国联安德盛安心成长混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月27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。

本报告期自2019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	国联安安心成长混合
基金主代码	253010
交易代码	253010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月13日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	82,493,779.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	全程风险预算,分享经济成长,追求绝对收益。
投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次通过全程的风险预算,结合数量化的金融工程模型,根据市场以及基金组合风险收益率的情况,进行资产配置,行业配置和不同种类债券的配置。第二个层次,在股票投资方面,以价值选股为原则,主要选取基本面好、流动性强,价值被低估的公司,在行业配置基础上进行组合管理;在债券投资方面,注重风险管理,追求稳定收益,基于对中长期宏观形势与利率走势的分析进行久期管理与类属配置,并追�iii寻可转换债券来构建债券组合。
业绩比较基准	为“德盛安心成长线”,“德盛安心成长线”的确定方式为在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。
风险收益特征	中低风险的基金产品,追求长期的稳定的收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李华	郭明
	联系电话	021-38992888	010-66105799
	电子邮箱	customer.service@epicfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95588
传真		021-50151582	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.epicfunds.com
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	5,136,391.37
本期利润	11,060,941.28
加权平均基金份额本期利润	0.0879
本期基金份额净值增长率	11.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1049
期末基金资产净值	53,430,544.17
期末基金份额净值	0.648

注:1、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。

2、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。

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

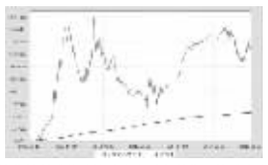
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.21%	0.47%	0.10%	0.00%	2.11%	0.47%
过去三个月	0.78%	0.71%	0.30%	0.00%	0.48%	0.71%
过去六个月	11.53%	0.67%	0.60%	0.00%	10.93%	0.67%
过去一年	0.78%	0.69%	1.23%	0.00%	-0.45%	0.69%
过去三年	-2.11%	0.53%	3.78%	0.00%	-5.89%	0.53%
自基金合同生效起至今	127.45%	0.76%	37.45%	0.01%	90.00%	0.75%

注:1、本基金的业绩基准为“德盛安心成长线”, 德盛安心成长线的确定:在基金合同生效时的值为0.90 元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365;

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份额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

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年7月13日至2019年6月30日)



注:1、本基金的业绩基准为“德盛安心成长线”, 德盛安心成长线的确定:在基金合同生效时的值为0.90 元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365;

2、本基金基金合同于2005年7月13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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司,其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司,是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险(集团)股份有限公司控股的资产管理公司;外方股东为德国安联集团,是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末,公司共管理四十六只开放式基金。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队,借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验,结合本地投资研究与客户服务的成功实践,秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念,力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
吕中凡	本基金基金经理、兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理、国联安添益利增长债券型证券投资基金基金经理、国联安德盛增利债券型证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。	2016-10-31	-	8年(自2011年起)	吕中凡先生,硕士研究生。2006年7月至2008年7月在华虹宏力半导体制造有限公司(原宏力半导体制造有限公司)担任企业内部管理咨询管理师。2009年3月至2011年3月在上海远东资信评估有限公司(原上海远东鼎信财务咨询有限公司)担任信用评估项目经理。2011年5月加入国联安基金管理有限公司,历任信用分析员、债券组合助理、基金经理助理。2015年5月至2018年7月任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2015年7月至2018年3月兼任国联安鑫富混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月起兼任国联安添利增长债券型证券投资基金(原国联安鑫盛合型证券投资基金)的基金经理。2016年11月起兼任国联安德盛增利债券型证券投资基金的基金经理。2016年12月至2018年7月兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年6月兼任国联安鑫怡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长债券型证券投资基金的基金经理。2018年3月至2018年12月兼任国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨子江	本基金基金经理、兼任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、国联安鑫发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。	2017-12-29	-	18年(自2001年起)	杨子江先生,硕士研究生。2001年5月至2008年3月在上海睿信投资管理有限公司担任研究员。2008年4月加入国联安基金管理有限公司,历任高级研究员、研究部副总监,现任研究部总经理。2017年12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和国联安鑫盛混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月至2018年6月兼任国联安鑫怡混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起兼任国联安鑫汇混合型证券投资基金、国联安鑫发混合型证券投资基金、国联安鑫隆混合型证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理。
林渌	本基金基金经理助理、兼任研究部行业研究员。	2015-05-04	2019-06-27	8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》、《国联安德盛安心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 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

