

# 国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年第 3 季度报告

### 2019 年 9 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十三日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 国联安通盈混合  |
| 基金主代码      | 000664   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2014 年 6 月 13 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 458,724,510.12 份   |
| 投资目标       | 本基金通过构建有效的投资组合，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。  |
| 投资策略       | <p>(1) 资产配置策略</p> <p>本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。</p> |

## （2）股票投资策略

在股票投资上本基金主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时，适度把握宏观经济情况进行资产配置。具体来说，本基金通过以下步骤进行股票选择：

首先，通过 ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力，通过 WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本；其次，将公司的获利能力和资本成本指标相结合，选择出创造价值的公司；最后，根据公司的成长能力和估值指标，选择股票，构建股票组合。

## （3）普通债券投资策略

在债券投资上，本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

- 1) 信用等级高、流动性好；
- 2) 资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；
- 3) 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；
- 4) 公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

## （4）中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评

|               |   |
|---------------|---|
|               | <p>估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。</p> <p>(5) 股指期货投资策略</p> <p>在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。</p> <p>(6) 权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资。</p> <p>1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，根据 BS 模型和溢价率对权证的合理价值做出判断，对价值被低估的权证进行投资；</p> <p>2)基于对权证标的股票未来走势的预期，充分利用权证的杠杆比率高的特点，对权证进行单边投资；</p> <p>3)基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资，或利用权证进行风险对冲。</p> <p>(7) 资产支持证券等品种投资策略</p> <p>本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>沪深 300 指数×50%+上证国债指数×50%。</p>  |

|                 |   |                  |
|-----------------|---|------------------|
| 风险收益特征          | 本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高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。 |                  |
| 基金管理人           | 国联安基金管理有限公司   |                  |
| 基金托管人           | 海通证券股份有限公司  |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 国联安通盈混合 A   | 国联安通盈混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 000664  | 002485           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,140,912.78 份  | 455,583,597.34 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日) |                |
|----------------|---|----------------|
|                | 国联安通盈混合 A                               | 国联安通盈混合 C      |
| 1.本期已实现收益      | 2,518,276.04                            | 2,076,759.41   |
| 2.本期利润         | 149,809.35                              | 2,026,688.21   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0089                                  | 0.0099         |
| 4.期末基金资产净值     | 4,078,575.41                            | 573,176,284.11 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2985                                  | 1.2581         |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、国联安通盈混合 A:

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差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    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.53%      | 0.22%         | 0.57%          | 0.48%                 | 0.96% | -0.26% |

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。

##### 2、国联安通盈混合 C:

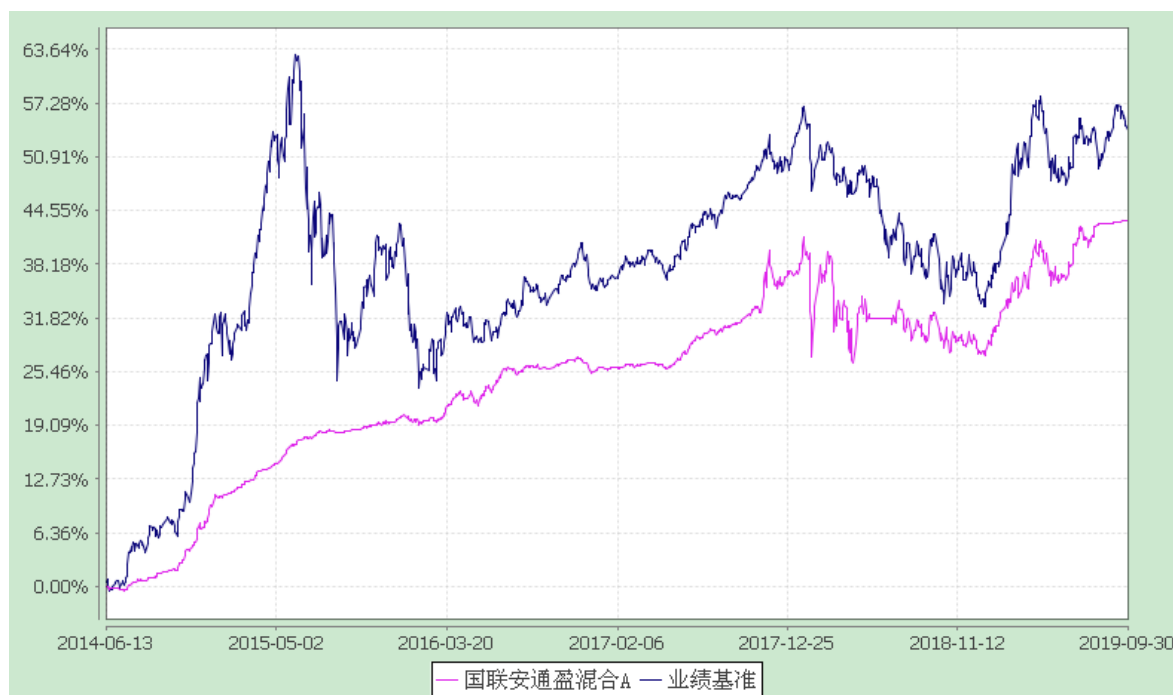
| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.70%      | 0.20%         | 0.57%          | 0.48%                 | 0.13% | -0.28% |

