国联安货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安货币	
基金主代码	253050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月26日	
报告期末基金份额总额	6,082,112,561.50份	
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式管理,定性分析与量化分析相结合,力争为投资者提供稳定的收益。	
投资策略	本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测,在此基础之上,确定组合久期和类别资产配置比例,把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择,具体包括以下策略: 1、利率预期策略 2、收益率曲线策略 3、类属配置策略 4、现金流管理策略 5、套利策略 6、个券选择策略	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国联安货币A	国联安货币B
下属分级基金的交易代码	253050	253051
报告期末下属分级基金的份额总额	110,859,690.72份	5,971,252,870.78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(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	国联安货币A	国联安货币B
1.本期已实现收益	918,810.24	41,601,126.37
2.本期利润	918,810.24	41,601,126.37
3.期末基金资产净值	110,859,690.72	5,971,252,870.78

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、国联安货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.6828%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.3425%	0.0027%

注:1、本基金收益分配按日结转份额;

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。

2、国联安货币B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.7443%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.4040%	0.0027%

注:1、本基金收益分配按日结转份额;

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。

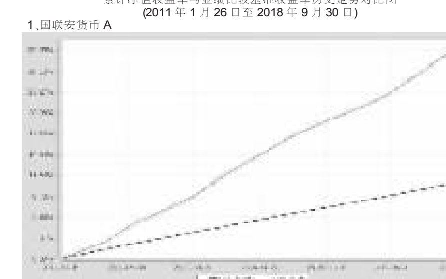
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年1月26日至2018年9月30日)

1、国联安货币A

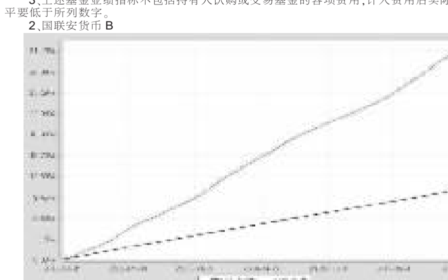


注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2011年1月26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;

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。

2、国联安货币B



注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2011年1月26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;

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		
欧阳健	本基金基金经理、固定收益部总经理	2018-06-22	-	16年(自2002年起)	欧阳健先生,硕士研究生。2002年9月至2016年2月担任广发银行股份有限公司金融市场部利率及衍生产品交易主管;2016年2月至2018年5月担任广发证券股份有限公司固定收益投资部部门执行董事;2018年5月加入国联安基金管理有限公司,担任固定收益部副总监,现任固定收益部总经理。2018年6月22日起任国联安货币市场证券投资基金的基金经理。

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。

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》《国联安货币市场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

基本面情况:2018年3季度国内经济基本面延续偏弱的格局,8月固定资产累计完成额同比新增5.3%,基本面对货币政策有宽松需求,但在贸易战背景下,人民币贬值压力较大,而且美联储如期在9月加息,制约内部政策的宽松能力。展望后市,虽然目前通胀有一定抬头,8月CPI同比2.3%,但贸易战引起的外部通缩和房地产严控的内部通缩将明显制约通胀对市场的影响。在汇率偏弱的情况下,市场短端利率暂时无法继续下行,DR007继续围绕2.6%水平波动的概率较高。未来整个收益率曲线扁平化的概率较高。

货币市场运行情况:资金面整体呈现偏宽松状态,融资利率在8月曾一度跌破1.5%。3个月AAA国有股份制银行存单从季初开始一路下行,最低至2%,之后逐步回调至2.7%-2.8%的区间稳步运行,6个月AAA国有股份制银行存单在经历八月的调整后大致运行在3.2%-3.5%的区间。两者之间的期限点差较为明显。

具体操作方面:在季初判断货币政策已经转向宽松,在利率下行阶段本基金增配了长久期资产。在8月上旬融资市场极度宽松,DR007触及1.5%阶段,本基金判断央行会基于汇率的压力坚持货币走廊的下线,资产增配主要集中在短端,等待利率反弹,8月下旬至季末市场稳定阶段,保持对6个月资产的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安货币A的份额净值增长率为0.6828%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。本报告期内,国联安货币B的份额净值增长率为0.7443%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	固定收益投资	3,243,144,230.52	52.44
	其中:债券	3,243,144,230.52	52.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,929,251,048.13	31.19
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	996,496,417.19	16.11
4	其他资产	15,752,176.14	0.25
5	合计	6,184,643,871.98	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.55	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	99,999,730.00	1.64
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	61.22	1.64
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	0.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	21.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.43	1.64

