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                  | 70        |
| 7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细    | 71        |
| 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 71        |
| 7.2.8 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 | 71        |
| 7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细    | 71        |
| 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明             | 71        |
| 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明             | 72        |
| 7.2.12 投资组合报告附注                         | 72        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | <b>73</b> |
| 8.1 国联安添利增长债券型证券投资基金                    | 73        |
| 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 73        |
| 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 73        |
| 8.1.3 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     | 73        |
| 8.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金                      | 73        |
| 8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 74        |
| 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 74        |
| 8.2.3 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     | 74        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b>                      | <b>74</b> |
| 9.1 国联安添利增长债券型证券投资基金                    | 74        |
| 9.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金                      | 75        |
| <b>10 重大事件揭示</b>                        | <b>75</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                        | 75        |
| 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        | 75        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼             | 76        |
| 10.4 基金投资策略的改变                          | 76        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况                     | 76        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况       | 76        |

|                                |           |
|--------------------------------|-----------|
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....   | 76        |
| 10.7.1 国联安添利增长债券型证券投资基金 .....  | 76        |
| 10.7.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金 .....    | 78        |
| 10.8 其他重大事件 .....              | 80        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b> | <b>81</b> |
| 11.1 国联安添利增长债券型证券投资基金 .....    | 81        |
| 11.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金 .....      | 82        |
| 11.3 影响投资者决策的其他重要信息 .....      | 82        |
| <b>12 备查文件目录 .....</b>         | <b>82</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....              | 82        |
| 12.2 存放地点 .....                | 83        |
| 12.3 查阅方式 .....                | 83        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

|                 |                  |                |
|-----------------|------------------|----------------|
| 基金名称            | 国联安添利增长债券型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 国联安添利增长债券        |                |
| 基金主代码           | 003275           |                |
| 交易代码            | 003275           |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                |
| 基金合同生效日         | 2019年4月30日       |                |
| 基金管理人           | 国联安基金管理有限公司      |                |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司     |                |
| 报告期末基金份额总额      | 19,545,902.31份   |                |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 国联安添利增长债券 A      | 国联安添利增长债券 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 003275           | 003276         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 17,350,846.49 份  | 2,195,055.82 份 |

#### 2.1.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

|         |                |  |
|---------|----------------|--|
| 基金名称    | 国联安鑫盈混合型证券投资基金 |  |
| 基金简称    | 国联安鑫盈混合        |  |
| 基金主代码   | 003275         |  |
| 交易代码    | 003275         |  |
| 基金运作方式  | 契约型开放式         |  |
| 基金合同生效日 | 2016年9月29日     |  |

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 基金管理人           | 国联安基金管理有限公司     |                |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司    |                |
| 报告期末基金份额总额      | 20,671,865.87份  |                |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 国联安鑫盈混合 A       | 国联安鑫盈混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 003275          | 003276         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 17,927,577.64 份 | 2,744,288.23 份 |

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制投资风险和保持基金资产良好流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略   | 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。债券投资策略包括久期配置策略、期限结构配置策略及债券类别配置策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险较低收益的产品。  |

### 2.2.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制投资风险和保持基金资产良好流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 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。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%  |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，属于中等预期风险、中等预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。  |

## 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               | 中国建设银行股份有限公司                   |                      |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                        | 李华                             | 田青                   |
|             | 联系电话                      | 021-38992888                   | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱                      | customer.service@cpicfunds.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      | 021-38784766/4007000365   | 010-67595096                   |                      |
| 传真          | 021-50151582              | 010-66275853                   |                      |
| 注册地址        | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼 | 北京市西城区金融大街25号                  |                      |
| 办公地址        | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼              |                      |
| 邮政编码        | 200121                    | 100033                         |                      |
| 法定代表人       | 于业明                       | 田国立                            |                      |

## 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 | www.cpicfunds.com         |
| 基金半年度报告备置地点          | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称          | 办公地址                      |
|--------|-------------|---------------------------|
| 注册登记机构 | 国联安基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

#### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年4月30日至2019年6月30日) |             |
|-----------------|----------------------------|-------------|
|                 | 国联安添利增长债券 A                | 国联安添利增长债券 C |
| 本期已实现收益         | 71,502.63                  | 7,751.61    |
| 本期利润            | 183,312.21                 | 22,924.90   |
| 加权平均基金份额本期利润    | 0.0105                     | 0.0095      |

|                        |                         |              |
|------------------------|-------------------------|--------------|
| 本期加权平均净值利润率            | 0.92%                   | 0.84%        |
| 本期基金份额净值增长率            | 0.92%                   | 0.85%        |
| <b>3.1.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2019年6月30日)</b> |              |
|                        | 国联安添利增长债券 A             | 国联安添利增长债券 C  |
| 期末可供分配利润               | 2,541,805.51            | 291,199.28   |
| 期末可供分配基金份额利润           | 0.1465                  | 0.1327       |
| 期末基金资产净值               | 19,892,652.00           | 2,486,255.10 |
| 期末基金份额净值               | 1.1465                  | 1.1327       |
| <b>3.1.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2019年6月30日)</b> |              |
|                        | 国联安添利增长债券 A             | 国联安添利增长债券 C  |
| 基金份额累计净值增长率            | 0.92%                   | 0.85%        |

注：1、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。

2、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。

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、2019年4月30日起“国联安鑫盈混合型证券投资基金”转型为“国联安添利增长债券型证券投资基金”，国联安添利增长债券型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 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

国联安添利增长债券 A

| 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      | 0.40%    | 0.03%       | 0.79%      | 0.10%         | -0.39% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.92%    | 0.04%       | 0.58%      | 0.14%         | 0.34%  | -0.10% |

注：1、本基金基金合同于2019年4月30日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年；

2、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。

国联安添利增长债券 C

| 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      | 0.37%    | 0.03%       | 0.79%      | 0.10%         | -0.42% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.85%    | 0.04%       | 0.58%      | 0.14%         | 0.27%  | -0.10% |

注：1、本基金基金合同于2019年4月30日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年；

2、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。

### 3.1.2.2 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

国联安添利增长债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年4月30日至2019年6月30日)

国联安添利增长债券 A



注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%；

2、本基金基金合同于2019年4月30日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；

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。

国联安添利增长债券 C



注：1、本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%；  
 2、本基金基金合同于 2019 年 4 月 30 日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满一年；  
 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；  
 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 国联安鑫盈混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.2.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日至2019年4月29日) |           |
|-----------------|---------------------------|-----------|
|                 | 国联安鑫盈混合 A                 | 国联安鑫盈混合 C |
| 本期已实现收益         | 223,875.87                | 59,355.08 |
| 本期利润            | -73,005.45                | -2,522.06 |
| 加权平均基金份额本期利润    | -0.0047                   | -0.0007   |
| 本期加权平均净值利润率     | -0.41%                    | -0.07%    |
| 本期基金份额净值增长率     | -0.10%                    | -0.25%    |

| 3.2.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年4月29日) |              |
|-----------------|------------------|--------------|
|                 | 国联安鑫盈混合 A        | 国联安添利增长债券 C  |
| 期末可供分配利润        | 2,439,514.59     | 338,171.66   |
| 期末可供分配基金份额利润    | 0.1361           | 0.1232       |
| 期末基金资产净值        | 20,367,092.23    | 3,082,459.89 |
| 期末基金份额净值        | 1.1361           | 1.1232       |
| 3.2.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019年4月29日) |              |
|                 | 国联安鑫盈混合 A        | 国联安鑫盈混合 C    |
| 基金份额累计净值增长率     | 13.61%           | 12.32%       |

注：1、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。

2、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。

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、2019年4月30日起“国联安鑫盈混合型证券投资基金”转型为“国联安添利增长债券型证券投资基金”，国联安鑫盈混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时失效。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 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

国联安鑫盈混合 A

| 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<br>(2019年4月1日至<br>2019年4月29日)  | -0.83%   | 0.07%       | 0.16%      | 0.28%         | -0.99% | -0.21% |
| 过去六个月<br>(2019年1月1日起至<br>2019年4月29日) | -0.10%   | 0.08%       | 6.52%      | 0.30%         | -6.62% | -0.22% |
| 过去一年<br>(2018年7                      | 2.23%    | 0.08%       | 5.75%      | 0.30%         | -3.52% | -0.22% |

|  |        |       |        |       |       |        |
|--|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 月1日起至<br>2019年4月<br>29日)   |        |       |        |       |       |        |
| 自基金合同<br>生效(2016<br>年9月29日)<br>起至本基金<br>转型日前一<br>日(2019年4<br>月29日) | 13.61% | 0.14% | 10.91% | 0.22% | 2.70% | -0.08% |

