国联安货币市场证券投资基金

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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	6,271,237,041.11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	92,275,885.40份	6,178,961,155.71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)	
	国联安货币A	国联安货币B
1.本期已实现收益	442,357.37	53,138,064.25
2.本期利润	442,357.37	53,138,064.25
3.期末基金资产净值	92,275,885.40	6,178,961,155.71

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	0.5662%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2296%	0.0010%

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	0.6267%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2901%	0.0010%

注:1.本基金收益分配按日结转份额;

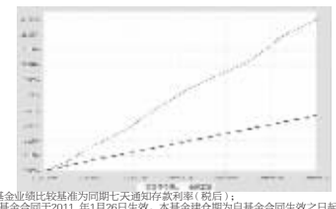
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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2019年6月30日)

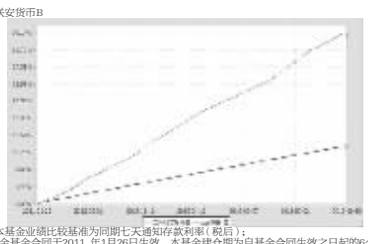


注:1.本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);

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,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,固定收益部总经理兼养老金及POP投资部总经理。	2018-06-22	-	17年(自2002年起)	欧阳健先生,硕士研究生。2002年9月至2016年2月在广发银行股份有限公司金融市场部担任利率及外汇产品交易主管,2016年2月至2018年5月在广发证券股份有限公司固定收益投资部担任部门执行董事。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,现任固定收益部总监兼养老金及POP投资部总经理。2018年6月起任国联安货币市场证券投资基金的基金经理。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5月起兼任国联安增瑞政策性金融债纯债债券型证券投资基金的基金经理。
万莉	本基金基金经理,现金管理部总经理。	2019-02-13	-	9年(自2010年起)	万莉女士,硕士研究生。2008年6月至2013年6月在长信基金管理有限责任公司历任交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式基金基金经理;2013年6月至2014年6月在富国基金管理有限公司担任基金经理;2014年6月至2018年9月在富国基金管理有限公司担任现金管理投资总监兼富国天时货币基金、富国安益货币基金和富国收益宝交易型货币基金的基金经理。2018年10月加入国联安基金管理有限公司,担任现金管理部总经理。2019年2月起担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

2019年二季度,稳健的货币政策体现了逆周期调节的要求,宏观杠杆率高速增长势头得到初步遏制,金融风险防控稳妥果断推进,金融服务实体经济的质量和效率逐步提升。

4月中旬受缴税影响,货币市场资金面波动较大,各种期限存款存单收益率显著上行。4月24日,央行开展了定向中期借贷便利(TMLF)操作,操作金额为2647亿元,操作利率为3.15%。在此操作后,市场流动性得到缓解,短端收益率明显下行。

5月6日央行宣布定向降准,从5月15日开始对中小银行实行较低的优惠存款准备金率,释放长期资金约2800亿元,全部用于发放民营和小微企业贷款,5月24日,央行、银保监会公告,鉴于包商银行股份有限公司出现严重信用风险,银保监会决定自2019年5月24日起对包商银行实行接管,接管期限一年。市场一度因此发生流动性恐慌,但在央行连续四天OMO大量操作后,市场流动性重回平稳状态。

6月14日央行公告增加再贴现额度2000亿元、常备借贷便利额度1000亿元,加强对中小银行流动性支持,保持中小银行流动性充足。在央行连续大量跨季OMO的操作下,货币市场整体宽松,跨季资金价格不断下行,各类短期限资产价格下降明显。

报告期内,本基金秉承稳健投资原则,谨慎操作,根据流动性情况保持了一定比例的银行存单、短期融资券、短期存款、银行间逆回购等大类资产的配置,并根据组合持仓情况进行了一定的调整,总体流动性较好。

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0.5662%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。本报告期内,国联安货币B的份额净值增长率为0.6267%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	3,220,955,478.92	50.42
	其中:债券	3,220,335,478.92	50.41
	资产支持证券	620,000.00	0.01
2	买入返售金融资产	2,032,923,634.63	31.82
	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	1,096,039,089.50	17.16
4	其他资产	38,490,992.79	0.60
5	合计	6,388,409,195.84	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	9.53	
	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	-	-
	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

在本报告期内本市市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

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	51.01	1.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	33.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	8.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	7.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.24	1.83

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	360,539,761.85	5.75
	其中:政策性金融债	360,539,761.85	5.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	430,218,014.61	6.86
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,429,577,702.46	38.74
8	其他	-	-
9	合计	3,220,335,478.92	51.35
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	011901336	19船重SCP002	2,000,000	199,835,330.88	3.19
2	111918140	19华夏银行CD140	2,000,000	199,380,310.25	3.18
3	111815396	18民生银行CD395	2,000,000	199,173,388.53	3.18
4	111918161	19华夏银行CD161	2,000,000	199,077,399.10	3.17
5	111809344	18浦发银行CD344	1,900,000	189,613,216.91	3.02
6	190201	19国开01	1,500,000	149,946,630.15	2.39
7	111810562	18兴业银行CD562	1,500,000	149,384,985.11	2.38
8	170402	17农发02	1,000,000	100,523,196.56	1.60
9	011900996	19南电SCP015	1,000,000	100,045,655.90	1.60
10	111809354	18浦发银行CD354	1,000,000	99,750,101.83	1.59

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	0.03%
报告期内偏离度的最低值	-0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1989013	19上和1A1	1,000,000.00	620,000.00	0.01

