国联安远见成长混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月十九日

§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2019年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安远见成长混合
基金主代码	006708
交易代码	006708
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年5月15日
报告期末基金份额总额	308,112,608.55份
投资目标	精选具有较高成长性及盈利质量的上市公司,在严格控制投资风险和保持基金资产良好流动性的基础上,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、大类资产配置策略 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,综合运用量化择时模型,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 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。 本基金港股通标的股票投资将综合考虑行业特性和公司基本面等因素,寻找具有相对估值优势和较大成长潜力的投资标的。 3、普通债券投资策略 基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。通过对宏观经济分析,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势,再结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。 在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析对各期限段的风险收益情况进行评估,选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。 4、中小企业私募债券投资策略 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。 5、可转换债券和可交换债券投资策略 本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外,本基金还将根据新发可转换债券和可交换债券的预计中签率、模型定价结果,积极参与可转换债券和可交换债券的新券申购。 6、股指期货投资策略 在股指期货投资上,本基金以套期保值为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。 7、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。 8、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,争取获得长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于中等预期风险、中等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。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。
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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,196,908.70
2.本期利润	-25,795,742.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0825
4.期末基金资产净值	283,357,415.76
5.期末基金份额净值	0.9197

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

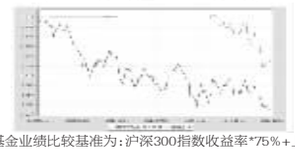
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.22%	0.76%	-8.95%	1.23%	0.73%	-0.47%

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

国联安远见成长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历史走势对比图
(2018年5月15日至2018年12月31日)



注:1、本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%;

2、本基金基金合同于2018年5月15日生效,截至本报告期末,本基金成立不满一年;

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		
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,国联安睿安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,国联安锐意成长混合型证券投资基金基金经理,国联安行业领先混合型证券投资基金基金经理。	2018-05-15	-	10年(自2008年起)	王超伟先生,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月起担任国联安睿安灵活配置混合型证券投资基金和国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年6月至2018年7月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的基金经理。2018年5月起兼任国联安远见成长混合型证券投资基金和国联安睿利定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018年12月起兼任国联安行业领先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》、《国联安远见成长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

2018年四季度,市场在10月份探出新低后,整体处于横盘状态。医药股遭遇黑天鹅事件,整个季度走势较弱。银行股在最后一个月也开始有补跌迹象。但整体来看,优质医药股中全年收涨个股不在少数,银行股全年跌幅也都在个位数,展示出了其抗跌的特性。四季度国内各项经济数据都不理想,外围市场也处于下行趋势。宏观弱势导致市场情绪比较低迷。

本基金对2019年的市场流动性边际改善偏乐观态度,主要关注方向依然在超跌的消费板块和估值便宜且业绩稳健的大金融板块。同时对新科技,新技术也会有所关注。消费升级,科技创新,和资管行业的高景气,这三个方向是可以大概率预期的。

展望2019年一季度,市场流动性改善是大概率事件,股指出现超跌后的反弹修正概率较大,一季度可以相对乐观。同时本基金会继续发掘高景气的科技,消费等方向的优质个股,努力为投资人赚取超额收益。

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-8.22%,同期业绩比较基准收益率为-8.95%。

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	255,124,386.80	89.66
	其中:股票	255,124,386.80	89.66
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	29,328,572.54	10.31
8	其他各项资产	97,191.54	0.03
9	合计	284,550,150.88	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	98,130,600.00	34.63
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	11,536,560.00	4.07
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	-	-
J	金融业	145,457,226.80	51.33
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	255,124,386.80	90.04

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	601398	工商银行	4,900,000	25,921,000.00	9.15
2	601288	农业银行	7,100,000	25,560,000.00	9.02
3	002142	宁波银行	1,494,940	24,247,936.80	8.56
4	601318	中国平安	427,000	23,954,700.00	8.45
5	600036	招商银行	910,000	22,932,000.00	8.09
6	600519	贵州茅台	30,000	17,700,300.00	6.25
7	600436	片仔癀	203,000	17,589,950.00	6.21
8	603288	海天味业	256,300	17,564,640.00	6.20
9	600332	白云山	456,000	16,306,560.00	5.75
10	600085	同仁堂	571,960	15,728,900.00	5.55

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

在股指期货投资上,本基金以套期保值为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。

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工商银行和招商银行外,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。

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。

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。

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	52,913.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,166.55
5	应收申购款	37,111.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,191.54

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	310,063,063.26
报告期基金总申购份额	26,437,874.50
减:报告期基金总赎回份额	28,378,329.21
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	308,112,608.55

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远见成长混合型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安远见成长混合型证券投资基金基金合同》

3、《国联安远见成长混合型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安远见成长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

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
二〇一九年一月十九日

国联安价值优选股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月十九日

§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2019年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安价值优选股票
基金主代码	006138
交易代码	006138
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9月20日
报告期末基金份额总额	103,103,438.33份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	本基金坚持价值投资理念,采用定量分析与定性分析相结合的方法,优选经营稳健、具有核心竞争优势、具备一定安全边际并且业绩可持续增长的上市公司进行投资。本基金将深入分析公司的业绩增长潜力,以发展的眼光评估公司的长期投资价值,同时积极关注公司基本面发生变化所带来的投资机会。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金可投资港股通标的股票,需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。
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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	201,227.23
2.本期利润	-2,179,472.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0148
4.期末基金资产净值	100,424,951.92
5.期末基金份额净值	0.9740