注：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。

## 国联安鑫盈混合 C

| 阶段   | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|--|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月<br>(2019年4<br>月1日至<br>2019年4月<br>29日)                        | -0.86%       | 0.08%               | 0.16%          | 0.28%                 | -1.02% | -0.20% |
| 过去六个月<br>(2019年1<br>月1日起至<br>2019年4月<br>29日)                       | -0.25%       | 0.08%               | 6.52%          | 0.30%                 | -6.77% | -0.22% |
| 过去一年<br>(2018年7<br>月1日起至<br>2019年4月<br>29日)                        | 1.84%        | 0.08%               | 5.75%          | 0.30%                 | -3.91% | -0.22% |
| 自基金合同<br>生效(2016<br>年9月29日)<br>起至本基金<br>转型日前一<br>日(2019年4<br>月29日) | 12.32%       | 0.14%               | 10.91%         | 0.22%                 | 1.41%  | -0.08% |

注：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

### 国联安鑫盈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历史走势对比图

(2016年9月29日至2019年4月29日)

#### 国联安鑫盈混合 A



注：1、原国联安鑫盈混合型证券投资基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%；

2、原国联安鑫盈混合型证券投资基金的基金合同于 2016 年 9 月 29 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、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。

#### 国联安鑫盈混合 C



注：1、原国联安鑫盈混合型证券投资基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%；

2、原国联安鑫盈混合型证券投资基金的基金合同于 2016 年 9 月 29 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、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。

## 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，公司共管理四十六只开放式基金。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<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限  | 说明   |
|-----|--|----------------------|------|-------------|--|
|     |  | 任职日期                 | 离任日期 |             |  |
| 吕中凡 | 本基金基金经理，兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。 | 2016-09-29           | -    | 8年（自2011年起） | 吕中凡先生，硕士研究生。2005年7月至2008年7月在华虹宏力半导体制造有限公司（原宏力半导体制造有限公司）担任企业内部管理咨询管理师。2009年3月至2011年3月在上海远东资信评估有限公司（原上海远东鼎信财务咨询有限公司）担任信用评估项目经理。2011年5月加入国联安基金管理有限公司，历任信用分析员、债券组合助理、基金经理助理。2015年5月至2018年7月任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）的基金经理。2015年7月至2018年3月兼任国联安鑫富混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起兼任国联安添利增长债券型证券投资基金（原国联安鑫盈混合型证券投资基金）的基金经理。2016年10月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月起兼任国联安德盛增利债券证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年7月兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017年3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月起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月至2018年12月兼任国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经 |

|    |  |            |   |              |  |
|----|--|------------|---|--------------|--|
|    |  |            |   |              | 理。   |
| 薛琳 | 本基金基金经理、兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫汇混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫发混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫信心增益债券型证券投资基金基金经理、国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。 | 2019-01-31 | - | 13年(自2006年起) | 薛琳女士，硕士学位。2006年3月至2006年12月在上海红顶金融研究中心公司担任项目管理工作；2006年12月至2008年6月在上海国利货币有限公司担任债券交易员；2008年6月至2010年6月在上海长江养老保险股份有限公司担任债券交易员。2010年6月加入国联安基金管理有限公司，历任债券交易员、基金经理助理。2012年7月至2016年1月担任国联安货币市场证券投资基金的基金经理。2012年12月至2015年11月兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2015年6月起兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年5月兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至2017年10月兼任国联安鑫瑞混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月起兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月起兼任国联安添鑫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7月兼任国联安睿智定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起兼任国联安鑫汇混合型证券投资基金和国联安鑫发混合型证券投资基金的基金经理。2017年3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9月起兼任国联安鑫信心增益债券型证券投资基金 |

|     |            |            |            |              |   |
|-----|------------|------------|------------|--------------|---|
|     |            |            |            |              | 的基金经理。2018年7月起兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019年1月起兼任国联安添利增长债券型证券投资基金(原国联安鑫盈混合型证券投资基金)的基金经理。 |
| 王超伟 | 本基金基金经理助理。 | 2016-09-27 | 2019-06-27 | 11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》、《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》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 公平交易制度的执行情况

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，及时执行交易系统内的公平交易模块；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。公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2019 年上半年，为了国内经济顺利实现发展目标，货币政策总体还是维持了宽松的环境，银行间质押式回购利率创下了近年来新低。但银行间交易对手出现了分层现象，也造成了债券信用利差的扩大。

本基金由于认为货币政策宽松环境依旧持续，所以维持了一定的利率债比例，同时，考虑到产能过剩行业的公司债券债务负担逐渐加重，降低了持仓中信用资质偏弱的债券比重。目前持仓以利率债为主要持仓品种。

##### 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（2019 年 4 月 30 日至 2019 年 6 月 30 日），添利 A 的份额净值增长率为 0.92%，同期业绩比较基准收益率为 0.58%；添利 C 的份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 0.58%。

自本报告期初起至本基金转型日前一日（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 29 日），原国联安鑫盈 A 的份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为 6.52%；原国联安鑫盈 C 的份额净值增长率为-0.25%，同期业绩比较基准收益率为 6.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年债券市场，资金面仍将维持对债券市场相对友好的局面。虽然利率下行空间不大，但上行的风险也很小。因此本基金管理人将维持对债券市场相对乐观的态度，且保持相对积极的运作方式。

#### 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国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同的约定,以及国联安添利增长债券型证券投资基金实际运作情况,国联安添利增长债券型证券投资基金本报告期(2019年4月30日至2019年6月30日)未进行利润分配,符合国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同的相关规定。

根据法律法规的规定和国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同的约定,以及国联安鑫盈混合型证券投资基金实际运作情况,国联安鑫盈混合型证券投资基金本报告期(2019年1月1日至2019年4月29日)未进行利润分配,符合国联安鑫盈混合型证券投资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

2019年1月1日至2019年4月29日(原基金合同失效前日),国联安鑫盈混合型证券投资基金资产净值低于5000万。

基金管理人已通过基金转型,增加基金规模。

2019年4月30日(基金合同生效日)至2019年6月30日,国联安添利增长债券型证券投资基金资产净值低于5000万。

基金管理人拟开展持续营销活动,增加基金规模。

## 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

#### 6.1.1 资产负债表

会计主体：国联安添利增长债券型证券投资基金

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<br>2019年6月30日         |
|-----------------|-----------|---------------------------|
| <b>资 产：</b>     |           |                           |
| 银行存款            | 6.1.4.7.1 | 285,566.19                |
| 结算备付金           |           | 7,036.83                  |
| 存出保证金           |           | 1,496.42                  |
| 交易性金融资产         | 6.1.4.7.2 | 21,783,083.20             |
| 其中：股票投资         |           | -                         |
| 基金投资            |           | -                         |
| 债券投资            |           | 21,783,083.20             |
| 资产支持证券投资        |           | -                         |
| 贵金属投资           |           | -                         |
| 衍生金融资产          | 6.1.4.7.3 | -                         |
| 买入返售金融资产        | 6.1.4.7.4 | -                         |
| 应收证券清算款         |           | -                         |
| 应收利息            | 6.1.4.7.5 | 360,065.19                |
| 应收股利            |           | -                         |
| 应收申购款           |           | 905.82                    |
| 递延所得税资产         |           | -                         |
| 其他资产            | 6.1.4.7.6 | -                         |
| <b>资产总计</b>     |           | <b>22,438,153.65</b>      |
| <b>负债和所有者权益</b> |           | <b>本期末<br/>2019年6月30日</b> |
| <b>负 债：</b>     |           |                           |
| 短期借款            |           | -                         |
| 交易性金融负债         |           | -                         |
| 衍生金融负债          | 6.1.4.7.3 | -                         |
| 卖出回购金融资产款       |           | -                         |
| 应付证券清算款         |           | -                         |

|                   |            |                      |
|-------------------|------------|----------------------|
| 应付赎回款             |            | 99.70                |
| 应付管理人报酬           |            | 11,080.90            |
| 应付托管费             |            | 2,770.22             |
| 应付销售服务费           |            | 961.31               |
| 应付交易费用            | 6.1.4.7.7  | -                    |
| 应交税费              |            | 0.49                 |
| 应付利息              |            | -                    |
| 应付利润              |            | -                    |
| 递延所得税负债           |            | -                    |
| 其他负债              | 6.1.4.7.8  | 44,333.93            |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>59,246.55</b>     |
| <b>所有者权益：</b>     |            |                      |
| 实收基金              | 6.1.4.7.9  | 19,545,902.31        |
| 未分配利润             | 6.1.4.7.10 | 2,833,004.79         |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>22,378,907.10</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>22,438,153.65</b> |