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内,本货币市场基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	300,081,523.42	4.93
	其中:政策性金融债	300,081,523.42	4.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,151,006.98	1.48
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,852,911,700.12	46.91
8	其他	-	-
9	合计	3,243,144,230.52	53.32
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111810323	18兴业银行CD323	3,000,000	299,938,133.46	4.93
2	111786794	17杭州银行CD210	2,300,000	229,649,672.92	3.78
3	111816233	18上海银行CD233	2,000,000	199,627,591.92	3.28
4	111809276	18浦发银行CD276	2,000,000	196,955,199.32	3.24
5	160402	16农发02	1,000,000	99,965,998.29	1.64
6	111815337	18民生银行CD337	1,000,000	99,901,723.03	1.64
7	111881338	18盛京银行CD296	1,000,000	99,806,431.56	1.64
8	111891056	18重庆农村商行CD019	1,000,000	99,790,076.44	1.64
9	111819317	18恒丰银行CD317	1,000,000	99,774,384.20	1.64
10	111815372	18民生银行CD372	1,000,000	99,764,513.45	1.64

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.14%
报告期内偏离度的最低值	0.03%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.07%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.9.2 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兴业银行、浦发银行、恒丰银行和民生银行外,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。

18兴业银行CD323(111810323)的发行主体兴业银行股份有限公司因十二项违法违规事项于2018年4月19日被中国银行保险监督管理委员会处以5870万元罚款。

18浦发银行CD276(111809276)的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司由于十九项违法违规事项于2018年2月12日被中国银监会罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元;此外,成都分行由于九项违法违规事项于2018年1月18日被中国银行业监督管理委员会四川监管局罚款人民币46175万元。

18民生银行CD337(111815337)和18民生银行CD372(111815372)的发行主体中国民生银行股份有限公司厦门分行由于违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定于2018年3月14日被中国人民银行给予警告,没收违法所得48,418,193.27元,并处罚款114,639,752.47元,合计处罚金额163,057,945.74元。

18恒丰银行CD317(111819317)的发行主体恒丰银行股份有限公司因十七项违法违规事项于2017年12月29日被中国银监会没收违法所得7566.106815万元,并处1倍罚款7566.106815万元,对其他违规行为罚款1560万元,罚没合计16692.21363万元。

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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,772,981.14
4	应收申购款	979,195.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,752,176.14

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国联安货币A	国联安货币B
本报告期期初基金份额总额	229,109,834.27	5,139,255,561.97
报告期基金总申购份额	43,257,688.72	8,377,004,637.45
报告期基金总赎回份额	161,507,832.27	7,545,007,328.64
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	110,859,690.72	5,971,252,870.78

注:总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额;总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	2018年8月27日至2018年9月26日	-	1,207,438,202.24	700,000,000.00	507,438,202.24	8.34%

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。

§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货币市场证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》

3、《国联安货币市场证券投资基金招募说明书》

4、《国联安货币市场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

国联安基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

国联安科技动力股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安科技动力股票
基金主代码	001956
交易代码	001956
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月26日
报告期末基金份额总额	94,515,343.39份
投资目标	精选以科学技术为动力、具有较高成长性及盈利质量的行业及个股,在严格控制投资风险的条件下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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、资产支持证券、股指期货、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)。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于高预期风险、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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-15,249,150.82
2.本期利润	-15,750,941.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1600
4.期末基金资产净值	72,564,457.98
5.期末基金份额净值	0.7678

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-16.82%	1.97%	-1.38%	1.09%	-15.44%	0.88%

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

国联安科技动力股票型证券投资基金

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1月26日至2018年9月30日)

注:1、本基金业绩比较基准为:沪深300指数*80%+上证国债指数*20%;

2、本基金基金合同于2016年1月26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;

