国联安信心增长债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国联安信心增长债券	
基金主代码	253060	
交易代码	253060	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年7月29日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,684,538.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
下属分级基金的交易代码	253060	253061
报告期末下属分级基金的份额总额	52,929,126.96份	1,755,411.81份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动地投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上,主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合,以期获得最大化的债券收益;并通过适当参与新股发行申购及增发新股申购等较低风险投资品种,力争获取超额收益。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	褚怡之	李修滨
	联系电话	021-38992807	4006800000
	电子邮箱	customer.service@gcpicfunds.com	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95558
传真		021-50151582	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.gcpicfunds.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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)	
	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
本期已实现收益	-679,939.08	-20,865.17
本期利润	316,792.22	17,057.50
加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0077
本期基金份额净值增长率	0.56%	0.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
期末可供分配基金份额利润	-0.0622	-0.0694
期末基金资产净值	55,048,098.03	1,810,803.23
期末基金份额净值	1.0400	1.0316

注:1.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,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。

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.本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2014年7月29日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安信心增长债券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	-1.69%	0.28%	0.67%	0.06%	-2.36%	0.22%
过去三个月	-0.88%	0.23%	2.16%	0.10%	-3.04%	0.13%
过去六个月	0.56%	0.20%	4.35%	0.08%	-3.79%	0.12%
过去一年	1.36%	0.14%	4.21%	0.07%	-2.85%	0.07%
过去三年	-1.93%	0.18%	11.80%	0.08%	-13.73%	0.10%
自基金转型起至今	13.52%	0.27%	21.26%	0.09%	-7.74%	0.18%

注:1.本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2014年7月29日;

2.本基金的业绩比较基准为中证全债指数;

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。

国联安信心增长债券B

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	-1.71%	0.28%	0.67%	0.06%	-2.38%	0.22%
过去三个月	-0.93%	0.23%	2.16%	0.10%	-3.09%	0.13%
过去六个月	0.43%	0.20%	4.35%	0.08%	-3.92%	0.12%
过去一年	1.14%	0.14%	4.21%	0.07%	-3.07%	0.07%
过去三年	-2.80%	0.18%	11.80%	0.08%	-14.60%	0.10%
自基金转型起至今	12.16%	0.27%	21.26%	0.09%	-9.10%	0.18%

注:1.本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2014年7月29日;

2.本基金的业绩比较基准为中证全债指数;

3.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

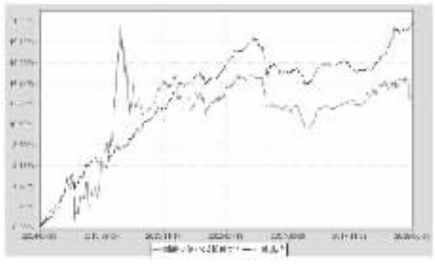
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安信心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

(2014年7月29日至2018年6月30日)

国联安信心增长债券A



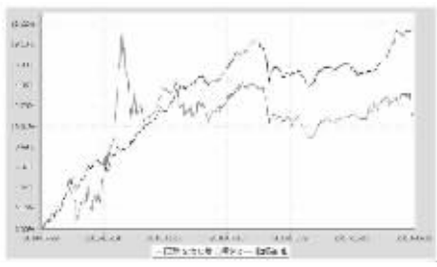
注:1.本基金的业绩比较基准为中证全债指数;

2.本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2014年7月29日;

3.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。

国联安信心增长债券B



注:1.本基金的业绩比较基准为中证全债指数;

2.本基金由原国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2014年7月29日;

3.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。

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,由中国太平洋保险(集团)股份有限公司控股;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,公司共管理三十七只开放式基金。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队,借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验,结合本地投资研究与客户服务的成功实践,秉持"稳健、专业、卓越、信赖"的经营理念,力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超伟	本基金基金经理、兼任国联安睿祺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、国联安鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安锐意成长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、国联安远见成长混合型证券投资基金基金经理	2016-06-16	-	10年(自2008年起)	王超伟,硕士研究生。2008年7月至2011年8月在国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部任投资经理。2011年8月至2015年9月在国泰君安证券股份有限公司权益投资部任投资经理。2015年9月加入国联安基金管理有限公司,担任基金经理助理。2016年2月起担任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年6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。2017年1月起兼任国联安锐意成长混合型证券投资基金基金经理。2018年5月起兼任国联安远见成长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。
吕中凡	本基金基金经理、兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安双佳信用债券型证券投资基金(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、国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017-09-26	-	7年(自2011年起)	吕中凡,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一职。2009年3月至2011年3月在上海远东资信评估有限公司(原上海远东期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,历任信用研究信用分析员、债券组合助理、基金经理助理等职位。2015年5月起任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)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基金经理。2016年9月起兼任国联安鑫盈混合型证券投资基金基金经理。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基金经理。2016年12月起兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017年3月起至2018年6月兼任国联安鑫怡混合型证券投资基金基金经理。2017年9月起兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2018年3月起兼任国联安鑫福灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王欢	本基金基金经理、兼任国联安鑫享灵活配置型证券投资基金基金经理、国联安通盈灵活配置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。	2017-12-29	-	10年(自2008年起)	王欢,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29日起任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017年12月29日起任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年12月29日起任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2017年12月29日起任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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;