注：1.报告截止日 2019 年 6 月 30 日，国联安添利增长债券型证券投资基金(原国联安鑫盈混合型证券投资基金)份额总额 19,545,902.31 份，其中 A 类基金份额为 17,350,846.49 份，基金份额净值为 1.1465 元；C 类基金份额为 2,195,055.82 份，基金份额净值为 1.1327 元。

2.本基金合同生效日为 2019 年 4 月 30 日，本报告期自 2019 年 4 月 30 日至 2019 年 6 月 30 日止。截至报告日，本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据，下同。

### 6.1.2 利润表

会计主体：国联安添利增长债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 4 月 30 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目         | 附注号        | 本期<br>2019 年 4 月 30 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------|---|
| <b>一、收入</b> |            | <b>252,018.08</b>                         |
| 1.利息收入      |            | 129,506.42                                |
| 其中：存款利息收入   | 6.1.4.7.11 | 799.20                                    |
| 债券利息收入      |            | 128,707.22                                |
| 资产支持证券利息收入  |            | -   |

|                            |            |                   |
|----------------------------|------------|-------------------|
| 买入返售金融资产收入                 |            | -                 |
| 其他利息收入                     |            | -                 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | -4,491.51         |
| 其中：股票投资收益                  |            | -                 |
| 基金投资收益                     |            | -                 |
| 债券投资收益                     | 6.1.4.7.12 | -4,491.51         |
| 资产支持证券投资收益                 |            | -                 |
| 贵金属投资收益                    |            | -                 |
| 衍生工具收益                     | 6.1.4.7.13 | -                 |
| 股利收益                       | 6.1.4.7.14 | -                 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.1.4.7.15 | 126,982.87        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.1.4.7.16 | 20.30             |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>45,780.97</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |            | 23,214.35         |
| 2. 托管费                     |            | 5,803.58          |
| 3. 销售服务费                   |            | 2,099.85          |
| 4. 交易费用                    | 6.1.4.7.17 | 7.53              |
| 5. 利息支出                    |            | -                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                 |
| 6. 税金及附加                   |            | 0.04              |
| 7. 其他费用                    | 6.1.4.7.18 | 14,655.62         |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>206,237.11</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>206,237.11</b> |

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安添利增长债券型证券投资基金

本报告期：2019年4月30日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2019年4月30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）        | 20,671,865.87               | 2,777,686.25 | 23,449,552.12 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利 | -                           | 206,237.11   | 206,237.11    |

|  |               |              |               |
|--|---------------|--------------|---------------|
| 润)                                     |               |              |               |
| 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)      | -1,125,963.56 | -150,918.57  | -1,276,882.13 |
| 其中：1.基金申购款                             | 13,004.23     | 1,821.32     | 14,825.55     |
| 2.基金赎回款                                | -1,138,967.79 | -152,739.89  | -1,291,707.68 |
| 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)                        | 19,545,902.31 | 2,833,004.79 | 22,378,907.10 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，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

## 6.1.4 报表附注

### 6.1.4.1 基金基本情况

国联安添利增长债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由国联安鑫盈混合型证券投资基金(以下简称“国联安鑫盈混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于 2019 年 4 月 30 日发布的《国联安基金管理有限公司关于国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2019 年 4 月 29 日表决通过了《关于国联安鑫盈混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，同时根据《关于准予国联安鑫盈混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]436 号)准予注册的批复，国联安鑫盈混合基金于 2019 年 4 月 30 日实施转型。同日起，《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》失效。原国联安鑫盈混合基金 A 类基金份额转为本基金 A 类基金份额，原国联安鑫盈混合基金 C 类基金份额转为本基金 C 类基金份额。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为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》和《国联安添利增长债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基

金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、可转换债券等)、货币市场工具、债券回购、银行存款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)。本基金不直接从二级市场买入可转换债券和可交换债券。本基金投资组合的比例范围为:本基金股票投资占基金资产的 0-25%,债券投资占基金资产的比例不低于 75%,持有的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、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

#### 6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.1.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.1.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.1.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债

券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.1.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票

估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.1.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.1.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.1.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《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《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019年6月30日 |            |
|----------------|-------------------|------------|
|                | 活期存款              | 285,566.19 |
| 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             | 285,566.19        |            |

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019年6月30日 |      |        |
|----|-------------------|------|--------|
|    | 成本                | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | -                 | -    | -      |

|               |       |               |               |           |
|---------------|-------|---------------|---------------|-----------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -             | -             | -         |
| 债券            | 交易所市场 | 21,733,223.81 | 21,783,083.20 | 49,859.39 |
|               | 银行间市场 | -             | -             | -         |
|               | 合计    | 21,733,223.81 | 21,783,083.20 | 49,859.39 |
| 资产支持证券        |       | -             | -             | -         |
| 基金            |       | -             | -             | -         |
| 其他            |       | -             | -             | -         |
| 合计            |       | 21,733,223.81 | 21,783,083.20 | 49,859.39 |

#### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 88.63             |
| 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  | 3.20              |
| 应收债券利息     | 359,972.66        |
| 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         | 0.70              |
| 合计         | 360,065.19        |

注：此处其他列示的是应收交易保证金利息。

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

#### 6.1.4.7.7 应付交易费用

本报告期末本基金无应付交易费用。

#### 6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提审计费       | 27,273.08         |
| 预提信息披露费     | 7,760.85          |
| 预提账户维护费     | 9,300.00          |
| 合计          | 44,333.93         |

#### 6.1.4.7.9 实收基金

国联安添利增长债券 A

金额单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年4月30日至2019年6月30日 |               |
|----------------|-----------------------------|---------------|
|                | 基金份额                        | 账面金额          |
| 基金合同生效日        | 17,927,577.64               | 17,927,577.64 |
| -集中申购募集资金本金及利息 | -                           | -             |
| -基金拆分和集中申购完成后  | -                           | -             |
| 本期申购           | 11,931.32                   | 11,931.32     |
| 本期赎回（以“-”号填列）  | -588,662.47                 | -588,662.47   |
| 本期末            | 17,350,846.49               | 17,350,846.49 |

国联安添利增长债券 C

金额单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年4月30日至2019年6月30日 |              |
|---------|-----------------------------|--------------|
|         | 基金份额                        | 账面金额         |
| 基金合同生效日 | 2,744,288.23                | 2,744,288.23 |

|                |              |              |
|----------------|--------------|--------------|
| -集中申购募集资金本金及利息 | -            | -            |
| -基金拆分和集中申购完成后  | -            | -            |
| 本期申购           | 1,072.91     | 1,072.91     |
| 本期赎回(以“-”号填列)  | -550,305.32  | -550,305.32  |
| 本期末            | 2,195,055.82 | 2,195,055.82 |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

国联安添利增长债券 A

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      |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 本期初            | 2,633,128.15 | -193,613.56 | 2,439,514.59 |
| 本期利润           | 71,502.63    | 111,809.58  | 183,312.21   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -85,499.11   | 4,477.82    | -81,021.29   |
| 其中：基金申购款       | 1,774.91     | -90.68      | 1,684.23     |
| 基金赎回款          | -87,274.02   | 4,568.50    | -82,705.52   |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -            |
| 本期末            | 2,619,131.67 | -77,326.16  | 2,541,805.51 |

国联安添利增长债券 C

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    |
|----------------|------------|------------|------------|
| 本期初            | 367,287.75 | -29,116.09 | 338,171.66 |
| 本期利润           | 7,751.61   | 15,173.29  | 22,924.90  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -74,312.56 | 4,415.28   | -69,897.28 |
| 其中：基金申购款       | 145.36     | -8.27      | 137.09     |
| 基金赎回款          | -74,457.92 | 4,423.55   | -70,034.37 |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -          |
| 本期末            | 300,726.80 | -9,527.52  | 291,199.28 |