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

国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 30 日)

##### 1. 国联安通盈混合 A:



注：1、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金于 2016 年 3 月 2 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并对本基金基金合同作相应修改，原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为国联安通盈灵活配置混合 A 类份额；

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×50%+上证国债指数×50%；

3、本基金基金合同于 2014 年 6 月 13 日生效。本基金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；

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。

## 2. 国联安通盈混合 C:



注：1、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金于 2016 年 3 月 2 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并对本基金基金合同作相应修改，原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为国联安通盈灵活配置混合 A 类份额；

2、C 类收费模式的对应基金代码为 002485，自 2016 年 3 月 3 日起开始确认申购份额，因此，国联安通盈灵活配置混合 C 类份额的业绩表现自 2016 年 3 月 3 日开始计算，其业绩比较基准收益率也自 2016 年 3 月 3 日开始计算；

3、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×50%+上证国债指数×50%；

4、本基金基金合同于 2014 年 6 月 13 日生效。本基金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；

5、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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期        | 离任日期 |        |    |
|    |    |             |      |        |    |



|    |   |            |   |                 |   |
|----|---|------------|---|-----------------|---|
| 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 | 2016-10-21 | - | 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。 |
|----|---|------------|---|-----------------|---|

|    |  |            |   |                 |   |
|----|--|------------|---|-----------------|---|
|    | 基金基金经理、国联安添利增长债券型证券投资基金基金经理。   |            |   |                 |   |
| 王欢 | 本基金经理、兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2017-12-29 | - | 11 年（自 2008 年起） | 王欢先生，硕士研究生。2008 年 7 月至 2014 年 5 月在华宝兴业基金管理有限公司担任研究员。2014 年 6 月加入国联安基金管理有限公司，历任研究员、专户投资经理。2017 年 12 月起担任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金、国联安信心增长债券型证券投资基金和国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

|  |    |  |  |  |  |
|--|----|--|--|--|--|
|  | 理。 |  |  |  |  |
|--|----|--|--|--|--|

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》、《国联安通盈灵活配置混合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 公平交易专项说明

##### 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，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 9 月制造业 PMI 为 49.8%，比上月回升 0.3 个百分点，虽然仍处于荣枯线以下，但整体景气较上月有所改善。从 8 月以来逆周期调节发力带来的边际变化来看，景气即将见底，制造业 PMI 站上荣枯线的预期时点从 11 月提前至 10 月。9 月中国经济呈现出较明显的边际改善，内需加速扩张、就业改善，但受汇率波动、劳动力和原材料成本上涨影响，成本压力增大，对企业

信心造成压制。不过，受前期去产能、去库存影响，企业产能约束凸显，积压工作明显增加，有助于企业投资的修复；中国经济经过前期下行之后，逐渐具备企稳基础。目前经济仍面临一些不确定性，年内通胀压力有限。中美债市利差较大，国内货币政策总体维持偏松格局，降准降息仍有空间。本基金对债市长期看好。