权益部分:一季度,市场在外部矛盾缓和,以及经济企稳的预期下快速反弹;而二季度由于贸易摩擦的反复及信用收缩,风险偏好下降,市场出现了调整。

本基金结合各行业竞争龙头化的特征,以龙头股的配置为主,综合考虑经济实际、利率水平和估值水平,取得风险调整后的回报,并有效控制了回撤。

固收部分:回顾2019年上半年,为了为国内经济顺利实现目标,货币政策总体还是维持了宽松的环境,银行间质押式回购利率创下了近年来新低。但银行间交易对手出现了分层现象,也造成了债券信用利差的扩大。

本基金由于认为货币政策宽松环境依旧持续,所以维持了一定的利率债比例。同时,考虑到产能过剩行业的公司债券债务负担逐渐加重,降低了持仓中信用资质偏弱的债券比重。目前持仓以利率债为主要持仓品种。

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11.53%,同期业绩比较基准收益率为0.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益部分:展望下半年,实体经济仍面临下行压力。二季度以来,全球经济增速明显放缓,国内PMI快速回落至枯荣线以下,而信用扩张或遭遇打破刚兑预期的挑战。

从积极方面来看,G20后中美恢复接触,国内政策也越来越强调稳增长,科创板的顺利推出,都有利于市场情绪的修复。下半年压制风险偏好的主要因素是经济下行的压力,我们判断,基础利率水平有下降的空间,但信用利差则可能进一步上升,资源将进一步向各行业的龙头企业集中。

本基金管理人重视上市公司的现金流及经营质量, 优秀公司对现金流的吸引和创造形成的优势越来越大,无法形成竞争壁垒的公司投资价值也相当有限。未来本基金将着重投资:

①消费品优势公司,尤其是产品系不断扩张,消费场景愈加丰富的龙头公司;

②具备核心研发能力、符合自主可控的制造业和科技公司;

③保持稳定分红和现金流的价值股。

固收部分: 展望下半年债券市场, 资金面仍将维持对债券市场相对友好的局面.虽然利率下行空间不大,但上行的风险也很小。因此本基金管理人将维持对债券市场相对乐观的态度,且保持相对积极的运作方式。

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, 本基金托管人在对国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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, 国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的管理人——国联安基金管理有限公司在国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,国联安德盛安心成长混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的国联安德盛安心成长混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

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:国联安德盛安心成长混合型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:	-	-
银行存款	5,613,486.27	8,165,325.82
结算备付金	52,390.42	131,556.03
存出保证金	29,484.57	26,455.63
交易性金融资产	44,103,675.44	85,083,434.80
其中:股票投资	22,302,388.84	45,061,058.20
基金投资	-	-
债券投资	21,801,286.60	40,022,376.60
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	4,000,000.00	-
应收证券清算款	-	328,868.69
应收利息	236,557.30	891,719.33
应收股利	-	-
应收申购款	1,252.09	1,778.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	500.00	500.00
资产总计	54,037,346.09	94,629,638.57
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	280.00	-
应付赎回款	204,930.76	290.72
应付管理人报酬	66,161.79	121,043.77
应付托管费	11,026.96	20,173.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	40,457.97	38,925.88
应交税费	195,618.59	195,618.73
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	88,325.85	365,000.73
负债合计	606,801.92	741,053.82
所有者权益:	-	-
实收基金	44,779,149.96	87,697,316.29
未分配利润	8,651,394.31	6,191,268.46
所有者权益合计	53,430,544.17	93,888,584.75
负债和所有者权益总计	54,037,346.09	94,629,638.57

