国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2019年第2号)

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

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2014年7月25日证监许可[2014]755号文准予注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

投资有风险,投资者在申购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金资产净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年7月26日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效日期:2015年1月26日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国联安基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
法定代表人:于业明
成立日期:2003年4月3日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2003]42号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5亿元人民币
存续期限:持续经营
电话:021-38992888
传真:021-50151880
联系人:黄娜娜
股权结构:

股东名称	持股比例
太平洋资产管理有限责任公司	51%
德国安联集团	49%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

于业明先生,董事长,经济学博士,高级会计师。历任宝钢集团财务有限责任公司副总经理、常务副总经理、总经理、董事长,华宝信托投资有限责任公司总经理,联合证券有限责任公司总经理,华宝投资有限公司总经理,华宝信托有限责任公司董事长,华宝证券有限责任公司董事长,中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事等职。现任太平洋资产管理有限责任公司党委书记、董事长、总经理,国联安基金管理有限公司董事长。

Jiachen Fu(付佳晨)女士,副董事长,德国洪堡大学工商管理学士。历任美国克赖斯勒汽车集团市场推广及销售部学员、戴姆勒东北亚投资有限公司金融及监控部成员、忠利保险公司内部顾问、安联全球车险驻中国业务发展主管兼创始人、安联集团董事会事务主任等职。现任安联资产管理公司管理董事兼中国业务发展总监、国联安基金管理有限公司副董事长。

孟朝霞女士,董事,经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理、融通基金管理有限公司总经理等职。现任国联安基金管理有限公司总经理。

杨一君先生,董事,工商管理硕士。历任美国通用再保险金融产品公司副总裁助理、中国太平洋保险(集团)股份有限公司资金运用管理中心副总经理,太平洋资产管理有限责任公司总经理助理、运营总监、风险管理部总经理、合规审计部总经理等职。现任太平洋资产管理有限责任公司总经理助理、财务负责人。

Anna Sophie Herken女士,董事,剑桥大学工商管理硕士、美利坚大学法学硕士。历任世界银行监察组顾问、柏林上诉法院书记员、柏林联邦经济技术部政务主任、世界银行监察组助理执行秘书长、欧洲复兴开发银行秘书长办公室首席顾问、柏林赫尔梯行政学院董事总经理、德国哈索·普拉特纳资本有限公司首席财务官、首席运营官及授权代表等职。现任安联资产管理有限公司业务部门主管。

陈有安先生,独立董事,工学博士。2016年4月退休前,历任国家开发银行华东地区信贷局副局长,国开行兰州分行行长、党委书记,甘肃省省长助理,党组成员,甘肃省省长助理兼贸易经济合作厅厅长、党组书记,甘肃省商务厅厅长、党组书记,甘肃省农村信用社联合社理事长、党委书记,中央汇金投资公司副总经理,中国银河金融控股公司董事长、党委书记,中国银河证券董事长、党委书记等职。

岳志明先生,独立董事,美国哥伦比亚大学工商管理硕士。历任野村证券国际金融部中国部负责人,野村国际(香港)中国投行部总经理、野村中国区首席执行官,美国华平投资集团董事总经理、全球合伙人等职。现任正大光明集团有限公司首席投资官。

胡斌先生,独立董事,特许金融分析师(CFA),美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司Standish Mellon量化分析师、公司副总裁,Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理,梅隆资产管理中国区负责人、纽银梅隆西部基金管理有限公司首席执行官(总经理)等职。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业(有限合伙)总经理。

2、监事会成员

段黎明先生,监事会主席,会计专业硕士、工商管理硕士。历任平安电子商务有限公司财务分析主管、中国平安保险(集团)股份有限公司财务企划部项目负责人、平安集团财务上海分部预算管理室主任、财务管理室主任,平安资产管理有限责任公司财务部负责人、首席财务官等职。现任太平洋资产管理有限责任公司财务部总经理。