3.王超伟先生自2018年7月12日起不再担任本基金基金经理(2018年7月12日公告)。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《国联安信心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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年上半年,在持续审慎监管环境下,基建和制造业投资继续呈低迷态势,地产销售回落带动投资缓慢向下,因而总需求呈现放缓格局。流动性持续保持宽松状况,回购利率显著低于去年同期水平,流动性的宽松为2季度的债券尤其是利率债的较好表现创造了条件。

考虑到保持基金净值增长率的平稳性,本基金管理人继续配置了部分利率债,取得了一定的基础性收益。同时,本基金管理人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。

上半年宏观经济呈现下行压力,而中美贸易战的进展又超出预期,国内同时在持续去杠杆中,"稳增长"、"去杠杆"、"应对贸易战"多线目标使得整个上半年经济预期变得纷繁复杂,对应在股票市场上则是整体弱市,缺乏增量资金,场内资金博弈导致个股和板块波动都很大。

基于此,本基金在上半年总体采取了偏低的仓位操作,同时在行业配置方面更偏向于消费品和低估值品种。尽管如此,市场风险偏好下降的程度仍然超出预期,部分可选消费品并没有取得预期的表现,对净值有一定拖累。在经济大环境向下的情况,首先是降低预期收益率,尽量规避个股或者行业层面的地雷,其次才是追求个股弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安信心增长债券A的份额净值增长率为0.56%,同期业绩比较基准收益率为4.35%;国联安信心增长债券B的份额净值增长率为0.43%,同期业绩比较基准收益率为4.35%。

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,社会融资总量的增速下降仍是大概率事件,资金面仍将维持对债券市场相对友好的局面。因此本基金管理人将维持对债券市场相对乐观的态度,和相对积极的运作方式。

展望下半年股票市场,恐慌的人心,大幅波动的个股,短期几乎难以把握,但本基金管理人坚信很多股票从中长线看已经跌出价值了。贸易战带来的的影响是深远和长期的:1)可以理解为在大国崛起的外在制约下,民富和内需是持久战的坚实基础,同时中国市场处于逐步形成品牌化的过程中,本基金管理人仍然持续看好品牌消费;2)对于制造业的影响一分为二,技术进步的路径其实受到了一定制约,但是中国部分优势制造业未来并不惧怕贸易战博弈导致对对外开放的影响;3)波动的环境对于企业管理层是很大的考验,最终市场还是会认识到优秀的企业才能在同样颠簸的环境中走的更稳。宏观经济确实面临压力,但市场预期也已经很悲观了,从中长期看,中国经济在短期阵痛后会走向更健康的发展道路,也许今年正是布局优质公司的机会,最终走出来的公司会享受市场格局的红利。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对国联安信心增长债券型证券投资基金2018年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,国联安基金管理有限公司在国联安信心增长债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,国联安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的国联安信心增长债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国联安信心增长债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	3,845,670.64	7,708,510.73
结算备付金	146,777.35	34,678.88
存出保证金	8,236.30	31,232.38
交易性金融资产	53,245,742.30	48,856,952.30
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	53,245,742.30	48,856,952.30
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	1,612,006.95
应收利息	749,904.14	1,101,341.37
应收股利	-	-
应收申购款	700.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	57,997,030.73	62,344,722.61
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	3,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	33,129.58	34,546.21
应付托管费	9,465.61	9,870.32
应付销售服务费	494.60	619.26
应付交易费用	18,820.12	162.50
应交税费	927,452.04	926,764.42
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	148,767.52	300,000.00
负债合计	1,138,129.47	4,271,962.71
所有者权益:	-	-
实收基金	54,684,538.77	56,168,299.97
未分配利润	2,174,362.49	1,904,459.93
所有者权益合计	56,858,901.26	58,072,759.90
负债和所有者权益总计	57,997,030.73	62,344,722.61