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.648元,基金份额总额82,493,779.50份。

6.2 利润表

会计主体:国联安德盛安心成长混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	12,030,898.11	-7,027,034.98
1.利息收入	726,327.61	1,015,574.57
其中:存款利息收入	26,618.92	77,141.82
债券利息收入	694,961.86	831,594.12
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,756.83	106,838.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	5,379,325.88	-6,022,269.92
其中:股票投资收益	4,831,984.05	3,445,754.58
基金投资收益	-	-
债券投资收益	243,015.38	-10,006,920.86
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	304,326.45	538,896.36
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	5,924,549.91	-2,023,503.20
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	694.71	3,163.57
减:二、费用	969,956.83	1,469,993.37
1. 管理人报酬	583,047.82	963,678.58
2. 托管费	97,174.59	160,613.07
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	182,647.40	140,561.80
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	3.84	434.33
7. 其他费用	107,083.18	204,705.59
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	11,060,941.28	-8,497,028.35
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	11,060,941.28	-8,497,028.35

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安德盛安心成长混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	87,697,316.29	6,191,268.46	93,888,584.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,060,941.28	11,060,941.28
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)	-42,918,166.43	-8,600,815.43	-51,518,981.86
其中:1.基金申购款	582,051.89	88,986.98	671,038.87
2.基金赎回款	-43,500,218.32	-8,689,802.41	-52,190,020.73
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)	44,779,149.96	8,651,394.31	53,430,544.17
项目	上年度可比期间 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)	120,368,541.65	33,068,381.14	153,436,922.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,497,028.35	-8,497,028.35
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)	-26,066,778.91	-7,240,057.59	-33,306,836.50
其中:1.基金申购款	660,879.78	172,674.68	833,554.46
2.基金赎回款	-26,727,658.69	-7,412,732.27	-34,140,390.96
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)	94,301,762.74	17,331,295.20	111,633,057.94

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

国联安德盛安心成长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”)证监基金字[2005]第9号《关于同意国联安德盛安心成长混合型开放式证券投资基金募集的批复》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》和《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)KPMG-B(2005)CR No.0021号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》于2005年7月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为409,055,615.48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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票类资产5%-65%,债券类资产(含到期日在一年以内的政府债券)不低于20%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较标准为:德盛安心成长线;该成长线按以下方法确定:在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司(“太平洋资管”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东

注:自2018年5月4日起,本基金管理人的控股股东由国泰君安证券股份有限公司变更为太平洋资产管理有限责任公司,因此自2018年5月4日起,国泰君安证券股份有限公司不再属于本基金的关联方。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

上年度可比期间所披露的与国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安”)之间的关联方交易均为发生在截至2018年5月3日止期间的交易,所披露的与太平洋资产管理有限责任公司之间的关联方交易均为发生在自2018年5月4日至2018年6月30日止期间的交易。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间, 本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间,本基金无支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	583,047.82	963,678.58
其中:支付销售机构的客户维护费	133,853.76	206,802.37

注: 支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	97,174.59	160,613.07

注: 支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间, 本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间,基金管理人未投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末,其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	5,613,486.27	25,604.69	22,131,324.40	72,705.16

注:本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2019年6月30日的相关余额为人民币52,390.42元。(2018年6月30日:人民币94,728.96元)

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间, 本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元,因此没有作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元,因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,302,388.84	41.27
	其中:股票	22,302,388.84	41.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,801,286.60	40.34
	其中:债券	21,801,286.60	40.34
	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	4,000,000.00	7.40
	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	5,665,876.69	10.49
8	其他各项资产	267,793.96	0.50
9	合计	54,037,346.09	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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	466,180.00	0.87
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,093,753.84	22.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	752,000.00	1.41
F	批发和零售业	984,700.00	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	2,527,080.00	4.73
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	1,579,200.00	2.96
K	房地产业	3,500,550.00	6.55
L	租赁和商务服务业	398,925.00	0.75
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	22,302,388.84	41.74

注:由于四舍五入