国联安睿智定期开放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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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。

根据《关于国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金于2018年7月26日终止运作,且已于2018年7月27日正式进入清算程序。

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	国联安睿智定开混合
基金主代码	003541
交易代码	003541
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	202,324,351.70份
基金合同存续期	不定期

注:本基金以定期开放方式运作,即以开放期和封闭期相结合的方式运作。本基金的封闭期为自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)18个月的期间。本基金的第一个封闭期为自《基金合同》生效之日起18个月。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)的18个月,以此类推。如该对应日不存在对应日期的,则顺延至下一日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险与保持资产流动性的基础上,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)资产配置策略 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。 (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 中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。 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、合理建债地评估、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,对无信用风险进行评估并作出及时反应。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。 本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良、估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。 (5)股指期货投资策略 在股指期货投资上,本基金以套期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。 (6)国债期货投资策略 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略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 7.11.2 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。 7.11.3 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。 7.12 投资组合报告附注 7.12.1 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。 7.12.2 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。 7.12.3 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	25,450.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,865.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,315.99

7.12.4 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。
7.12.5 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 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,365	148,222.97	50,012,500.00	24.72%	152,311,851.70	75.28%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
截止本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况
截止本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为0;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

单位:份

基金合同生效日(2016年12月29日)基金份额总额	202,324,351.70
本报告期期初基金份额总额	202,324,351.70
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	202,324,351.70

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
本报告期内无基金份额持有人大会决议。
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、2018年4月27日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更公告》,于业明先生担任公司董事长及法定代表人,庹启斌先生不再担任公司董事长及法定代表人。
2、2018年4月27日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司董事、独立董事变更公告》,于业明先生、杨一君先生、Jiachen Fu女士和Eugen Loeffler先生担任公司第五届董事会董事,公司总经理孟朝霞女士继续担任公司第五届董事会董事;贝多广先生、岳志明先生担任公司第五届董事会独立董事, 胡斌先生继续担任公司第五届董事会独立董事。庹启斌先生、汪卫杰先生不再担任本公司董事;程静萍女士不再担任本公司独立董事。
3、2018年3月30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》,刘轶先生不再担任公司督察长职务,由总经理孟朝霞女士代行督察长职务。
4、2018年4月28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》,满黎先生不再担任公司副总经理职务。
5、本报告期内, 本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期内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
本报告期内未发生基金投资策略的改变。
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
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稽查或处罚等情况
1.本报告期内,中国证券监督管理委员会上海监管局就现场检查中发现的问题下发了《关于对国联安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。对此,本基金管理人高度重视,对相关制度流程进行了全面梳理,针对性的制定了整改执行方案,逐条落实,彻底排查了业务中存在的风险,并就整改情况向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。
2、本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	-	-	-	-	-

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
报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。
10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		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
海通证券	172,850,207.36	100.00%	1,814,800,000.00	100.00%	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年6月30日	50,012,500.00	0.00	0.00	50,012,500.00	24.72%
产品特有风险							

(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。
(2)基金净值大幅波动的风险
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。
(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 影响投资者决策的其他重要信息
本基金管理人于2018年5月4日发布公告,经本基金管理人股东会第五十五次会议决议通过, 并经中国证券监督管理委员会批复核准(证监许可[2018]557号),本基金管理人原股东国泰君安证券股份有限公司将所持51%股权转让给太平洋资产管理有限责任公司。上述事项涉及的相关工商变更登记等事宜,已按规定办理完毕。变更后,本基金管理人的股东为太平洋资产管理有限责任公司和安联集团。