注:报告截止日2018年6月30日,国联安信心增长债券A基金份额净值1.0400元,国联安信心增长债券B基金份额净值1.0316元。基金份额总额54,684,538.77份,其中国联安信心增长债券A基金份额52,929,126.96份,国联安信心增长债券B基金份额1,755,411.81份。

6.2 利润表

会计主体:国联安信心增长债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	807,306.01	-491,007.28
1.利息收入	994,363.29	11,845,542.03
其中:存款利息收入	24,937.89	189,892.84
债券利息收入	964,076.36	11,401,230.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,349.04	254,418.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,221,988.36	-25,890,916.37
其中:股票投资收益	-169,689.08	-8,639,236.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,098,019.28	-17,251,680.31
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	45,720.00	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,034,653.97	13,532,406.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	277.11	21,960.63
减:二、费用	473,456.29	3,117,658.04
1.管理人报酬	202,128.99	2,043,170.28
2.托管费	57,751.17	583,762.90
3.销售服务费	3,430.67	4,530.56
4.交易费用	40,187.45	264,492.07
5.利息支出	-	41,714.62
其中:卖出回购金融资产支出	-	41,714.62
6.税金及附加	1,311.91	-
7.其他费用	168,646.10	179,987.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	333,849.72	-3,608,665.32
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	333,849.72	-3,608,665.32

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安信心增长债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	56,168,299.97	1,904,459.93	58,072,759.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	333,849.72	333,849.72
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)	-1,483,761.20	-63,947.16	-1,547,708.36
其中:1.基金申购款	457,953.18	19,116.88	477,070.06
2.基金赎回款	-1,941,714.38	-83,064.04	-2,024,778.42
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)	54,684,538.77	2,174,362.49	56,858,901.26
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	1,002,133,200.63	55,471,848.99	1,057,605,049.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,608,665.32	-3,608,665.32
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)	-580,496,470.45	-16,060,182.00	-596,556,652.45
其中:1.基金申购款	103,217.10	2,474.33	105,691.43
2.基金赎回款	-580,599,687.55	-16,062,656.33	-596,662,343.88
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)	-	-25,044,271.29	-25,044,271.29
五、期末所有者权益(基金净值)	421,636,730.18	10,758,730.38	432,395,460.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安信心增长债券型证券投资基金(以下简称"本基金")由国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型而成。国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]945号文)批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年2月22日生效。2014年5月9日国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议并通过《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金转型议案》,2014年7月29日在中国证监会完成备案手续,《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效且《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金合同生效日基金规模为333,823,276.84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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》和《国联安信心增长债券型证券投资基金招募说明书》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、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下,本基金投资于债券资产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,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;投资于非固定收益类资产(不含现金)的比例不超过基金资产的20%。本基金的业绩比较基准为中证全债指数。

根据《国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金提高基金份额净值精度并修改基金合同及托管协议的公告》,自2017年7月24日起,本基金的基金份额净值精度由保留到小数点后第3位(0.001元)提高至保留到小数点后第4位(0.0001元)。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况,2018上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

(1)主要税项说明

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月8日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

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

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在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,已纳税额从管理人以后月份的增值税应税销售额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

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

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2018年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股权登记日为自2018年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

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

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

(2)应交税费

	2018年06月30日	2017年12月31日
应交增值税	618.94	0.00
应交城市维护建设税	42.98	0.00
应交教育费附加及地方教育费附加	30.70	0.00
债券利息收入所得税	926,764.42	926,764.42

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内,本基金管理人原控股股东国泰君安证券股份有限公司已将其所持有的公司51%股权转让给太平洋资产管理有限责任公司。截至2018年5月4日,本基金管理人已正式完成上海市工商局变更登记,变更其控股股东为太平洋资产管理有限责任公司。同时,本基金管理人新增关联方:中国太平洋保险(集团)股份有限公司,为本基金管理人的最终控制人。

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方无变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人
太平洋资产管理有限责任公司	基金管理人的股东(自2018年5月4日起)
国泰君安证券股份有限公司("国泰君安")	基金管理人的股东(截止至2018年5月3日)
安联集团	基金管理人的股东
中国太平洋保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控制人(自2018年5月4日起)

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均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。

如在报表附注6.4.7.1中所述,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,太平洋资产管理有限责任公司和中国太平洋保险(集团)股份有限公司属于本基金的关联方。本半年度报告所披露的与国泰君安证券股份有限公司之间的关联方交易均为发生在截至2018年5月3日止期间的交易,所披露的与太平洋资产管理有限责任公司、中国太平洋保险(集团)股份有限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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	5,581,335.00	22.07%	74,456,984.17	53.82%

注:"占当期股票成交总额的比例"中当期股票成交总额取1月1日至6月30日数据,下同。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|