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

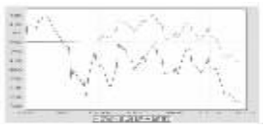
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.62%	0.57%	-9.65%	1.31%	7.03%	-0.74%

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

国联安价值优选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
(2018年9月20日至2018年12月31日)



注:1、本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%;

2、本基金基金合同于2018年9月20日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至本报告期末,本基金尚在建仓期;

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		
邹新进	本基金基金经理,兼任国联安股息灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理,权益投资部总经理。	2018-09-30	-	14年(自2004年起)	邹新进先生,硕士研究生。2004年7月至2007年7月在中信建投证券有限责任公司(前身为华夏证券有限责任公司)担任分析师。2007年7月加入国联安基金管理有限公司,历任高级研究员、基金经理助理、研究部副总监、现任权益投资部总经理。2010年3月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金的基金经理,2012年2月至2013年4月兼任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理,2018年3月起兼任国联安股息灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年9月起兼任国联安价值优选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》、《国联安德盛精选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

2018年第四季度股指(上证综指)总体呈现弱势下跌走势。越来越多的人认识到,中美贸易摩擦和竞争已经不是一个短期的问题,同时由于缺乏进一步的财政刺激加上持续回升的利率可能导致美国经济增长动能减缓,国际主要股市12月大幅调整,全球经济预期悲观;而国内股权质押问题仍难以解决,民营经济发展受困,而12月的国内几个重要会议包括改革开放40周年会议和中央经济工作会议未达到市场预期,或者准确的说,未达到市场的短期预期,进一步导致市场信心低迷。

展望2019年,本基金认为有两点值得关注:一是中美贸易摩擦是否能有所改善;二是改革措施(包括资本市场)的实质性出台,如十九大四中全会的改革部署等。

本基金认为,由于中国经济的韧性较强,同时目前市场所处位置已经很低,预计继续下跌空间很有限;总体上,A股市场底部特征已越来越明显,虽然短期比较难受,但中长期投资的位置比较好,市场目前是在等待不确定性的进一步消除和改革措施的明朗。

本基金报告期内由仍处于股票建仓期。在行业配置上,本基金从性价比的角度出发,重点以稳定的医药商业板块为主;并较大力度的配置集中度提升同时估值较低的地产、家居、农化、券商等板块以及新材料等新兴板块;另外,适时适度参与部分低估值的周期类板块。由于适时判断市场形势,对仓位控制较好,基金报告期内相对收益较好。

我们坚信,通过勤勉尽职的工作,持续挖掘优质上市公司进行长期投资,本基金将努力为基金持有人带来一定的中长期投资回报,来分享中国经济持续快速成长的成果。

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-2.62%,同期业绩比较基准收益率为-9.65%。

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	60,703,646.25	59.87
	其中:股票	60,703,646.25	59.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,379,612.40	13.20
	其中:债券	13,379,612.40	13.20
	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	20,000,000.00	19.73
	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	6,866,256.31	6.77
8	其他各项资产	434,618.42	0.43
9	合计	101,384,133.38	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	1,864,800.00	1.86
C	制造业	25,360,000.00	25.25
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	12,395,446.25	12.34
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	-	-
J	金融业	9,405,800.00	9.37
K	房地产业	8,803,000.00	8.77
L	租赁和商务服务业	1,289,000.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,585,600.00	1.58
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	60,703,646.25	60.45

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

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	600511	国药股份	267,565	6,220,886.25	6.19
2	000028	国药一致	149,000	6,174,560.00	6.15
3	600486	扬农化工	150,000	5,649,000.00	5.63
4	000671	阳光城	900,000	4,671,000.00	4.65
5	601166	兴业银行	230,000	3,436,200.00	3.42
6	600048	保利地产	250,000	2,947,500.00	2.94
7	300054	鼎龙股份	360,000	2,293,200.00	2.28
8	600030	中信证券	140,000	2,241,400.00	2.23
9	600997	开滦股份	360,000	2,041,200.00	2.03
10	601100	恒立液压	100,000	1,981,000.00	1.97

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,379,612.40	13.32
	其中:政策性金融债	13,379,612.40	13.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,379,612.40	13.32

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	018005	国开1701	133,210	13,379,612.40	13.32

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,本基金以套期保值为目标,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中除兴业银行外,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。

兴业银行(601166)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。

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	17,581.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	415,596.63
5	应收申购款	1,440.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	434,618.42

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	600030	中信证券	2,241,400.00	2.23	重大事项

§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	290,267,911.63
报告期基金总申购份额	2,063,972.77
减:报告期基金总赎回份额	189,218,446.07
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	103,103,438.33

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价值优选股票型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安价值优选股票型证券投资基金基金合同》

3、《国联安价值优选股票型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安价值优选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
二〇一九年一月十九日

国开泰富货币市场证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:国开泰富基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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