#### 6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                    |
|----|-----------------------|
|    | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
|    |                       |

|           |        |
|-----------|--------|
| 活期存款利息收入  | 763.73 |
| 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 | 31.17  |
| 其他        | 4.30   |
| 合计        | 799.20 |

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

#### 6.1.4.7.12 债券投资收益

##### 6.1.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                    |
|------------------------------|-----------------------|
|                              | 2019年4月30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 | -4,491.51             |
| 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                           | -4,491.51             |

##### 6.1.4.7.12.2 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4月30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   | 3,294,386.70          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,219,388.03          |
| 减：应收利息总额               | 79,490.18             |
| 买卖债券差价收入               | -4,491.51             |

##### 6.1.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.1.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.1.4.7.13 衍生工具收益

本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.1.4.7.14 股利收益

本基金在本报告期无股利收益。

#### 6.1.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    |
|------------------------|-----------------------|
|                        | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
| 1.交易性金融资产              | 126,982.87            |
| ——股票投资                 | -                     |
| ——债券投资                 | 126,982.87            |
| ——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                     | 126,982.87            |

#### 6.1.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    |
|---------|-----------------------|
|         | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 20.30                 |
| 合计      | 20.30                 |

#### 6.1.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    |
|-----------|-----------------------|
|           | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 7.53                  |
| 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 | 7.53 |
|----|------|

#### 6.1.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期                    |
|----------|-----------------------|
|          | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
| 审计费      | 9,342.16              |
| 信息披露费    | -2,614.54             |
| 银行划款费用   | 190.00                |
| 银行间帐户维护费 | 7,688.00              |
| 其他       | 50.00                 |
| 合计       | 14,655.62             |

注：此处其他列示的是托管户更名印鉴变更费用。

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.1.4.9 关联方关系

##### 6.1.4.9.1 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无变化。

##### 6.1.4.9.2 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             |
|------------------------|---------------------|
| 安联集团                   | 基金管理人的股东            |
| 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 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 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            |

##### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.1.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.1.4.10.1.3 债券交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.1.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无应支付关联方的佣金。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                    |
|-----------------|-----------------------|
|                 | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 23,214.35             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,356.84              |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

##### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    |
|----------------|-----------------------|
|                | 2019年4月30日至2019年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,803.58              |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

##### 6.1.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|                |                         |
|----------------|-------------------------|
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期2019年4月30日至2019年6月30日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |

|             | 国联安添利增长债券 A | 国联安添利增长债券 C | 合计       |
|-------------|-------------|-------------|----------|
| 中国建设银行      | -           | 2,010.67    | 2,010.67 |
| 国联安基金管理有限公司 | -           | 47.87       | 47.87    |
| 合计          | -           | 2,058.54    | 2,058.54 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值0.45%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给国联安基金管理有限公司,再由国联安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.45%/当年天数。

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

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.4.1 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<br>2019年4月30日至2019年6月30日 |            |
|----------------------------|-----------------------------|------------|
|                            | 国联安添利增长债券A                  | 国联安添利增长债券C |
| 基金合同生效日(2019年4月30日)持有的基金份额 | 12,248,665.68               | -          |
| 期初持有的基金份额                  | 12,248,665.68               | -          |
| 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                  | 12,248,665.68               | -          |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 70.59%                      | -          |

##### 6.1.4.10.4.2 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

于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

##### 6.1.4.10.5 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<br>2019年4月30日至2019年6月30日 |
|-------|-----------------------------|
|       |                             |

|        | 期末余额       | 当期利息收入 |
|--------|------------|--------|
| 中国建设银行 | 285,566.19 | 763.73 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“建设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2019年6月30日的相关余额为人民币7,036.83元。

#### 6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.1.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元，因此没有作为抵押的债券。

###### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30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为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。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

#### **6.1.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，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；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 5.53%。本基金由原国联安鑫盈混合型证券投资基金转型而来，转型日（2019 年 4 月 30 日）起至本报告期末未满一年，无上年度数据。

#### **6.1.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合

理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

#### 6.1.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。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投资的公允价值。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金的基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的15%，本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.1.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。于2019年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2019年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为22,068,649.39元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.1.4.13.4 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。

##### 6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月<br>30日 | 1个月<br>以内      | 1-3个<br>月 | 6个月<br>以内 | 3个月<br>-1年       | 6个月<br>-1年 | 1年以内 | 1-5年              | 5年以上             | 不计息            | 合计                |
|-----------------------|----------------|-----------|-----------|------------------|------------|------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 资产                    |                |           |           |                  |            |      |                   |                  |                |                   |
| 其他资产                  | -              | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | -              | -                 |
| 银行存款                  | 285,566<br>.19 | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | -              | 285,566<br>.19    |
| 结算备付金                 | 7,036.8<br>3   | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | -              | 7,036.8<br>3      |
| 存出保证金                 | 1,496.4<br>2   | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | -              | 1,496.4<br>2      |
| 交易性金融<br>资产           | -              | -         | -         | 2,267,8<br>90.00 | -          | -    | 18,140,<br>293.20 | 1,374,900<br>.00 | -              | 21,783,<br>083.20 |
| 应收证券清<br>算款           | -              | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | -              | -                 |
| 应收利息                  | -              | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | 360,065.1<br>9 | 360,065<br>.19    |
| 应收申购款                 | -              | -         | -         | -                | -          | -    | -                 | -                | 905.82         | 905.82            |
| 资产总计                  | 294,099<br>.44 | -         | -         | 2,267,8<br>90.00 | -          | -    | 18,140,<br>293.20 | 1,374,900<br>.00 | 360,971.0<br>1 | 22,438,<br>153.65 |

|           |            |   |   |              |   |               |              |            |               |           |
|-----------|------------|---|---|--------------|---|---------------|--------------|------------|---------------|-----------|
| 负债        |            |   |   |              |   |               |              |            |               |           |
| 其他负债      | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 44,333.93     | 44,333.93 |
| 卖出回购金融资产款 | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | -             | -         |
| 应付证券清算款   | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | -             | -         |
| 应付赎回款     | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 99.70         | 99.70     |
| 应付管理人报酬   | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 11,080.90     | 11,080.90 |
| 应付托管费     | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 2,770.22      | 2,770.22  |
| 应付销售服务费   | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 961.31        | 961.31    |
| 应付交易费用    | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | -             | -         |
| 应交税费      | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 0.49          | 0.49      |
| 应付利息      | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | -             | -         |
| 负债总计      | -          | - | - | -            | - | -             | -            | -          | 59,246.55     | 59,246.55 |
| 利率敏感度缺口   | 294,099.44 | - | - | 2,267,890.00 | - | 18,140,293.20 | 1,374,900.00 | 301,724.46 | 22,378,907.10 |           |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|--------------------|-----------------------------|
| 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<br>2019年6月30日           |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加 164,120.92               |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少 164,120.92               |

注：本基金由原国联安鑫盈混合型证券投资基金转型而来，转型日（2019年4月30日）起至本报告期末未满一年，无上年度数据。

#### 6.1.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他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和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中债券的投资比例不低于基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年6月30日 |              |
|---------------|-------------------|--------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                 | -            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 21,783,083.20     | 97.34        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -            |
| 合计            | 21,783,083.20     | 97.34        |

##### 6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2019年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为5.53%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