Uwe Michel先生,监事,法律硕士。历任慕尼黑Allianz SE亚洲业务部主管、主席办公室主管、Allianz Life Insurance Japan Ltd.主席及日本全国主管、德国慕尼黑Group OPEX安联集团内部顾问主管等职。现任慕尼黑Allianz SE业务部H5投资与亚洲主管。

刘涓女士,职工监事,经济学学士,现任国联安基金管理有限公司运营部副总监。

朱敏菲女士,职工监事,大学本科,现任国联安基金管理有限公司人力综合部资深行政经理。

3、高级管理人员

于业明先生,董事长,经济学博士,高级会计师。历任宝钢集团财务有限责任公司副总经理、常务副总经理、总经理、董事长,华宝信托投资有限责任公司总经理,联合证券有限责任公司总经理,华宝投资有限公司总经理,华宝信托有限责任公司董事长,华宝证券有限责任公司董事长,中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事等职。现任太平洋资产管理有限责任公司党委书记、董事长、总经理,国联安基金管理有限公司董事长。

孟朝霞女士,总经理,经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理、融通基金管理有限公司总经理等职。现任国联安基金管理有限公司总经理。

魏东先生,常务副总经理,首席投资官,经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司;历任华宝兴业基金管理有限公司交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监、国内投资部总经理、国联安基金管理有限公司基金经理、总经理助理、投资总监等职。现任国联安基金管理有限公司常务副总经理并兼任国联安德盛精选混合型证券投资基金、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

李柯女士,副总经理,首席运营官、财务总监、首席信息官,经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部业务经理、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理等职。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

蔡蓓蕾女士,副总经理,首席市场官,经济学博士。历任富国基金管理有限公司产品与营销部副总经理兼零售部副总经理、交银施罗德基金管理有限公司产品总监、泰康资产管理公司公募事业部市场业务负责人等职。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

李华先生,督察长,经济学硕士。历任北京大学经济管理系讲师、广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估有限公司董事长、天一证券有限公司华南业务总部总经理、融通基金管理有限公司监察稽核部总监及监事、新疆前海联合基金管理有限公司督察长等职。现任国联安基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

(1)现任基金经理

高兰君女士,硕士研究生。2011年7月起曾先后在长城证券股份有限公司、泰达宏利基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司担任行业研究员,2017年5月至2019年3月在英大保险资产管理有限公司担任投资经理兼高级研究员。2019年4月加入国联安基金管理有限公司,担任研究部消费小组组长。2019年6月起任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金和国联安锐意成长混合型证券投资基金的基金经理,2019年7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。

(2)历任基金经理

基金经理	担任本基金基金经理时间
韦明亮先生	2015年01月至2015年04月
周平先生	2015年01月至2015年06月
冯俊先生	2015年03月至2017年01月
王超伟先生	2016年02月至2019年06月

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、权益投资部负责人、固定收益部负责人、研究部负责人及高级基金经理组成。投资决策委员会成员为:

权益投资决策委员会成员为:
孟朝霞(总经理)
魏东(常务副总经理)权益投委会主席
邹新进(权益投资部总经理)
杨子江(研究部副总经理)
刘斌(权益投资部副总监、基金经理)
潘明(权益投资部副总监、基金经理)

固定收益投资决策委员会成员为:
孟朝霞(总经理)
魏东(常务副总经理)固收投委会主席
欧阳健(固定收益部总经理兼养老金及FOF投资部总经理)
万莉(现金管理部总经理、基金经理)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理基金份额的发售和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6、编制季度、半年度和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、按照规定召集基金份额持有人大会;
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)法律、法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;

4、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

(五)基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
2、不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益;
3、不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六)基金管理人的内部控制制度

基金管理人内部风险控制包括内部控制机制和内部控制制度两个方面。内部控制机制是指公司的内部组织结构及其相互之间的运行制约关系;内部控制制度是指公司为防范金融风险,保护资产的安全与完整,促进各项经营活动的有效实施而制定的各种业务操作程序、管理方法与控制措施的总称。

