国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金 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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金托管人交通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	国联安添鑫灵活配置混合	
基金主代码	001359	
交易代码	001359	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月2日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	27,149,800.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安添鑫灵活配置混合A	国联安添鑫灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001359	001654
报告期末下属分级基金的份额总额	25,166,046.86份	1,983,753.47份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司力争获得长期稳定的收益。
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×50%+上证国债指数×50%
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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	褚怡之	陆志俊
	联系电话	021-38992807	95559
	电子邮箱	customer.service@picfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216

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.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

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)	
	国联安添鑫灵活配置混合A	国联安添鑫灵活配置混合C
本期已实现收益	-1,057,840.31	-65,541.53
本期利润	-2,876,057.77	-259,807.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1062	-0.1128
本期基金份额净值增长率	-10.50%	-10.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	国联安添鑫灵活配置混合A	国联安添鑫灵活配置混合C
期末可供分配基金份额利润	-0.0245	-0.0520
期末基金资产净值	24,550,183.72	1,880,592.60
期末基金份额净值	0.9755	0.9480

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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、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。

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

国联安添鑫灵活配置混合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	-5.54%	0.82%	-3.65%	0.64%	-1.89%	0.18%
过去三个月	-11.77%	0.79%	-4.28%	0.57%	-7.49%	0.22%
过去六个月	-10.50%	0.96%	-5.15%	0.58%	-5.35%	0.38%
过去一年	-4.17%	0.81%	-0.34%	0.48%	-3.83%	0.33%
过去三年	0.34%	0.52%	-4.89%	0.74%	5.23%	-0.22%
自基金合同生效起至今	0.44%	0.51%	-10.29%	0.78%	10.73%	-0.27%

注:1、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金于2015年7月7日起增加收取销售服务费的C类基金份额和调低管理费率,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

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。

国联安添鑫灵活配置混合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	-5.58%	0.82%	-3.65%	0.64%	-1.93%	0.18%
过去三个月	-11.89%	0.79%	-4.28%	0.57%	-7.61%	0.22%
过去六个月	-10.71%	0.96%	-5.15%	0.58%	-5.56%	0.38%
过去一年	-4.72%	0.81%	-0.34%	0.48%	-4.38%	0.33%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自确认C类份额起至今	-0.04%	0.52%	2.30%	0.68%	-2.34%	-0.16%

注:1、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金于2015年7月7日起增加收取销售服务费的C类基金份额和调低管理费率,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

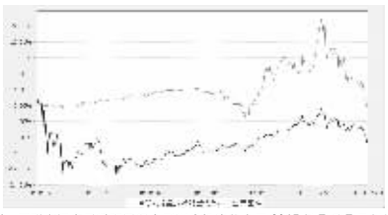
2、C类收费模式的对应基金代码为001654,自2015年8月3日起开始确认申购份额,因此,国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金C类份额的业绩表现自2015年8月3日开始计算;

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

国联安添鑫灵活配置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
(2015年6月2日至2018年6月30日)

国联安添鑫灵活配置混合A



注:1、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金于2015年7月7日起增加收取销售服务费的C类基金份额和调低管理费率,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金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2015年6月2日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,2015年12月1日建仓期结束当日除现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例低于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定。本基金已于2015年12月3日及时调整完毕;

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。

国联安添鑫灵活配置混合C

注:1、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金于2015年7月7日起增加收取销售服务费的C类基金份额和调低管理费率,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

2、C类收费模式的对应基金代码为001654,自2015年8月3日起开始确认申购份额,因此,国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金C类份额的业绩表现自2015年8月3日开始计算,其业绩比较基准收益率也自2015年8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2015年6月2日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,2015年12月1日建仓期结束当日除现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例低于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定。本基金已于2015年12月3日及时调整完毕;

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		
薛琳	本基金基金经理、兼任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、国联安鑫智定期开放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、国联安鑫乾混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫隆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。	2016-11-04	-	12年(自2006年起)	薛琳女士,硕士学位,2006年3月至2006年12月在上海红筒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,自2010年6月起,加盟国联安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理职务,2012年7月至2016年1月担任国联安货币市场证券投资基金基金经理,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基金经理,2013年6月起兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理助理,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基金经理,2016年3月至2018年5月任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理,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基金经理,2016年12月起兼任国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金经理,2017年3月起兼任国联安鑫汇混合型证券投资基金基金经理,2017年3月起兼任国联安鑫乾混合型证券投资基金基金经理,2017年3月起兼任国联安鑫发混合型证券投资基金基金经理,2017年3月起兼任国联安鑫隆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益债券型证券投资基金基金经理。
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理、国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理	2018-03-12	-	16年(自2002年起)	黄欣先生,伦敦经济学院会计金融专业硕士,2003年10月起加入国联安基金管理有限公司,先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理,国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理,2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理,2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2016年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理,2018年3月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
吕中凡	本基金基金经理助理	2015-11-03	-	7年(自2011年起)	-
林录	本基金基金经理助理、兼任研究部行业研究员	2017-04-18	-	7年(自2011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》、《国联安添鑫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 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