本基金由原国联安鑫盈混合型证券投资基金转型而来，转型日（2019年4月30日）起至本报告期末未满一年，无上年度数据。

## 6.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：国联安鑫盈混合型证券投资基金

报告截止日：2019年4月29日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号       | 本期末<br>2019年4月29日         | 上年度末<br>2018年12月31日         |
|-----------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产:</b>      |           |                           |                             |
| 银行存款            | 6.2.4.7.1 | 1,702,081.74              | 178,054.06                  |
| 结算备付金           |           | 37,936.63                 | 38,559.45                   |
| 存出保证金           |           | 1,707.03                  | 10,572.58                   |
| 交易性金融资产         | 6.2.4.7.2 | 21,468,038.10             | 18,160,441.90               |
| 其中: 股票投资        |           | -                         | -                           |
| 基金投资            |           | -                         | -                           |
| 债券投资            |           | 21,468,038.10             | 18,160,441.90               |
| 资产支持证券投资        |           | -                         | -                           |
| 贵金属投资           |           | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.2.4.7.3 | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.2.4.7.4 | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |           | -                         | 10,948.70                   |
| 应收利息            | 6.2.4.7.5 | 285,656.02                | 374,073.85                  |
| 应收股利            |           | -                         | -                           |
| 应收申购款           |           | 297.91                    | 4,595.82                    |
| 递延所得税资产         |           | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.2.4.7.6 | -                         | -                           |
| <b>资产总计</b>     |           | <b>23,495,717.43</b>      | <b>18,777,246.36</b>        |
| <b>负债和所有者权益</b> |           | <b>本期末<br/>2019年4月29日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 6.2.4.7.3 | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |           | -                         | 3,400,000.00                |
| 应付证券清算款         |           | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |           | 295.24                    | 608.04                      |
| 应付管理人报酬         |           | 11,873.88                 | 7,872.86                    |
| 应付托管费           |           | 2,968.48                  | 1,968.22                    |
| 应付销售服务费         |           | 1,109.40                  | 1,723.32                    |
| 应付交易费用          | 6.2.4.7.7 | -                         | -                           |
| 应交税费            |           | -                         | -                           |
| 应付利息            |           | -                         | -725.20                     |
| 应付利润            |           | -                         | -                           |

|                   |            |                      |                      |
|-------------------|------------|----------------------|----------------------|
| 递延所得税负债           |            | -                    | -                    |
| 其他负债              | 6.2.4.7.8  | 29,918.31            | 295,000.75           |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>46,165.31</b>     | <b>3,706,447.99</b>  |
| <b>所有者权益：</b>     |            | -                    | -                    |
| 实收基金              | 6.2.4.7.9  | 20,671,865.87        | 13,288,360.01        |
| 未分配利润             | 6.2.4.7.10 | 2,777,686.25         | 1,782,438.36         |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>23,449,552.12</b> | <b>15,070,798.37</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>23,495,717.43</b> | <b>18,777,246.36</b> |

注：1.报告截止日 2019 年 4 月 29 日(基金合同失效前日)，国联安鑫盈混合型证券投资基金份额总额 20,671,865.87 份，其中 A 类基金份额为 17,927,577.64 份，基金份额净值为 1.1361 元；C 类基金份额为 2,744,288.23 份，基金份额净值为 1.1232 元。

2.本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 29 日(基金合同失效前日)止期间。

## 6.2.2 利润表

会计主体：国联安鑫盈混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 29 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 4 月 29 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6<br>月 30 日 |
|------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>      |            | <b>53,074.75</b>                         | <b>4,427,644.37</b>                           |
| 1.利息收入           |            | 256,814.25                               | 4,410,443.67                                  |
| 其中：存款利息收入        | 6.2.4.7.11 | 5,250.61                                 | 105,805.92                                    |
| 债券利息收入           |            | 251,563.64                               | 4,219,157.82                                  |
| 资产支持证券利息收入       |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入       |            | -  | 85,479.93                                     |
| 其他利息收入           |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |            | 154,469.06                               | 15,241,716.22                                 |
| 其中：股票投资收益        |            | -  | 29,071,247.54                                 |
| 基金投资收益           |            | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.2.4.7.12 | 154,469.06                               | -14,281,481.32                                |
| 资产支持证券投资收益       |            | -  | -   |
| 贵金属投资收益          |            | -  | -   |
| 衍生工具收益           | 6.2.4.7.13 | -  | -   |
| 股利收益             | 6.2.4.7.14 | -  | 451,950.00                                    |

|                            |            |                   |                     |
|----------------------------|------------|-------------------|---------------------|
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.2.4.7.15 | -358,758.46       | -15,236,914.16      |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                 | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.2.4.7.16 | 549.90            | 12,398.64           |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>128,602.26</b> | <b>1,281,279.80</b> |
| 1. 管理人报酬                   |            | 41,652.05         | 746,193.61          |
| 2. 托管费                     |            | 10,413.02         | 186,548.42          |
| 3. 销售服务费                   |            | 5,638.48          | 22,260.95           |
| 4. 交易费用                    | 6.2.4.7.17 | 42.82             | 142,300.68          |
| 5. 利息支出                    |            | 21,703.10         | 7,210.29            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 21,703.10         | 7,210.29            |
| 6. 税金及附加                   |            | -                 | 3,521.53            |
| 7. 其他费用                    | 6.2.4.7.18 | 49,152.79         | 173,244.32          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>-75,527.51</b> | <b>3,146,364.57</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                 | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>-75,527.51</b> | <b>3,146,364.57</b> |

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安鑫盈混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年4月29日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2019年1月1日至2019年4月29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）                   | 13,288,360.01              | 1,782,438.36 | 15,070,798.37 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                          | -75,527.51   | -75,527.51    |
| 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） | 7,383,505.86               | 1,070,775.40 | 8,454,281.26  |
| 其中：1.基金申购款                        | 13,328,179.09              | 1,892,864.62 | 15,221,043.71 |
| 2.基金赎回款                           | -5,944,673.23              | -822,089.22  | -6,766,762.45 |
| 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)                        | 20,671,865.87                   | 2,777,686.25   | 23,449,552.12   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1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)                        | 421,466,075.41                  | 34,960,921.79  | 456,426,997.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 3,146,364.57   | 3,146,364.57    |
| 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)      | -401,060,885.75                 | -35,910,305.86 | -436,971,191.61 |
| 其中：1.基金申购款                             | 15,419,393.09                   | 1,250,053.42   | 16,669,446.51   |
| 2.基金赎回款                                | -416,480,278.84                 | -37,160,359.28 | -453,640,638.12 |
| 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)                        | 20,405,189.66                   | 2,196,980.50   | 22,602,170.16   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，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

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

国联安鑫盈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”)证监许可[2016]1907号《关于准予国联安鑫盈混合型证券投资基金注册的批复》核准，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》和《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 897,641,233.86 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1600659 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安鑫盈混合型证券投资基金基

金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 897,712,115.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 70,881.21 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》和《国联安鑫盈混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于 2019 年 4 月 30 日发布的《国联安基金管理有限公司关于国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2019 年 4 月 29 日表决通过了《关于国联安鑫盈混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，同时根据《关于准予国联安鑫盈混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]436 号)准予注册的批复，本基金于 2019 年 4 月 30 日实施转型。同日起，《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》生效，原《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》失效。本基金的基金份额持有人将按照《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、可转换债券等)、货币市场工具、债券回购、银行存款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)。本基金不直接从二级市场买入可转换债券和可交换债券。本基金投资组合的比例范围为：本基金股票投资占基金资产的 0-25%，债券投资占基金资产的比例不低于 75%，持有的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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。

#### 6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》

和在财务报表附注 6.2.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 4 月 29 日(基金合同失效前日)，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案；同时，经中国证监会批准，基金管理人国联安基金管理有限公司将本基金转型为国联安添利增长债券型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### **6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 29 日(基金合同失效前日)止期间的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 2019 年 4 月 29 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 29 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.2.4.4 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。

#### **6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

#### **6.2.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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《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[2016]36 号《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《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《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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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,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。

对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。

(2)对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,股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目           | 本期末<br>2019年4月29日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 1,702,081.74      |
| 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           | 1,702,081.74      |

##### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年4月29日 |               |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | -                 | -             | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场             | 21,545,161.58 | 21,468,038.10 |
|               | 银行间市场             | -             | -             |
|               | 合计                | 21,545,161.58 | 21,468,038.10 |
| 资产支持证券        | -                 | -             | -             |
| 基金            | -                 | -             | -             |
| 其他            | -                 | -             | -             |
| 合计            | 21,545,161.58     | 21,468,038.10 | -77,123.48    |

#### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年4月29日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,625.73          |
| 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  | 151.80            |
| 应收债券利息     | 283,875.29        |
| 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 | 3.20       |
| 合计 | 285,656.02 |

注：此处其他列示的是交易保证金利息。

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

本报告期末本基金无应付交易费用。

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年4月29日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提审计费       | 17,930.92         |
| 预提信息披露费     | 10,375.39         |
| 预提账户维护费     | 1,612.00          |
| 合计          | 29,918.31         |