1、内部控制的目标

本基金管理人内部控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理公司。具体来说,必须达到以下目标:
(1)严格遵守国家有关法律法规和行业监管规章,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。
(2)健全符合现代企业制度要求的法人治理结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制。
(3)建立行之有效的风险控制系统,确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整。
(4)不断提高经营管理的效率和效益,努力实现公司价值的最大化,圆满完成公司的经营目标和发展战略。

2、内部控制机制的原则

公司完善内部控制机制必须遵循以下原则:
(1)健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
(2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。
(3)独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
(4)相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
(5)成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、公司制订内部控制制度必须遵循以下原则:
(1)合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。
(2)全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节,不得留有制度上的空白或漏洞。
(3)审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。
(4)适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制的基本要求

(1)公司必须依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线:

1)建立以一线岗位为基础的第一道监控防线。各岗位职责明确,有详细的岗位说明书和业务流程,各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守,在授权范围内承担责任。

2)建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,相关部门和岗位之间相互监督制衡。

3)建立以督察长、监察稽核部、风险管理部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长、风险管理部和监察稽核部独立于其他部门,对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

(2) 公司必须建立科学的授权批准制度和岗位分离制度。各业务部门和分支机构必须在适当的授权基础上实行恰当的责任分离制度,直接的操作部门或经办人员和直接的管理部门或控制人员必须相互独立、相互牵制。

(3)公司必须建立完善的岗位责任制度和规范的岗位管理措施。在明确不同岗位的工作任务基础上,赋予各岗位相应的责任和职权,建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制度、严格的操作程序和合理的工作标准,大力推行各岗位、各部门、各机构的目标管理。

(4)公司必须真实、全面地记载每一笔业务,充分发挥会计的核算和监督职能,健全会计、统计、业务等各种信息资料及时、准确报送制度,确保各种信息资料的真实与完整。

(5)公司必须建立严密有效的风险管理系统,包括主要业务的风险评估和监测办法、分支机构和重要部门的风险考核指标体系以及管理人员的道德风险防范系统等。通过严密的风险管理,及时发现内部控制的弱点,以便堵塞漏洞、消除隐患。

(6)公司必须制订切实有效的应急应变措施,设定具体的应急应变步骤。尤其是投资交易等重要部位遇到断电、失火等非常情况时,应急应变措施要及时到位,并按预定功能发挥作用,以确保公司的正常经营不会受到不必要的影响。

5、内部风险控制的内容

公司内部风险控制的主要内容包括:投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、监察稽核控制等。
(1)公司自觉遵守国家有关法律法规,按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册,明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。
(2)公司按照法律、法规和中国证监会有关规定,建立完善的信息披露制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。
(3)公司根据国家法律法规的要求,遵循安全性、实用性、可操作性原则,严格制定信息系统的管理制度。
(4)公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。
(5)公司按照法律、法规和中国证监会有关规定,建立完善的监察稽核控制制度,保证监察稽核部门的独立性和权威性。

6、基金管理人关于内部控制制度的声明
(1)本基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任;
(2)本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;
(3)本基金管理人承诺将根据市场环境的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

三、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:010-67595096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,中国建设银行资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,中国建设银行盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元,增幅6.08%。

2017年,中国建设银行先后荣获香港《亚洲货币》"2017年中国最佳银行",美国《环球金融》"2017最佳转型银行"、新加坡《亚洲银行家》"2017年中国最佳数字银行"、"2017年中国最佳大型零售银行奖"、《银行家》"2017最佳金融创新奖"及中国银行业协会"年度最具社会责任金融机构"等多项重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》"2017全球银行1000强"中列第2位;在美国《财富》"2017年世界500强排行榜"中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续5年获得中债登"优秀资产托管机构"等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"、在2017年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和中国建设银行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1)每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