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		
潘明	本基金基金经理、兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理。	2016-01-26	-	9年(自2009年起)	潘明先生,硕士研究生。1996年6月至1998年6月在计算机科学公司担任咨询师;1998年8月至2005年5月在摩托罗拉公司担任高级行政工程师;2003年1月至2003年12月在扎克斯投资管理公司担任投资分析师;2004年4月至2005年5月在短剑投资公司担任执行董事;2005年5月至2009年7月在指导资本公司担任基金经理兼大宗商品研究总监;2009年8月至2010年3月在海通证券股份有限公司担任投资经理;2010年1月至2013年1月在GCS母基金公司、GCS有限公司、GCS有限责任合伙公司担任独立董事;2010年3月至2012年10月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理助理;2012年10月至2013年12月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理。2013年12月起加入国联安基金管理有限公司,担任基金经理助理。2014年2月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金的基金经理。2015年4月至2018年7月兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金的基金经理。2015年4月至2017年2月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金的基金经理。

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。

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》《国联安科技动力股票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

2018年3季度经济数据显示经济增速依然放缓,尤其是下游民营经济,内需相对乏力,出口未来不确定性比较高。今年市场下跌幅度已经不小,投资者没有忽略宏观数据的疲软,股市震荡向下。3季度TMT行业整体表现弱于大盘指数,其中通信和计算机两大板块表现相对较好,而传媒和电子行业表现较弱。通信行业的表现是由于中兴通讯事件的驱动,5G相关的光模块个股涨幅靓丽,但以出口和数据中心为导向的光模块企业跌幅较大。计算机行业的表现由教育信息化、酒店信息化和医院信息化的各个龙头驱动。传媒和电子行业表现被过去几年转型迷茫的企业、电视剧制作、PPP和安防相关等个股拖累。

基于对贸易战的影响和下半年行业细分景气度高低的判断,本基金在3季度增加了对与出口关系不大的计算机行业的配置,适度增配了有望受益于新型基建投资的5G通讯主题,同时降低了景气度不旺造成估值下移的电子行业的配置。虽然市场低迷,但TMT行业中具备长期成长空间和潜力的优质企业的性价比越来越高。

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-16.82%,同期业绩比较基准收益率为-1.38%。

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	64,699,258.44	87.62
	其中:股票	64,699,258.44	87.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	8,704,012.78	11.79
8	其他各项资产	439,611.41	0.60
9	合计	73,842,882.63	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,570,822.70	54.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,238,080.00	4.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,929,200.74	26.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,961,155.00	4.08
S	综合	-	-
	合计	64,699,258.44	89.16

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 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。

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	106,796	4,524,946.52	6.24
2	600845	宝信软件	183,000	4,485,330.00	6.18
3	000977	浪潮信息	184,200	4,435,536.00	6.11
4	300450	先导智能	166,300	4,370,364.00	6.02
5	600487	亨通光电	179,752	4,294,275.28	5.92
6	300308	中际旭创	98,653	4,271,674.90	5.89
7	002153	石基信息	122,300	4,128,848.00	5.69
8	002841	视源股份	60,340	3,632,468.00	5.01
9	002912	中新赛克	35,140	3,277,156.40	4.52
10	300413	芒果超媒	96,000	3,238,080.00	4.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期未投资股指期货。若本基金投资股指期货,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。

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

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	39,065.25
2	应收证券清算款	72,219.86
3	应收股利	-
4	应收利息	1,797.94
5	应收申购款	326,528.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	439,611.41

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

本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	90,287,749.57
报告期基金总申购份额	47,317,193.86
减:报告期基金总赎回份额	43,089,600.04
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	94,515,343.39

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安科技动力股票型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安科技动力股票型证券投资基金基金合同》

3、《国联安科技动力股票型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安科技动力股票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

8.2 存放地点

中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

8.3 查阅方式

网址:www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:二〇一八年十月二十五日

§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2018年10月24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2018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	49,852,997.31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	(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 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。本基金将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。 (5)股指期货投资策略 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。 (6)权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证的投资。 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; 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; 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。 (7)资产支持证券等品种投资策略 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。	
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。	
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	45,539,047.70份	4,313,949.61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(2018年7月1日-2018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	544,910.70	48,150.18
2.本期利润	287,888.75	19,285.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0030
4.期末基金资产净值	57,425,295.81	5,334,982.37
5.期末基金份额净值	1.2610	1.2367