#### 6.2.4.7.9 实收基金

国联安鑫盈混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年4月29日 |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额          |
| 上年度末          | 9,638,750.98               | 9,638,750.98  |
| 本期申购          | 12,382,730.80              | 12,382,730.80 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,093,904.14              | -4,093,904.14 |
| 本期末           | 17,927,577.64              | 17,927,577.64 |

国联安鑫盈混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|               | 2019年1月1日至2019年4月29日 |               |
|---------------|----------------------|---------------|
|               | 基金份额                 | 账面金额          |
| 上年度末          | 3,649,609.03         | 3,649,609.03  |
| 本期申购          | 945,448.29           | 945,448.29    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,850,769.09        | -1,850,769.09 |
| 本期末           | 2,744,288.23         | 2,744,288.23  |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.2.4.7.10 未分配利润

国联安鑫盈混合 A

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      |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 本期初            | 1,235,177.30 | 87,587.19   | 1,322,764.49 |
| 本期利润           | 223,875.87   | -296,881.32 | -73,005.45   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,174,074.98 | 15,680.57   | 1,189,755.55 |
| 其中：基金申购款       | 1,755,794.50 | 13,327.70   | 1,769,122.20 |
| 基金赎回款          | -581,719.52  | 2,352.87    | -579,366.65  |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -            |
| 本期末            | 2,633,128.15 | -193,613.56 | 2,439,514.59 |

国联安鑫盈混合 C

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     |
|----------------|-------------|------------|-------------|
| 本期初            | 426,604.59  | 33,069.28  | 459,673.87  |
| 本期利润           | 59,355.08   | -61,877.14 | -2,522.06   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -118,671.92 | -308.23    | -118,980.15 |
| 其中：基金申购款       | 122,552.65  | 1,189.77   | 123,742.42  |
| 基金赎回款          | -241,224.57 | -1,498.00  | -242,722.57 |
| 本期已分配利润        | -           | -          | -           |
| 本期末            | 367,287.75  | -29,116.09 | 338,171.66  |

#### 6.2.4.7.11 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4月29日 |
| 活期存款利息收入  | 4,740.25             |
| 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 | 502.31               |
| 其他        | 8.05                 |
| 合计        | 5,250.61             |

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

#### 6.2.4.7.12 债券投资收益

##### 6.2.4.7.12.1 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4月29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 | 154,469.06           |
| 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                            | 154,469.06           |

##### 6.2.4.7.12.2 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4月29日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 21,028,970.82        |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 20,275,018.24        |
| 减：应收利息总额                | 599,483.52           |
| 买卖债券差价收入                | 154,469.06           |

##### 6.2.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.2.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.2.4.7.13 衍生工具收益

本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.2.4.7.14 股利收益

本基金在本报告期无股利收益。

#### 6.2.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2019年1月1日至2019年4月29日 |
| 1.交易性金融资产              | -358,758.46          |
| ——股票投资                 | -                    |
| ——债券投资                 | -358,758.46          |
| ——资产支持证券投资             | -                    |
| ——贵金属投资                | -                    |
| 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                     | -358,758.46          |

#### 6.2.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2019年1月1日至2019年4月29日 |
| 基金赎回费收入 | 549.90               |
| 合计      | 549.90               |

#### 6.2.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2019年1月1日至2019年4月29日 |
| 交易所市场交易费用 | 42.82                |
| 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     | 42.82 |

#### 6.2.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2019年1月1日至2019年4月29日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费      | 17,930.92                  |
| 信息披露费    | 10,375.39                  |
| 银行划款费用   | 634.48                     |
| 银行间帐户维护费 | 20,212.00                  |
| 其他       | -                          |
| 合计       | 49,152.79                  |

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

国联安鑫盈混合型证券投资基金自 2019 年 4 月 30 日起失效。同日起，《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》生效，同时本基金转型为国联安添利增长债券型证券投资基金。

#### 6.2.4.9 关联方关系

##### 6.2.4.9.1 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无变化。

##### 6.2.4.9.2 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             |
|------------------------|---------------------|
| 安联集团                   | 基金管理人的股东            |
| 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 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 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            |

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。

#### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

上年度可比期间所披露的与国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）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6月30日止期间的交易。

##### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.2.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.2.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.2.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年4月29日 |              | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国泰君安  | -                          | -            | 31,545,858.53                   | 6.10%        |

###### 6.2.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

##### 6.2.4.10.2 关联方报酬

###### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年4月<br>29日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 41,652.05                      | 746,193.61                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,435.98                      | 38,244.85                           |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年

费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.2.4.10.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年4月29日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 10,413.02            | 186,548.42           |

注: 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.2.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称  | 本期2019年1月1日至2019年4月29日 |           |           |
|-----------------|------------------------|-----------|-----------|
|                 | 当期发生的基金应支付的销售服务费       |           |           |
|                 | 国联安鑫盈混合A               | 国联安鑫盈混合C  | 合计        |
| 中国建设银行          | -                      | 4,954.86  | 4,954.86  |
| 国联安基金管理有<br>限公司 | -                      | 92.47     | 92.47     |
| 合计              | -                      | 5,047.33  | 5,047.33  |
| 获得销售服务费的各关联方名称  | 上年度可比期间                |           |           |
|                 | 2018年1月1日至2018年6月30日   |           |           |
|                 | 当期发生的基金应支付的销售服务费       |           |           |
|                 | 国联安鑫盈混合A               | 国联安鑫盈混合C  | 合计        |
| 国泰君安            | -                      | 696.46    | 696.46    |
| 中国建设银行          | -                      | 16,678.81 | 16,678.81 |
| 国联安基金管理有<br>限公司 | -                      | 3,381.04  | 3,381.04  |
| 合计              | -                      | 20,756.31 | 20,756.31 |

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值0.45%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给国联安基金管理有限公司, 再由国联安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为: 日销售服务费 = 前一日C类基金资产净值 × 0.45% / 当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

**6.2.4.10.4.1 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<br>2019年1月1日至2019年4月29日 |          | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |          |
|-----------------------|----------------------------|----------|---------------------------------|----------|
|                       | 国联安鑫盈混合A                   | 国联安鑫盈混合C | 国联安鑫盈混合A                        | 国联安鑫盈混合C |
| 期初持有的基金份额             | -                          | -        | -                               | -        |
| 期间申购/买入总份额            | 12,248,665.68              | -        | -                               | -        |
| 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             | 12,248,665.68              | -        | -                               | -        |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 68.32%                     | -        | -                               | -        |

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

**6.2.4.10.4.2 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**

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

**6.2.4.10.5 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<br>2019年1月1日至2019年4月29日 |          | 上年度可比期间<br>2018年1月1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     |
| 中国建设银行 | 1,702,081.74               | 4,740.25 | 2,976,640.71                    | 102,479.75 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“建设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2019年4月29日的相关余额为人民币37,936.63元。（2018年6月30日的相关余额为：人民币190,337.99元。）

**6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.2.4.12 期末（2019年4月29日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 4 月 29 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

###### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 4 月 29 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为 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。

#### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

#### **6.2.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，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；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于2019年4月29日，原国联安鑫盈基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为0%（上年度2018年12月31日：0%）。

#### **6.2.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

##### **6.2.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。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投资的公允价值。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金的基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的15%，本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.2.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **6.2.4.13.4 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。