(3)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

(1)直销机构

名称:国联安基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
法定代表人:于业明
客服电话:021-38784766,400-700-0365(免长途话费)
联系人:黄娜娜
网址:www.cpicfunds.com

(2)其他销售机构

1)名称:中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
电话:010-67596084
联系人:王未雨
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

2)名称:交通银行股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人:彭纯
电话:021-58781234
联系人:王菁
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

3)名称:招商银行股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
电话:0755-83198888
联系人:季平伟
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com

4)名称:中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
电话:010-89937333
联系人:迟卓
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

5)名称:上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海中山东一路12号
办公地址:上海中山东一路12号
法定代表人:高国富
电话:021-61614934
联系人:周志杰
客服电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

6)名称:天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
电话:027-87618882
联系人:翟璟
客服电话:95330
网址:www.tfzq.com

7)名称:东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区星阳街5号
办公地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
电话:0512-65581136
联系人:魏纯
客服电话:95330
网址:www.dwzq.com.cn

8)名称:东海证券股份有限公司
住所:常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-50586660-8644
联系人:霍晓飞
客服电话:95531
网址:www.longone.com.cn

9)名称:光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:周健男
电话:021-52523573
联系人:姚巍
客服电话:95525
网址:www.ebscn.com

10)名称:海通证券股份有限公司
住所:上海市广东路689号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
电话:021-23219275
联系人:李楠
客服电话:95553
网址:www.htsec.com.cn

11)名称:国泰君安证券股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
电话:021-38676666
联系人:朱雅崴
客服电话:95521
网址:www.gtja.com

12)名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
电话:010-60834768
联系人:杜杰
客服电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com

13)名称:德邦证券股份有限公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:武晓春
电话:021-68761616
联系人:刘熠
客服电话:400-8888-128
网址:www.tebon.com.cn

14)名称:中国国际金融股份有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:丁学东
电话:010-65051166
联系人:杨涵宇
客服电话:4009101166
网址:www.cicc.com.cn

15)名称:中山证券有限责任公司
住所:深圳市南山区科技中一路华强高新技术发展大厦7层-8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路华强高新技术发展大厦7-8楼
法定代表人:林炳城
电话:0755-82570586
联系人:罗艺琳
客服电话:95329
网址:www.zszq.com

16)名称:第一创业证券股份有限公司
住所:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼
法定代表人:刘学民
电话:0755-23838776
联系人:王叔胤
客服电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn

17)名称:申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
电话:021-33388254
联系人:陈飙
客服电话:95523,4008895523
网址:www.swhysc.com

18)名称:申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:李琦
电话:0991-2307533
联系人:王怀春
客服电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com

19)名称:兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
电话: 021-38565547
联系人:乔琳雪
客服电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

20)名称:万联证券有限责任公司
住所:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
电话:020-39286026
联系人:甘蕾
客服电话:95322
网址:www.wlzq.com.cn

21)名称:阳光人寿保险股份有限公司
住所:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李科
电话:010-59053660
联系人:王超
客服电话:95510
网址:fund.sinosig.com

22)名称:天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701室
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
电话:010-66045182
联系人:谭磊
客服电话:010-66045678
网址:www.txsec.com

23)名称:上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-20613999
联系人:王诗玙
客服电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

24)名称:上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人:其实
电话:021-54509977
联系人:朱玉
客服电话:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn

25)名称:北京展恒基金销售股份有限公司
住所:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层
法定代表人:闫振杰
电话:010-62020088
联系人:李晓芳
客服电话:400-818-8000
网址:www.myfund.com

26)名称:蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座17楼
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:400-076-6123
网址:www.fund123.cn

27)名称:深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
联系人:童彩平
客服电话:400-678-8887
网址:www.zlfund.cn

28)名称:和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:010-85650628
联系人:刘洋
客服电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com

29)名称:浦领基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人:李招弟
电话:010-59497361
联系人:李艳
客服电话:400-876-9988
网址:www.zscffund.com

30)名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层
法定代表人:张跃伟
联系电话:021-20691832
联系人:胡雪芹
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