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民生银行CD395(111815395)的发行主体中国民生银行股份有限公司,因七项违法违规事项于2018年12月7日被中国银行保险监督管理委员会处以3160万元罚款。广州分行因违反支付结算管理规定被警告,于2019年1月23日被没收违法所得2,787,141.24元,并处罚款2,787,141.24元,合计罚金5,574,282.48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	17,652,360.99
4	应收申购款	20,838,631.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,490,992.79

§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	124,164,936.46	8,736,893,382.36
报告期基金总申购份额	85,607,607.29	15,629,638,487.82
报告期基金总赎回份额	117,496,658.35	18,187,570,714.47
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	92,275,885.40	6,178,961,155.71

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2019-05-08	20,000,000.00	20,000,000.00	-
2	赎回	2019-05-17	10,000,000.00	10,000,000.00	-
合计			30,000,000.00	30,000,000.00	

§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

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
二〇一九年七月十八日

国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金

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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	国联安鑫享灵活配置混合
基金主代码	001228
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月28日
报告期末基金份额总额	369,570,732.74份
投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来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。 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。 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者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换债券。
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	较高预期风险、较高预期收益
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	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001228	002186
报告期末下属分级基金的份额总额	135,451,196.94份	234,119,535.80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)	
	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C
1.本期已实现收益	640,468.10	623,940.19
2.本期利润	1,413,644.17	2,949,575.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.0296
4.期末基金资产净值	118,481,896.78	205,855,176.75
5.期末基金份额净值	0.8747	0.8793

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,包含停牌股票投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.国联安鑫享灵活配置混合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	-3.38%	1.09%	-0.06%	0.77%	-3.32%	0.32%

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.国联安鑫享灵活配置混合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	-3.39%	1.09%	-0.06%	0.77%	-3.33%	0.32%

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。

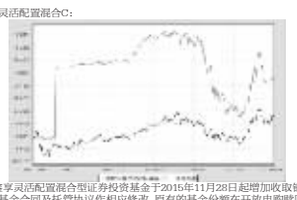
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安鑫享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

(2015年4月28日至2019年6月30日)

1. 国联安鑫享灵活配置混合A:



注:1、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28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,全部转换为国联安鑫享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002186,自2015年12月7日起开始确认申购份额,因此,国联安鑫享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12月7日开始计算,其业绩比较基准收益率也自2015年12月7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4月28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10月27日建仓期结束当日有两条资产配置比例被动不符合合同约定:本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的140%。除此以外,其他各项资产配置符合合同约定;

5、2015年10月27日建仓期结束当日本基金遭遇大额赎回确认,致使以上两条资产配置比例被动不达标,本基金已于2015年10月29日及时调整完毕;

6、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,兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫益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,国联安鑫发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,国联安鑫利享纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015-06-12	-	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11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2017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和国联安鑫隆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月起兼任国联安睿丰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。
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,国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫利定期开放混合型证券投资基金基金经理,国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017-12-29	-	11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。2019年6月起兼任国联安睿祺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》、《国联安鑫享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

2019年第二季度证券市场整体疲软。4月中旬市场风险偏好的整体修复达到顶峰,这和我们预期较为符合,但随着政策的重新定调,市场情绪快速降温,特别是5月,由于中美谈判再次恶化,市场情绪急转直下,个股普跌。而结构上则分化巨大,食品饮料行业由于预期稳定成为市场资金的避难所,逆势上涨;而大量中小市值股票则大幅下挫。

展望三季度,由于6月底中美元首会晤给中美谈判重新定调,短期内市场的风险偏好将提升,关注点将回到国内,包括科创板开板、逆周期调节政策等。从中长期角度看,中美竞争依然存在,但发展好中美关系仍是国际社会的普遍期待,中国持续崛起的态势不变,所以,站在目前较低的位置,中长期投资的性价比较高。市场节奏可能以"进二退一"方式演进。

本基金报告期内在仓位上基本不变。在行业配置上,本基金从性价比的角度出发,重点关注集中度较高同时估值相对较低的医药流通、地产及其下游、农化、工程机械等板块;同时,鉴于预期2019年风险偏好的提升和科创板等证券市场制度的创新,将适时适度配置部分科技成长板块(5G、部分化工新材料等)和券商板块。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,我们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-7.58%,同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

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	93,704,863.19	93.93
	其中:股票	93,704,863.19	93.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,551.03	0.10
	其中:债券	100,551.03	0.10
	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	5,919,746.12	5.93
8	其他各项资产	35,339.95	0.04
9	合计	99,760,500.29	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	3,746,950.00	1.16
C	制造业	33,140,234.00	10.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,680,240.00	1.13
E	建筑业	2,392,000.00	0.74
F	批发和零售业	4,391,220.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	4,021,440.00	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,537,363.76	0.78
J	金融业	17,667,967.00	5.45
K	房地产业	642,411.00	0.20
L	租赁和商务服务业	4,051,306.00	1.25
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	503,262.50	0.16
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	76,797,499.86	23.68

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	601888	中国国旅	45,700	4,051,305.00	1.25
2	600009	上海机场	48,000	4,021,440.00	1.24
3	601318	中国平安	44,700	3,960,867.00	1.22
4	600276	恒瑞医药	60,000	3,960,000.00	1.22
5	600519	贵州茅台	4,000	3,936,000.00	1.21
6	600887	伊利股份	114,700	3,832,127.00	1.18
7	600028	中国石化	685,000	3,746,950.00	1.16
8	601933	永辉超市	366,000	3,736,860.00	1.15
9	600900	长江电力	205,600	3,680,240.00	1.13
10	600036	招商银行	102,000	3,669,960.00	1.13

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	-	-