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①	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
过去三个月	0.50%	0.42%	-0.45%	0.68%	0.95%	-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①	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
过去三个月	0.37%	0.42%	-0.45%	0.68%	0.82%	-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。

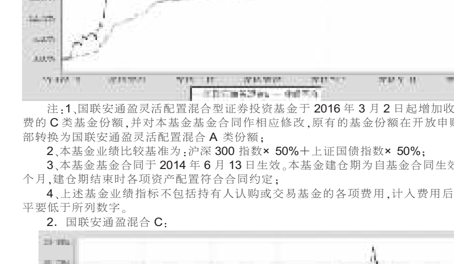
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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2018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、国联安睿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、国联安睿利定期开放混合型证券投资基金。	2016-10-21	-	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。2010年6月加入国联安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、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、国联安鑫乾混合型证券投资基金、国联安鑫发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。
王欢	本基金基金经理,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。	2017-12-29	-	10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。

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

3季度市场整体处于继续探底的阶段,同时,指数也出现了分化,上证50表现相对强势,而部分小股票和受经济预期影响较大的行业,则调整明显。

本基金考虑到目前市场赚钱效应仍然较弱,个股波动较大也会导致基金净值波动较大,因此报告期间维持了中低仓位运作;同时,由于部分个股调整已经相当充分,从一年以上的维度来看,这类股票已经具备了明显的投资价值,本报告期间本基金也做了适当的布局。展望4季度和明年,经济预计仍然处于下行趋势中,从基金策略看,市场总是领先于经济,优质企业可能率先企稳,同时在经济回暖的时候先享受到集中度上升的红利,因此本基金会继续布局超跌的优质公司。

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0.50%,同期业绩比较基准收益率为-0.45%;国联安通盈混合C的份额净值增长率为0.37%,同期业绩比较基准收益率为-0.45%。

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	19,479,307.96	30.73
	其中:股票	19,479,307.96	30.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	43,827,401.53	69.14
8	其他各项资产	78,706.26	0.12
9	合计	63,385,415.75	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,971,425.00	3.14
C	制造业	8,853,180.96	14.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	757,564.00	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,169,677.00	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,312,090.00	8.46
K	房地产业	1,415,371.00	2.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,479,307.96	31.04

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	22,500	1,541,250.00	2.46
2	600519	贵州茅台	2,100	1,533,000.00	2.44
3	600048	保利地产	116,300	1,415,371.00	2.26
4	601088	中国神华	64,700	1,319,233.00	2.10
5	600585	海螺水泥	31,400	1,155,206.00	1.84
6	000538	云南白药	13,800	969,174.00	1.54
7	600036	招商银行	28,300	868,527.00	1.38
8	601939	建设银行	116,100	840,564.00	1.34
9	601398	工商银行	143,900	830,303.00	1.32
10	000895	双汇发展	30,600	800,190.00	1.27

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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招商银行和工商银行外,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。

招商银行(600036)的发行主体招商银行股份有限公司因十四项违法违规事项于2018年2月12日被中国银监会罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

工商银行(601398)的发行主体中国工商银行股份有限公司齐齐哈尔分行由于越权私售对公理财产品,违规修改合同文本销售对公理财产品于2018年1月4日被齐齐哈尔银监分局罚款1040万元人民币。

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	58,937.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,749.28
5	应收申购款	19.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,706.26

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000538	云南白药	969,174.00	1.54	重大事项

§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	46,150,623.54	34,259,892.77
报告期基金总申购份额	131,610.87	8,096.57
减:报告期基金总赎回份额	743,186.71	29,954,039.73
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,539,047.70	4,313,949.61

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	2018年07月03日至2018年09月30日	15,940,538.82	-	-	15,940,538.82	31.98%
	2	2018年07月01日至2018年09月30日	23,911,206.76	-	-	23,911,206.76	47.96%

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。

§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

国联安基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日