国联安信心增益债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安信心增益债券
基金主代码	253030
交易代码	253030
基金运作方式	契约型。本基金合同生效后一年内封闭运作,基金合同生效满一年后转为开放运作。
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	47,422,781.38份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在综合考虑基金组合的流动性需求、本金安全和投资风险控制的基础上,根据对宏观经济、货币政策、财政政策以及债券市场和股票市场相对投资价值和风险的分析,在法规及基金合同规定的比例限制内,动态调整现金类资产、债券类资产和权益类资产的比例,追求较低风险下的较高组合收益。 本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等来根投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金,属于证券市场中低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

注:根据基金合同及招募说明书的约定,本基金封闭期自2010年6月22日起至2011年6月21日止。自2011年6月22日起,本基金运作方式转为开放式,并打开申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	392,708.47
2.本期利润	270,601.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	52,675,039.34
5.期末基金份额净值	1.1108

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

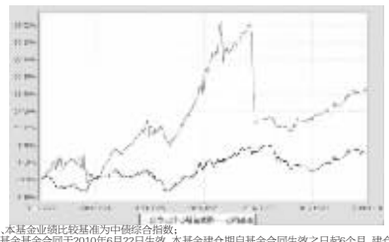
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.52%	0.06%	-0.24%	0.06%	0.76%	0.00%

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

国联安信心增益债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年6月22日至2019年6月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为中债综合指数;
2、本基金基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起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		
薛琳	本基金基金经理、兼任国联安德盛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、国联安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、国联安鑫瑞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、国联安鑫龙灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫利增长债券型证券投资基金基金经理。	2017-09-26	-	13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,历任债券交易员、基金经理助理。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月起兼任国联安鑫龙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月兼任国联安鑫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和国联安鑫发混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年11月兼任国联安鑫乾混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起兼任国联安鑫隆混合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。2019年1月起兼任国联安添利增长债券型证券投资基金(原鑫盈混合型证券投资基金)的基金经理。
邓海峰	本基金基金经理、兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。	2018-02-13	2019-05-16	13年(自2006年起)	邓海峰先生,硕士研究生。2006年11月至2011年8月担任北方之星数码技术(北京)有限公司金融研发部固定收益分析师;2011年8月至2013年12月担任创银行股份有限公司金融部债券交易员;2014年2月至2017年9月担任东海证券股份有限公司资产管理分公司固定收益投资部投资经理;2017年9月加入国联安基金管理有限公司,担任投资经理。2018年2月至2019年5月任国联安信心增益债券型证券投资基金的基金经理,2018年11月至2019年5月兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式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》、《国联安信心增益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 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;对投资流程独立糟核等。

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

2019年6月份,中国制造业采购经理指数(PMI)为49.4,与上月持平,非制造业PMI为54.2,前值54.3。国家统计局解读PMI指出,综合PMI产出指数为53.1,比上月回落0.3个百分点,表明我国企业生产经营活动保持扩张,但步伐有所放缓。国家主席2019年6月29日同美国总统在大阪举行会晤。两国元首同意推进以协调、合作、稳定为基调的中美关系,同意重启两国经贸磋商,美方表示不再对中国出口产品加征新的关税。中美会晤结果超预期,短期可能使债市承压。但资金面仍然宽松,流动性充足。综合以上各方面,本基金管理人对债市持有谨慎乐观的态度。

本基金在二季度采取稳健的投资风格。固定收益部分:主要投资标的为优质债券资产,维持久期在中低期限。权益部分:把握权益类资产的绝对收益型投资机会,力求为投资人创造较为理想的投资回报。

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0.52%,同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,110,342.00	86.12
	其中:债券	49,110,342.00	86.12
	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	3,000,000.00	5.26
	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	3,898,817.01	6.84
8	其他各项资产	1,014,044.08	1.78
9	合计	57,023,203.09	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	2,708,380.00	5.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,362,528.50	29.16
	其中:政策性金融债	15,362,528.50	29.16
4	企业债券	27,035,833.50	51.33
5	企业短期融资券	4,003,600.00	7.60
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,110,342.00	93.23