##### **6.2.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年4月<br>29日 | 1个月<br>以内    | 1-3个<br>月 | 6个月<br>以内 | 3个月<br>-1年 | 6个月<br>-1年 | 1年以内 | 1-5年          | 5年以上       | 不计息        | 合计            |
|-----------------------|--------------|-----------|-----------|------------|------------|------|---------------|------------|------------|---------------|
| 资产                    |              |           |           |            |            |      |               |            |            |               |
| 其他资产                  | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | -             |
| 银行存款                  | 1,702,081.74 | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | 1,702,081.74  |
| 结算备付金                 | 37,936.63    | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | 37,936.63     |
| 存出保证金                 | 1,707.03     | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | 1,707.03      |
| 交易性金融资产               | -            | -         | -         | 249,800.00 | -          | -    | 20,806,505.80 | 411,732.30 | -          | 21,468,038.10 |
| 应收证券清算款               | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | -             |
| 应收利息                  | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 285,656.02 | 285,656.02    |
| 应收申购款                 | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 297.91     | 297.91        |
| 资产总计                  | 1,741,725.40 | -         | -         | 249,800.00 | -          | -    | 20,806,505.80 | 411,732.30 | 285,953.93 | 23,495,717.43 |
| 负债                    |              |           |           |            |            |      |               |            |            |               |
| 其他负债                  | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 29,918.31  | 29,918.31     |
| 卖出回购金融资产款             | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | -             |
| 应付证券清算款               | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | -          | -             |
| 应付赎回款                 | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 295.24     | 295.24        |
| 应付管理人报酬               | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 11,873.88  | 11,873.88     |
| 应付托管费                 | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 2,968.48   | 2,968.48      |
| 应付销售服务费               | -            | -         | -         | -          | -          | -    | -             | -          | 1,109.40   | 1,109.40      |

|                     |              |       |       |              |        |      |               |              |            |            |               |
|---------------------|--------------|-------|-------|--------------|--------|------|---------------|--------------|------------|------------|---------------|
| 应付交易费用              | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | -             |
| 应交税费                | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | -             |
| 应付利息                | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | -             |
| 负债总计                | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 46,165.31  | 46,165.31     |
| 利率敏感度缺口             | 1,741,725.40 | -     | -     | 249,800.00   | -      | -    | 20,806,505.80 | 411,732.30   | 239,788.62 | -          | 23,449,552.12 |
| 上年度末<br>2018年12月31日 | 1个月以内        | 1-3个月 | 6个月以内 | 3个月-1年       | 6个月-1年 | 1年以内 | 1-5年          | 5年以上         | 不计息        | 合计         |               |
| 资产                  |              |       |       |              |        |      |               |              |            |            |               |
| 其他资产                | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | -             |
| 银行存款                | 178,054.06   | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | 178,054.06    |
| 结算备付金               | 38,559.45    | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | 38,559.45     |
| 存出保证金               | 10,572.58    | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | 10,572.58     |
| 交易性金融资产             | -            | -     | -     | 1,708,484.40 | -      | -    | 14,964,676.40 | 1,487,281.10 | -          | -          | 18,160,441.90 |
| 应收证券清算款             | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 10,948.70  | 10,948.70     |
| 应收利息                | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 374,073.85 | 374,073.85    |
| 应收申购款               | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 4,595.82   | 4,595.82      |
| 资产总计                | 227,186.09   | -     | -     | 1,708,484.40 | -      | -    | 14,964,676.40 | 1,487,281.10 | 389,618.37 | -          | 18,777,246.36 |
| 负债                  |              |       |       |              |        |      |               |              |            |            |               |
| 其他负债                | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 295,000.75 | 295,000.75    |
| 卖出回购金融资产款           | 3,400,000.00 | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | 3,400,000.00  |
| 应付证券清算款             | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | -          | -             |
| 应付赎回款               | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 608.04     | 608.04        |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 7,872.86   | 7,872.86      |
| 应付托管费               | -            | -     | -     | -            | -      | -    | -             | -            | -          | 1,968.22   | 1,968.22      |

|         |               |   |   |              |   |   |   |               |              |               |
|---------|---------------|---|---|--------------|---|---|---|---------------|--------------|---------------|
| 应付销售服务费 | -             | - | - | -            | - | - | - | -             | 1,723.32     | 1,723.32      |
| 应付交易费用  | -             | - | - | -            | - | - | - | -             | -            | -             |
| 应交税费    | -             | - | - | -            | - | - | - | -             | -            | -             |
| 应付利息    | -             | - | - | -            | - | - | - | -             | -725.20      | -725.20       |
| 负债总计    | 3,400,000.00  | - | - | -            | - | - | - | -             | 306,447.99   | 3,706,447.99  |
| 利率敏感度缺口 | -3,172,813.91 | - | - | 1,708,484.40 | - | - | - | 14,964,676.40 | 1,487,281.10 | 15,070,798.37 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2019年4月29日           | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 增加 135,601.03               | 增加 178,348.42       |
|    | 市场利率上升25个基点        | 减少 135,601.03               | 减少 178,348.42       |

#### 6.2.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他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和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的0-25%，债券投资占基金资产的比例不低于75%，持有的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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年4月29日 |               | 上年度末<br>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  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 21,468,038.10     | 91.55         | 18,160,441.90       | 120.50        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -             | -                   | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计            | 21,468,038.10     | 91.55         | 18,160,441.90       | 120.50        |

#### 6.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2019年4月29日，原国联安鑫盈混合型证券投资基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为0%(上年度2018年12月31日：0%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析(上年度2018年12月31日：同)。

## 7 投资组合报告

### 7.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

(报告期：2019年4月30日-2019年6月30日)

#### 7.1.1 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         | -             | -             |
|    | 其中：股票        | -             | -             |
| 2  | 基金投资         | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资       | 21,783,083.20 | 97.08         |
|    | 其中：债券        | 21,783,083.20 | 97.08         |
|    | 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 | 292,603.02    | 1.30   |
| 8 | 其他各项资产       | 362,467.43    | 1.62   |
| 9 | 合计           | 22,438,153.65 | 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。

## 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.1.2.2 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港股通股票投资。

## 7.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.1.4.1 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 7.1.4.2 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

本基金本报告期内未卖出股票。

## 7.1.5 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      | 11,839,604.80 | 52.91         |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 9,324,518.40  | 41.67         |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,324,518.40  | 41.67         |
| 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） | 618,960.00    | 2.77          |
| 8  | 同业存单      | -             | -             |

|    |    |               |       |
|----|----|---------------|-------|
| 9  | 其他 | -             | -     |
| 10 | 合计 | 21,783,083.20 | 97.34 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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  | 018007 | 国开 1801  | 69,120 | 6,972,134.40 | 31.15        |
| 2  | 010303 | 03 国债(3) | 66,820 | 6,758,174.80 | 30.20        |
| 3  | 018006 | 国开 1702  | 23,040 | 2,352,384.00 | 10.51        |
| 4  | 010107 | 21 国债(7) | 20,000 | 2,057,600.00 | 9.19         |
| 5  | 019611 | 19 国债 01 | 14,000 | 1,398,880.00 | 6.25         |

#### 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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。

#### 7.1.8 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。

#### 7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.1.10.1 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。

##### 7.1.10.2 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。

#### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.1.11.1 本期国债期货投资政策

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。

##### 7.1.11.2 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。

### 7.1.11.3 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。

### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.1.12.2 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。

### 7.1.12.3 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   | 1,496.42   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 360,065.19 |
| 5  | 应收申购款   | 905.82     |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 362,467.43 |

### 7.1.12.4 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。

### 7.1.12.5 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。

## 7.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年4月29日)

### 7.2.1 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  | -  | -            |
|    | 其中：股票 | -  | -            |
| 2  | 基金投资  | -  | -            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 3 | 固定收益投资            | 21,468,038.10 | 91.37  |
|   | 其中：债券             | 21,468,038.10 | 91.37  |
|   | 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      | 1,740,018.37  | 7.41   |
| 8 | 其他各项资产            | 287,660.96    | 1.22   |
| 9 | 合计                | 23,495,717.43 | 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。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2.2 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港股通股票投资。

## 7.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.2.4.1 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 7.2.4.2 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

本基金本报告期内未卖出股票。

## 7.2.5 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 | 9,401,828.10 | 40.09         |
| 2  | 央行票据 | -            | -             |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
| 3  | 金融债券      | 12,066,210.00 | 51.46 |
|    | 其中：政策性金融债 | 12,066,210.00 | 51.46 |
| 4  | 企业债券      | -             | -     |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | -             | -     |
| 7  | 可转债（可转换债） | -             | -     |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 21,468,038.10 | 91.55 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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  | 018007 | 国开 1801  | 92,820 | 9,328,410.00 | 39.78        |
| 2  | 010303 | 03 国债(3) | 66,820 | 6,694,695.80 | 28.55        |
| 3  | 018006 | 国开 1702  | 27,040 | 2,737,800.00 | 11.68        |
| 4  | 010107 | 21 国债(7) | 20,000 | 2,045,600.00 | 8.72         |
| 5  | 019517 | 15 国债 17 | 3,930  | 390,642.00   | 1.67         |

### 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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。

### 7.2.8 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。

### 7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.2.10.1 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。

#### 7.2.10.2 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。

## 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.2.11.1 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。

### 7.2.11.2 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。

### 7.2.11.3 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。

## 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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，原国联安鑫盈混合型证券投资基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.2.12.2 原国联安鑫盈混合型证券投资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。