2018年上半年,宏观经济形势多变,金融去杠杆继续进行中,中美之间的贸易战不断升级且超出市场预期。股市先扬后抑,整体呈现下跌状态,大盘蓝筹股表现相对较好。从整个上半年来看,2018年沪深300指数下跌12.9%,中证100指数下跌11.77%,而中小板综指下跌16.30%。分板块来看,医药、服饰、家电等板块表现较好,传媒、机械等行业表现较差。本基金上半年主要投资于金融、煤炭、食品饮料等行业里业绩稳定增长、估值合理的股票,因持仓股受中兴通讯制裁事件而被影响导致大幅下跌,拖累净值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安添鑫灵活配置混合A的份额净值增长率为-10.50%,同期业绩比较基准收益率为-5.15%;国联安添鑫灵活配置混合C的份额净值增长率为-10.71%,同期业绩比较基准收益率为-5.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年,美国经济呈现出较强的复苏态势,但中美之间的贸易摩擦问题给全球的宏观经济带来较大的不确定性。经过上半年的回调,整个A股的估值水平已经下降,释放了较大的风险。随着经济复苏,本基金管理人预计下半年周期类、成长类股票,应该是较好的投资选择。

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,本基金本报告期未进行利润分配,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

本报告期内本基金资产净值低于5000万元。

基金管理人拟开展持续营销活动,提升基金规模。

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

报告期内,基金托管人在国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,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、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

报告期内,国联安基金管理有限公司在国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

报告期内,由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金

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	12,042,940.53	5,887,433.32
结算备付金	71,046.01	80,314.11
存出保证金	14,440.08	33,327.12
交易性金融资产	17,697,600.72	29,792,973.73
其中:股票投资	17,697,600.72	27,158,781.73
基金投资	-	-
债券投资	-	2,634,192.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,017.20	66,323.89
应收股利	-	-
应收申购款	490.28	3,423.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	29,829,534.82	35,863,796.00
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	3,063,140.39	-
应付赎回款	64,300.34	345,095.69
应付管理人报酬	20,864.52	27,630.11
应付托管费	5,795.69	7,675.06
应付销售服务费	819.96	1,185.56
应付交易费用	62,684.50	72,398.92
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,153.10	365,000.64
负债合计	3,398,758.50	818,985.98
所有者权益:	-	-
实收基金	27,149,800.33	32,216,175.82
未分配利润	-719,024.01	2,828,634.20
所有者权益合计	26,430,776.32	35,044,810.02
负债和所有者权益总计	29,829,534.82	35,863,796.00

注:报告截止日2018年6月30日,国联安添鑫灵活配置混合A基金份额净值0.9755元;国联安添鑫灵活配置混合C基金份额净值0.9480元。基金份额总额27,149,800.33份,其中国联安添鑫灵活配置混合A基金份额25,166,046.86份,国联安添鑫灵活配置混合C基金份额1,983,753.47份。

6.2 利润表

会计主体:国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金

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	-2,579,846.00	-532,723.62
1.利息收入	74,851.19	3,759,614.42
其中:存款利息收入	48,151.03	256,568.26
债券利息收入	26,700.16	3,068,719.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	434,326.92
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-661,171.58	-3,478,204.42
其中:股票投资收益	-797,653.09	13,372,999.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,036.00	-18,604,091.68
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	133,445.51	1,752,887.49
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-2,012,483.40	-1,378,309.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	18,957.79	564,176.02
减:二、费用	556,019.24	2,630,927.29
1.管理人报酬	144,016.53	1,180,307.57
2.托管费	40,004.55	327,863.20
3.销售服务费	6,159.56	379,534.04
4.交易费用	165,245.41	520,273.60
5.利息支出	-	2,549.26
其中:卖出回购金融资产支出	-	2,549.26
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	200,593.19	220,399.62
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-3,135,865.24	-3,163,650.91
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-3,135,865.24	-3,163,650.91

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金

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)	32,216,175.82	2,828,634.20	35,044,810.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,135,865.24	-3,135,865.24
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)	-5,066,375.49	-411,792.97	-5,478,168.46
其中:1.基金申购款	4,606,077.25	738,028.07	5,344,105.32
2.基金赎回款	-9,672,452.74	-1,149,821.04	-10,822,273.78
四、本期向基金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)	27,149,800.33	-719,024.01	26,430,776.32
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)	765,355,847.38	-5,325,801.80	760,030,045.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-3,163,650.91	-3,163,650.91
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)	-640,417,557.31	10,618,007.58	-629,799,549.73
其中:1.基金申购款	194,478,839.52	-2,047,067.62	192,431,771.90
2.基金赎回款	-834,896,396.83	12,665,075.20	-822,231,321.63
四、本期向基金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)	124,938,290.07	2,128,554.87	127,066,844.94

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:仲晓晓

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2015]869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《国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年6月2日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为406,228,598.96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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国联安添鑫灵活配置混合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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票投资占基金资产的0%-95%;权证投资占基金资产净值的0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%;资产支持证券占基金净值的0%-20%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×50%+上证国债指数×50%。

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年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

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18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纳税额中抵减。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上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013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2013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。

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
交通银行股份有限公司(交通银行)	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	71,730,172.87	67.11%	354,988,132.93	100.00%

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	
	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	-	-	244,334,299.07	100.00%

6.4.8.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	-	-	1,857,800,000.00