31)名称:北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦12层1208号
法定代表人:罗细安
电话:010-67000988
联系人:李皓
客服电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn

32)名称:上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼14楼
法定代表人:李兴春
电话:021-50583533
联系人:郭丹妮
客服电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn

33)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911818
联系人:吴强
客服电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com

34)名称:浙江金观诚基金销售有限公司
住所:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
办公地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
法定代表人:蒋雪琦
电话:0571-88337717
联系人:孙成岩
客服电话:400-068-0058
网址:www.jincheng-fund.com

35)名称:海银基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场6楼B单元
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:刘惠
电话:021-80133828
联系人:徐烨琳
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundhaiyin.com

36)名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人:马勇
电话:010-83363101
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
网址:http://8.jrj.com.cn

37)名称:上海陆金所基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼
法定代表人:王之光
电话:021-20665952
联系人:宁博宇
客服电话:400-821-9031
网址:www.lufunds.com

38)名称:北京虹点基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东门二层
法定代表人:郑毓栋
电话:010-85643600
联系人:姜颖
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com

39)名称:上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
电话:021-52822063
联系人:兰敏
客服电话:400-166-6788
网址:www.66zichan.com

40)名称:一路财富(北京)信息科技股份有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
电话:010-88312877
联系人:徐越
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com

41)名称:珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:020-89629099
联系人:邱湘湘
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn

42)名称:奕丰基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507,0755-89460500
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn

43)名称:深圳市金斧子投资咨询有限公司
住所:广东省深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02
办公地址:广东省深圳市南山区科苑路16号东方科技大厦18楼
法定代表人:赖任军
电话:0755-84034499
联系人:张烨
客服电话:400-930-2888
网址:www.jfzinv.com

44)名称:武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶捷
电话:027-83863742
联系人:陆锋
客服电话:400-027-9899
网址:www.buyfunds.cn

45)名称:上海万得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
电话:021-50712782
联系人:021-50710161
客服电话:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn

46)名称:深圳富济基金销售有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:刘鹏宇
电话:0755-83999907-819
联系人:刘勇
客服电话:0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn

47)名称:北京微动利基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
办公地址:北京市石景山区古城西路113号3层341-342室
法定代表人:梁洪军
电话:010-52609656
联系人:季长军
客服电话:400-188-5687
网址:www.buyforyou.com.cn

48)名称:北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号36层3603室
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室
法定代表人:程刚
电话:010-56176118
联系人:张旭
客服电话:400-100-3391
网址:www.dianyingfund.com

49)名称:北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人:王伟刚
电话:010-62680527
联系人:丁向坤
客服电话:400-619-9059
网址:www.hcjijin.com

50)名称:北京晟视天下投资管理有限公司
住所:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21&28层
法定代表人:蒋煜
电话:400-818-8866
联系人:徐晓荣,刘聪慧
客服电话:010-58170876
网址:www.shengshiview.com.cn

51)名称:上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
电话:021-65370077
联系人:吴鸿飞
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn

52)名称:杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
电话:0571-85267500
联系人:胡璇
客服电话:0571-86655920
网址:www.cd121.com

53)名称:上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
电话:021-63333389
联系人:王哲宇
客服电话:400-643-3389
网址:www.vstonewealth.com

54)名称:深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE
法定代表人:高锋
电话:0755-82880158
联系人:廖嘉琦
客服电话:400-804-8688
网址:www.keynesasset.com

55)名称:贵州华阳众惠基金销售有限公司
住所:贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房
办公地址:贵州省贵阳市云岩区北京路9号君派大厦16楼
法定代表人:程雷
电话:0851-86909950
联系人:陈敏
客服电话:400-839-1818
网址:www.hyzhfund.com

56)名称:北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61840688
联系人:戚晓强
客服电话:400-061-8518
网址:https://danjuanapp.com