### 7.2.12.3 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   | 1,707.03   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 285,656.02 |
| 5  | 应收申购款   | 297.91     |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 287,660.96 |

### 7.2.12.4 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。

### 7.2.12.5 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

(报告期: 2019年4月30日-2019年6月30日)

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

| 份额级别        | 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  |
| 国联安添利增长债券 A | 193      | 89,900.76 | 12,248,665.68 | 70.59% | 5,102,180.81 | 29.41%  |
| 国联安添利增长债券 C | 52       | 42,212.61 | -             | -      | 2,195,055.82 | 100.00% |
| 合计          | 245      | 79,779.19 | 12,248,665.68 | 62.67% | 7,297,236.63 | 37.33%  |

#### 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别        | 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 | 国联安添利增长债券 A | 8.75      | 0.00%    |
|                  | 国联安添利增长债券 C | 8.88      | 0.00%    |
|                  | 合计          | 17.63     | 0.00%    |

#### 8.1.3 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

| 项目                             | 份额级别        | 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 | 国联安添利增长债券 A | 0                 |
|                                | 国联安添利增长债券 C | 0~10              |
|                                | 合计          | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国联安添利增长债券 A | -                 |
|                                | 国联安添利增长债券 C | -                 |
|                                | 合计          | -                 |

注: 截止本报告期末, 本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

### 8.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

(报告期: 2019年1月1日-2019年4月29日)

### 8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 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  |
| 国联安鑫盈混合 A | 198      | 90,543.32 | 12,248,665.68 | 68.32% | 5,678,911.96 | 31.68%  |
| 国联安鑫盈混合 C | 55       | 49,896.15 | -             | -      | 2,744,288.23 | 100.00% |
| 合计        | 253      | 81,706.98 | 12,248,665.68 | 59.25% | 8,423,200.19 | 40.75%  |

### 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 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 | 国联安鑫盈混合 A | 0.00      | 0.00%    |
|                  | 国联安鑫盈混合 C | 8.88      | 0.00%    |
|                  | 合计        | 8.88      | 0.00%    |

### 8.2.3 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

| 项目                             | 份额级别      | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 国联安鑫盈混合 A | 0                 |
|                                | 国联安鑫盈混合 C | 0~10              |
|                                | 合计        | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国联安鑫盈混合 A | -                 |
|                                | 国联安鑫盈混合 C | -                 |
|                                | 合计        | -                 |

注：截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

### 9.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

(报告期：2019年4月30日-2019年6月30日)

单位：份

| 项目                 | 国联安添利增长债券 A   | 国联安添利增长债券 C  |
|--------------------|---------------|--------------|
| 基金合同生效日(2019年4月30) | 17,927,577.64 | 2,744,288.23 |

|                         |               |              |
|-------------------------|---------------|--------------|
| 日)基金份额总额                |               |              |
| 本报告期期初基金份额总额            | 17,927,577.64 | 2,744,288.23 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额   | 11,931.32     | 1,072.91     |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 588,662.47    | 550,305.32   |
| 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            | 17,350,846.49 | 2,195,055.82 |

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。

## 9.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

(报告期:2019年1月1日-2019年4月29日)

单位:份

| 项目                        | 国联安鑫盈混合 A      | 国联安鑫盈混合 C      |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年9月29日)基金份额总额 | 725,796,625.75 | 171,915,489.32 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 9,638,750.98   | 3,649,609.03   |
| 本报告期基金总申购份额               | 12,382,730.80  | 945,448.29     |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 4,093,904.14   | 1,850,769.09   |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 17,927,577.64  | 2,744,288.23   |

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 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

2019年3月26日,本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议审议并通过了《关于国联安鑫盈混合型证券投资基金转型相关事项的议案》。

### 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

1、2019年1月31日,基金管理人发布《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金经理变更公告》,薛琳女士担任本基金的基金经理。

2、2019年6月19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》,

李柯女士担任公司首席信息官职务。

3、托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

自 2019 年 4 月 30 日起“国联安鑫盈混合型证券投资基金”转型为“国联安添利增长债券型证券投资基金”，《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》及《国联安添利增长债券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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

（报告期：2019年4月30日-2019年6月30日）

##### 10.7.1.1 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 |    |
| 华创证券有限责任公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

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

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

10.7.1.2 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 |
| 华创证券有限责任公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券股份有限公司   | 21,119.99    | 0.32%        | -    | -            | -    | -            |
| 西南证券股份有限公司   | 6,601,709.30 | 99.68%       | -    | -            | -    | -            |

10.7.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年4月29日)

10.7.2.1 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      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 华创证券有<br>限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
|--------------|---|---|---|---|---|---|

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

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

### 10.7.2.2 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 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司   | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 东北证券股份有限公司   | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 西南证券股份有限公司   | 41,769,860.20 | 100.00%      | 35,200,000.00 | 100.00%      | -    | -            |
| 华创证券有限责任公司   | -             | -            | -             | -            | -    | -            |

### 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  | 国联安鑫盈混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告                          | 上海证券报、公司网站            | 2019-01-19 |
| 2  | 国联安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司、钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2019-01-29 |
| 3  | 国联安鑫盈混合型证券投资基金基金经理变更公告                                 | 上海证券报、公司网站            | 2019-01-31 |
| 4  | 国联安基金管理有限公司关于调整旗下基金风险等级划分情况的公告                         | 公司网站                  | 2019-03-08 |
| 5  | 国联安基金管理有限公司关于以通讯方式召开国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告         | 上海证券报、公司网站            | 2019-03-26 |
| 6  | 国联安基金管理有限公司关于以通讯方式召开国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告的一次提示性公告 | 上海证券报、公司网站            | 2019-03-27 |
| 7  | 国联安基金管理有限公司关于以通讯方式召开国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告的二次提示性公告 | 上海证券报、公司网站            | 2019-03-28 |
| 8  | 国联安鑫盈混合型证券投资基金 2018 年年度报告                              | 上海证券报、公司网站            | 2019-03-30 |
| 9  | 国联安鑫盈混合型证券投资基金 2019 年第 1                               | 上海证券报、公司网             | 2019-04-22 |

|    | 季度报告                                    | 站                          |            |
|----|---|----------------------------|------------|
| 10 | 国联安基金管理有限公司关于国联安鑫盈混合型证券投资基金             | 上海证券报、公司网站                 | 2019-04-30 |
| 11 | 国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同                    | 公司网站                       | 2019-04-30 |
| 12 | 国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同摘要                  | 公司网站                       | 2019-04-30 |
| 13 | 国联安添利增长债券型证券投资基金托管协议                    | 公司网站                       | 2019-04-30 |
| 14 | 国联安添利增长债券型证券投资基金招募说明书                   | 公司网站                       | 2019-04-30 |
| 15 | 国联安鑫盈混合型证券投资基金招募说明书(更新)                 | 上海证券报、公司网站                 | 2019-05-11 |
| 16 | 国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2019-06-19 |
| 17 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2019-06-21 |
| 18 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2019-06-28 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 国联安添利增长债券型证券投资基金

#### 11.1.1 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              | 2019年4月30日至2019年6月30日  | 12,248,665.68 | -    | -    | 12,248,665.68 | 62.67% |
| 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</p> <p>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</p> |                |                        |               |      |      |               |        |

能对基金资产净值造成较大波动。

(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。

## 11.2 国联安鑫盈混合型证券投资基金

### 11.2.1 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2月20日至2019年4月29日  | -    | 12,248,665.68 | -    | 12,248,665.68 | 59.25% |
| 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<br/>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<br/>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> |                |                        |      |               |      |               |        |

### 11.3 影响投资者决策的其他重要信息

国联安添利增长债券型证券投资基金由国联安鑫盈混合型证券投资基金转型而成。国联安鑫盈混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，2019年4月29日大会审议并通过《关于国联安鑫盈混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，内容包括国联安鑫盈混合型证券投资基金变更运作方式、投资策略、基金更名和修订基金合同等。自4月30日起，《国联安鑫盈混合型证券投资基金基金合同》失效且《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》生效。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安鑫盈混合型证券投资基金(现国联安添利增长债券型证券投资基金)

#### 发行及募集的文件

- 2、《国联安添利增长债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安添利增长债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安添利增长债券型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

#### 12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

#### 12.3 查阅方式

网址：[www.epicfunds.com](http://www.epicfunds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日