本基金在三季度采取稳健的投资风格。固定收益部分：主要投资标的为优质债券资产，维持久期在中低期限。组合权益部分：把握权益类资产的绝对收益型投资机会，努力为投资人创造较理想的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安通盈混合 A 的份额净值增长率为 1.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%；国联安通盈混合 C 的份额净值增长率为 0.70%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目           | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资         | -              | -            |
|    | 其中：股票        | -              | -            |
| 2  | 基金投资         | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资       | 598,786,740.50 | 93.79        |
|    | 其中：债券        | 598,786,740.50 | 93.79        |
|    | 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 | 10,050,908.97  | 1.57   |
| 8 | 其他各项资产       | 29,590,627.77  | 4.63   |
| 9 | 合计           | 638,428,277.24 | 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。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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。

### 5.2.2 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投资的股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 24,173,203.30  | 4.19         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 36,787,537.20  | 6.37         |
|    | 其中：政策性金融债 | 36,787,537.20  | 6.37         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 100,021,000.00 | 17.33        |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | 437,805,000.00 | 75.84        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 598,786,740.50 | 103.73       |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 数量（张）     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 111904047 | 19 中国银行 CD047     | 1,000,000 | 97,050,000.00 | 16.81        |
| 2  | 111915032 | 19 民生银行 CD032     | 1,000,000 | 97,030,000.00 | 16.81        |
| 3  | 111803212 | 18 农业银行 CD212     | 1,000,000 | 96,760,000.00 | 16.76        |
| 4  | 111922008 | 19 邮储银行 CD008     | 500,000   | 49,300,000.00 | 8.54         |
| 5  | 111981072 | 19 广州农村商业银行 CD077 | 500,000   | 49,300,000.00 | 8.54         |

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 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。

**5.10.2 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。

**5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

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

19 民生银行 CD032（111915032）的发行主体中国民生银行股份有限公司，因七项违法违规事项于 2018 年 12 月 7 日被中国银行保险监督管理委员会处以 3160 万元罚款。广州分行因违反支付结算管理规定被警告，于 2019 年 1 月 23 日被没收违法所得 2,787,141.24 元，并处罚款 2,787,141.24 元，合计罚没 5,574,282.48 元。

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

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 22,366.27     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 8,568,231.53  |
| 5  | 应收申购款   | 21,000,029.97 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 29,590,627.77 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票，不存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 国联安通盈混合A      | 国联安通盈混合C       |
|--------------|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 43,166,885.28 | 2,619,361.46   |
| 报告期基金总申购份额   | 178,278.32    | 605,007,300.45 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 40,204,250.82 | 152,043,064.57 |
| 报告期基金拆分变动份额  | -             | -              |
| 本报告期末基金份额总额  | 3,140,912.78  | 455,583,597.34 |

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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |                |               | 报告期末持有基金情况     |        |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|----------------|---------------|----------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间  | 期初份额          | 申购份额           | 赎回份额          | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2019年08月29日至2019年09月30日 | 0.00          | 288,271,885.91 | 0.00          | 288,271,885.91 | 62.84% |
|       | 2              | 2019年07月29日至2019年08月28日 | 0.00          | 38,025,705.38  | 0.00          | 38,025,705.38  | 8.29%  |
|       | 3              | 2019年08月07日至2019年08月28日 | 0.00          | 34,159,919.07  | 0.00          | 34,159,919.07  | 7.45%  |
|       | 4              | 2019年07月01日至2019年07月28日 | 15,940,538.82 | 0.00           | 15,940,538.82 | 0.00           | 0.00%  |
|       | 5              | 2019年07月01日             | 23,911        | 0.00           | 23,911,2      | 0.00           | 0.00%  |



|   |   |  |              |                        |                    |      |       |
|---|---|--|--------------|------------------------|--------------------|------|-------|
|   |   | 日至 2019 年 07 月<br>29 日                   | , 206.7<br>6 |                        | 06.76              |      |       |
|   | 6 | 2019 年 08 月 29<br>日至 2019 年 09 月<br>17 日 | 0.00         | 151,72<br>2,045.<br>21 | 151,722,<br>045.21 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险  |   |  |              |                        |                    |      |       |
| <p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险<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> |   |  |              |                        |                    |      |       |

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安通盈灵活配置混合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

### 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### 9.3 查阅方式

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

国联安基金管理有限公司

二〇一九年十月二十三日