国联安基金管理有限公司
二〇一八年八月二十四日

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,国联安鑫益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。	2016-12-29	-	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。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。
吕中凡	本基金基金经理助理	2016-12-29	-	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》、《国联安睿智定期开放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
中国6月CPI同比上涨1.9%,前值1.8%,预期1.9%;6月PPI同比增4.7%,增速创年内新高,前值4.1%,预期4.5%;6月新增社融总量1.18万亿,同比少增约6000亿,社会融资规模存量增速继续大降至9.8%。其中6月虽然对实体发放贷款增加1.67万亿,同比多增2300亿,但表外非标融资继续大幅萎缩,委托、信托贷款、未贴现银行承兑汇票合计减少了6900多亿,同比少增9100亿。大部分表外融资需求难以向表内转移,是拖累社融的主因。上半年由于资金情况宽松,债券收益率普遍下降,尤其是中长短利率债收益率曲线向下走势更为陡峭。
本基金管理人在维持低风险基础配置的基础上积极参与债券投资,同时更加注重固定收益管理部分的流动性管理和信用风险管理,争取为基金份额持有人创造符合其投资预期目标值的合理投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期内,本基金的份额净值增长率为1.46%,同期业绩比较基准收益率为-0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度GDP同比增长6.7%,前值6.8%,6月规模以上工业增加值同比增长6.0%,前值6.8%,1-6月固定资产投资同比增长6.0%,前值6.1%,6月社会消费品零售总额名义同比增长9.0%,前值8.5%。基建投资成为主要拖累,地产投资小幅回落。随着需求端放缓逐渐传导至供给端,下半年经济下行压力将逐渐增大。目前等待中央经济工作会议是否会进一步发布政策,本基金管理人预计整个下半年资金面仍为宽松状态,继续看好中等久期利率债和高等级信用债。财政宽松预期会缩窄信用债评级估值上的利差,但配置中低评级债仍需谨慎。

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

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,平安银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在国联安睿智定期开放混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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
本报告期内,本托管人根据《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,对本基金的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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
本报告期内,由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、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:国联安睿智定期开放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	208,905,294.15	2,759,982.29
结算备付金	2,331,818.19	-
存出保证金	25,450.15	8,140.93
交易性金融资产	-	175,525,451.73
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	-	175,525,451.73
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	-	20,000,150.00
应收证券清算款	-	6,009,665.75
应收利息	41,865.84	4,114,461.90
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	211,304,428.33	208,417,852.60

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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	121,377.88	123,624.27
应付托管费	26,009.54	26,490.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	200.00	150.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	151,247.22	305,000.00
负债合计	298,834.64	455,265.23
所有者权益:	-	-
实收基金	202,324,351.70	202,324,351.70
未分配利润	8,681,241.99	5,638,235.67
所有者权益合计	211,005,593.69	207,962,587.37
负债和所有者权益总计	211,304,428.33	208,417,852.60

注:报告截止2018年6月30日,基金份额净值1.0429元,基金份额总额202,324,351.70份。

6.2 利润表

会计主体:国联安睿智定期开放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	4,105,719.19	3,966,296.64
1.利息收入	4,002,405.14	4,043,953.60
其中:存款利息收入	122,771.28	3,353,451.21
债券利息收入	2,005,928.44	584,841.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,873,705.42	105,660.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-745,300.79	87,811.68
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-745,300.79	87,811.68
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	848,614.84	-165,468.64
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	1,062,712.87	1,070,549.77
1. 管理人报酬	728,536.24	707,006.10
2. 托管费	156,114.97	151,501.26
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,645.04	1,038.11
5. 利息支出	-	64,969.06
其中:卖出回购金融资产支出	-	64,969.06
6. 税金及附加	6,569.40	-
7. 其他费用	169,847.22	146,035.24
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	3,043,006.32	2,895,746.87
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	3,043,006.32	2,895,746.87

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安睿智定期开放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)	202,324,351.70	5,638,235.67	207,962,587.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,043,006.32	3,043,006.32
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	202,324,351.70	8,681,241.99	211,005,593.69
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)	202,324,351.70	47,752.94	202,372,104.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,895,746.87	2,895,746.87
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	202,324,351.70	2,943,499.81	205,267,851.51

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
国联安睿智定期开放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”)《关于准予国联安睿智定期开放混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2285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《国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年12月29日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为202,324,351.70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,基金托管人为平安银行股份有限公司。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《国联安睿智定期开放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、企业债、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、同业存单、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%-25%;权证投资占基金资产净值的0%-3%;在开放期,每个交易日日终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%。在封闭期,本基金不受前述5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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%。
根据《关于国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金于2018年7月26日终止运作,且已于2018年7月27日正式进入清算程序。
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
如本财务报表附注6.4.1所述,根据《关于国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》, 本基金于2018年7月26日终止运作, 且已于2018年7月27日正式进入清算程序。因此,本基金财务报表以非持续经营为基础编制。本基金已将账面价值高于预计可收回金额 (该金额未预计未来交易的手续费及相关税费,以下简称“预计可收回金额”)的资产调整至预计可收回金额,并按预计结算金额计量负债。
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付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