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	018006	国开1702	73,000	7,453,300.00	14.15
2	018008	国开1802	61,730	6,282,262.10	11.93
3	143421	18新发01	30,000	3,139,500.00	5.96
4	143605	18杨城投	30,000	3,121,200.00	5.93
5	143705	18蓝星01	30,000	3,103,500.00	5.89

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。

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。

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普利制药外,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。

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	4,795.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,009,248.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,014,044.08

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	48,078,751.20
报告期基金总申购份额	135,440.26
减:报告期基金总赎回份额	791,410.08
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	47,422,781.38

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,350,934.57
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,350,934.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.94

7.2 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	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		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	2019年4月1日至2019年6月30日	11,350,934.57	-	-	11,350,934.57	23.94%
	2	2019年4月1日至2019年6月30日	23,662,091.81	-	-	23,662,091.81	49.90%
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,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信心增益债券型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安信心增益债券型证券投资基金基金合同》
3、《国联安信心增益债券型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安信心增益债券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
二〇一九年七月十八日

国联安中证医药100指数证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安医药100指数
基金主代码	000059
交易代码	000059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	2,046,984,095.99份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,为投资者提供一个投资中证医药100指数的有效工具,从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法,进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,以实现对中证医药100指数的有效跟踪。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并结合合理的投资管理策略等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证医药100指数收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
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
下属分级基金的基金简称	国联安中证医药100A / 国联安中证医药100C
下属分级基金的交易代码	000059 / 006569
报告期末下属分级基金的份额总额	2,043,056,522.15份 / 3,927,573.84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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	国联安中证医药100A	国联安中证医药100C
1.本期已实现收益	-10,769,988.46	-20,230.77
2.本期利润	-142,439,993.81	-708,143.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0693	-0.1019
4.期末基金资产净值	1,760,322,649.70	3,475,333.67
5.期末基金份额净值	0.8616	0.8849

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	-7.35%	1.51%	-8.88%	1.57%	1.53%	-0.06%

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.国联安中证医药100C:

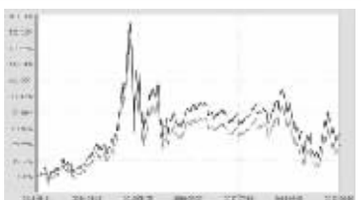
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.41%	1.51%	-8.88%	1.57%	1.47%	-0.06%

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

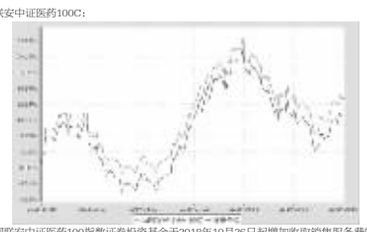
国联安中证医药100指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年8月21日至2019年6月30日)

1. 国联安中证医药100A:



注:1、国联安中证医药100指数证券投资基金于2018年10月26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,全部转换为国联安中证医药100指数A类份额;
2、本基金业绩比较基准为:95%×中证医药100指数收益率+ 5%×活期存款利率(税后);
3、本基金基金合同于2013年8月21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. 国联安中证医药100C:



注:1、国联安中证医药100指数证券投资基金于2018年10月26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,全部转换为国联安中证医药100指数A类份额;
2、C类收费模式的对应基金代码为006569,自2018年10月30日起开始确认申购份额,因此,国联安中证医药100指数C类份额的业绩表现自2018年10月30日开始计算;
3、本基金业绩比较基准为:95%×中证医药100指数收益率+ 5%×活期存款利率(税后);
4、本基金基金合同于2013年8月21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		
黄焕	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、国联安增益一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增瑞收益纯债债券型证券投资基金基金经理、国联安双力中小板标指证券投资基金(LOF)基金经理、国联安鑫鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。	2016-08-19	-	17年(自2002年起)	黄焕先生,硕士研究生。2003年10月加入国联安基金管理有限公司,历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、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的基金经理。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的基金经理。2010年11月起兼任上证大宗商品投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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的基金经理。2013年6月至2017年3月兼任国联安中证股债金融策略指数证券投资基金的基金经理。2016年10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标指证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年3月起兼任国联安鑫鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年6月起兼任国联安增瑞收益纯债债券型证券投资基金的基金经理。
沈丹	本基金基金经理、兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安通信灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增盈纯债债券型证券投资基金基金经理。	2018-11-14	-	9年(自2010年起)	沈丹女士,硕士研究生。2010年8月至2015年2月在中国人保资产管理股份有限公司担任交易员;2015年3月至2017年2月在江苏常熟农村商业银行股份有限公司任投资经理。2017年3月加入国联安基金管理有限公司,担任基金经理助理。2017年8月至2018年11月兼任国联安鑫乾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8月至2018年6月兼任国联安鑫裕混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月至2018年11月兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起兼任国联安灵活配置混合型证券投资基金(原国联安保本混合型证券投资基金)的基金经理。2018年7月起兼任国联安通信用债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年11月起兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年1月起兼任国联安增鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019年5月起兼任国联安增瑞纯债债券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》、《国联安中证医药100指数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;对投资流程独立糟核等。

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

2019年二季度,中美贸易摩擦加剧给资本市场扰上一层阴霾,美国政府的一系列制裁行动导致以半导体行业为首的美股出现较大幅度的回调。国内方面,科创板在6月份正式开板,预计未来会对科技股带来一定的刺激作用。A股市场整个季度股指高位回调,大小盘分化较大,大盘蓝筹股表现相对出色,沪深300指数下跌约1.21%,中证100指数上涨约1.88%,中小板综指下跌10.31%,创业板综指下跌9.36%,上证商品指数下跌3.42%,中证医药100指数下跌9.37%。

依据基金合同的约定,本基金保持合理的仓位,采用完全复制的方法跟踪中证医药100指数,将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,国联安医药100指数A的份额净值为0.8616元,国联安医药100指数C的份额净值为0.8849元;本报告期内,国联安医药100指数A的份额净值增长率为-7.35%,同期业绩比较基准收益率为-8.88%。国联安医药100指数C的份额净值增长率为-7.41%,同期业绩比较基准收益率为-8.88%;本报告期内,本基金日均跟踪偏离度为0.06%,年化跟踪误差为1.18%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

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	1,639,898,932.07	92.78
	其中:股票	1,639,898,932.07	92.78
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	126,513,716.78	7.16
7	其他各项资产	1,051,528.61	0.06
8	合计	1,767,464,177.46	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积极投资按行业分类的股票投资组合

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	6,442,094.11	0.37
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	-	-
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	-	-
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	6,442,094.11	0.37

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指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,228,160,770.82	69.63
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	193,894,771.52	10.99
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	17,185,025.60	0.97
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	64,077,289.68	3.63
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	130,138,980.34	7.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,633,456,837.96	92.61

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.3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期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	600276	恒瑞医药	499,664	32,977,824.00	1.87
2	300347	泰格医药	243,932	18,807,157.20	1.07
3	300630	普利制药	320,249	18,452,747.38	1.05
4	300142	沃森生物	645,201	18,297,900.36	1.04
5	600771	广誉远	934,940	18,137,836.00	1.03
6	603939	益丰药房	258,125	18,066,168.75	1.02
7	002653	海思科	1,264,524	17,956,240.80	1.02
8	300122	智飞生物	415,073	17,889,646.30	1.01
9	600867	通化东宝	1,151,122	17,727,278.80	1.01
10	002007	华兰生物	577,746	17,615,475.54	1.00

5.3.2期末积极投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(%)