

2017年年度报告摘要

4	600036	招商银行	7,927,70567	0.75
5	600741	华城汽车	7,717,07660	0.73
6	600000	浦发银行	7,219,00000	0.68
7	601959	浦发银行	6,791,67900	0.64
8	600000	长江证券	6,495,85000	0.62
9	600000	平安银行	6,190,15444	0.59
10	600999	招商电子	5,628,43400	0.55
11	002791	智慧金和	5,418,22750	0.51
12	000123	兰花科创	5,067,30500	0.48
13	002029	七匹服	4,908,93855	0.46
14	000153	隆发股份	4,832,00000	0.46
15	000625	长安汽车	4,659,14400	0.44
16	600104	上汽集团	4,426,25100	0.42
17	601318	中国平安	4,318,00732	0.41
18	600885	宏发股份	4,281,51000	0.40
19	300038	华泰证券	4,004,48040	0.38
20	601988	中国银行	3,930,00000	0.37

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	101,796,064.20
卖出股票的收入(成交)总额	188,423,698.96

注:不考虑相关交易费用。

8.5 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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,694,450.00	1029
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	795,007.50	221
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换(可交换)债	-	-
-			

9	其他	-	-
10	合计	4,489,457.50	12.51

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

8.6 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
金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	比例(%)
1	019563	17国债 09	37,000	3,694,450.00	10.29
2	122231	12上电债	7,970	795,007.50	2.21

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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国债期货，没有相关投资政策。

8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

12.12.1 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外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制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由于批量转让个人贷款于 2017 年 3 月 29 日被中国银监会处以罚款 50 万元。

投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
4	卖出期权合约	497,046.67

2	应收证券清算款	21,021.37
3	应收股利	-
4	应收利息	107,208.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,445.53

8.12.4 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。

8.12.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600903	贵州燃气	66,226.08	0.18	重大事项

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
国联安通盈混合	466	39,420.56	10,866,279.30	59.15%	7,503,700.61	40.85%

国泰君安资管混合 C	149	61,831.07	0.00	0.00%	9,212,828.85	100.00%
合计	615	44,850.10	10,866,279.30	39.40%	16,716,529.46	60.60%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末,本基金无高级管理人员、基金高级管理人员及基金高级管理人员持有本基金基金份额的情况。

减区间均为 0;本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 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	543,401,800.44	341,613,140.88
本报告期基金总申购份额	226,397.57	82,873.66

减:本报告期基金总赎回份额	525,258,218.10	332,483,185.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,369,979.91	9,212,828.85

注:1.本基金基金合同于2014年6月13日生效。
2.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赎回和转换出份额。

9.11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.2017年9月5日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》,孟明霞女士担任国联安基金管理有限公司总经理,谭晓雨女士不再担任国联安基金管理有限公司总经理。

2.2017年1月19日,基金管理人发布《国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》,冯锐先生不再担任本基金基金经理。

3.2017年12月29日,基金管理人发布《国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》,王欢先生担任本基金的基金经理。

4.本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期由基金管理人、基金托管人、基金财产、基金托管业务涉及的诉讼

11.4 基金投资策略的改变
本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金报告年度支付给毕马威华会计师事务所有限公司的股权为 7.5 万元人民币, 目前该事务所已向本基金提供连续 4 年的审计业务。

11.6 除董事长、托管人及基金保障人员外高级管理人员变动情况

1. 本报告期内, 中国证券投资基金业协会上海监管局对中国基金管理人进行了现场检查, 并就检查中发现的问题下发了《关于对国联安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。对此, 我司高度重视, 对相关制度流程进行了全面梳理, 针对性的制定了整改执行方案, 逐条落实, 彻底排查了业务中存在的风险, 并就整改情况向中国证券投资基金业协会上海监管局提交了整改报告。

2. 本报告期内基金托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元的情况

金额单位:人民币元						
券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
海通证券股份有限公司	2	207,344,370.60	100.00%	266,690.95	100.00%	

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序
(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选举标准
基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为
A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范, 具有完备的内部控制制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
E 基金基金运作所需的设备、安全的通讯条件, 交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求并能为本基金提供全面的信息服务。
F 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供周到的咨询服务。
(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序
基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后, 与拟选定的证券经营机构签订交易单元使用协议, 通知基金托管人办理相关交易单元租用手续。之后, 基金管理人将根据各证券经营机构的

研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名:

- A 提供的研究报告质量和数量;
- B 研究报告被基金采纳的情况;
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;
- E 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;
- F 证券经营机构和助费公司研究员离职情况。

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名,同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息服务。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于达不到有关标准的证券经营机构将视基金经理管理人的选择名单,基金管理人将重新选择其是否稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。若证券经营机构所提供研究报告及其他信息服务不符合要求,基金

2. 报告期内租用证券公司交易单元变更情况
报告期内租用证券公司交易单元无变更情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
金额单位：人民币元

	债券交易	回购交易	权证交易
报告期末基金持有的证券公司交易单元数量	0	0	0
报告期内基金租用证券公司交易单元数量	0	0	0

券商名称	成交金额	券商成交总 额的比例	成交金额	成交总额的 比例	成交金额	占当期证成 交总额的比例
海通证券股份有限公司	293,045,853.58	100.00%	4,292,079,000.00	100.00%	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

机构投资者类别：报告期内持有基金份额变化情况及报告期未持有基金情况
 -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、有份额、份额占比
 机构 -1-2017 年 11 月 09 日至 2017 年 12 月 31 日 -18,411,239.96-0.00-8,000,000.00-10,412,399.96-37.75%
 -2-2017 年 04 月 19 日至 2017 年 11 月 08 日 -134,573,015.59-0.00-134,573,015.59-0.00-100.00%

-3-2017 年 01 月 01 日至 2017 年 11 月 01 日 -231,052,680.22-0.00-231,052,680.22-0.00-0.00%

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。

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。

国联安基金管理有限公司
二〇一八年三月二十一日

二〇一八年三月二十七