57)名称:北京植信基金销售有限公司
住所:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼
法定代表人:于龙
电话:18701358525
联系人:吴鹏
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-ivn.com

58)名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋
法定代表人:汪静波
电话:15618885038
联系人:余翼飞
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

59)名称:北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
电话:15249236571
联系人:陈霞
客服电话:400-898-0618
网址:www.chtfund.com

60)名称:北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO1006-1008
法定代表人:赵荣春
电话:010-57418813
联系人:李超
客服电话:400-893-6885
网址:www.qianjing.com

61)名称:大泰金石基金销售有限公司
住所:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
法定代表人:袁顾明
电话:021-22267943
联系人:朱真卿
客服电话:4009-282-266
网址:www.dtfunds.com

62)名称:中信期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
13层1301-1305、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
13层1301-1305、14层
法定代表人:张皓
电话:021-60833754
联系人:刘宏莹
客服电话:400-990-8826
网址:http://www.citicsf.cn

(二)注册登记机构

名称:国联安基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
法定代表人:于业明
联系人:黄娜娜
电话:021-38992857

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
联系人:陆奇
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:安冬,陆奇

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦5楼
办公地址:中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
首席合伙人:李丹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:钱祎彤
经办会计师:单峰,钱祎彤

五、基金的名称

国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金

六、基金的类型

混合型基金

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资方向

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(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、证券投资基金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的,本基金可参与同业存单的投资,不需召开基金份额持有人大会,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

未来若沪港股票市场交易互联互通机制试点(以下简称"沪港通")正式启动(包括"沪港通"未来任何替代或修正机制的启动)且法律法规或监管机构允许基金通过港股通的机制买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票,本基金可参与港股通股票范围内的香港依法发行上市的股票投资,不需召开基金份额持有人大会,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的0%-95%;债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的5%-100%。其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

九、基金的投资策略

(1)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,综合运用定性和定量的方法,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

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。具体来说,本基金通过以下步骤进行股票选择:

首先,通过ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力,通过WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本;其次,将公司的获利能力和资本成本指标相结合,选择出创造价值的公司;最后,根据公司的成长能力和估值指标,选择股票,构建股票组合。

(3)普通债券投资策略

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有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债。

(4)中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司,信息披露情况相对滞后,对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司,且定向发行方式限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此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。

本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行分类,以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

(5)股指期货投资策略

在股指期货投资上,本基金以避险保值和有效管理为目标,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。

(6)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。

1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素,根据BS模型和溢价率对权证的合理价值做出判断,对价值被低估的权证进行投资;

2)基于对权证标的股票未来走势的预期,充分利用权证的杆杆比率高的特点,对权证进行单边投资;

3)基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断,将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资,或利用权证进行风险对冲。

(7)资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,结合蒙特卡洛模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估其内在价值进行投资。

对于监管机构允许基金投资的其他金融工具,本基金将在谨慎分析收益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资,以降低组合风险,实现基金资产的保值增值。

(8)证券投资基金投资策略

在封闭式基金投资方面,通过投资于剩余期限与集合计划存续期限基本匹配的基金,持有到期,以获取封闭式基金高折价带来的收益。

在开放式基金投资方面,参考本公司对基金管理公司及其管理的基金的研究,将主要投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的新老基金,作为对本基金直接投资证券市场的有效补充。

十、业绩比较基准

沪深300指数×50%+上证国债指数×50%

选择该业绩比较基准,是基于以下原因:

沪深300指数由专业指数提供商"中证指数有限公司"编制和发布,由从上海和深圳证券市场中选取的300只A股作为样本股编制而成。该指数以成份股的可自由流通股数进行加权,指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性和市场影响力。

上证国债指数全称为"上海证券交易所国债指数",是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。其编制方法借鉴了国际成熟市场主流债券指数的编制方法和特点,并充分考虑了国内债券市场发展的现状,具备科学性、合理性、简便性和易于复制等优点。上证国债指数可以表征整个中国国债市场的总体表现。

根据本基金设定的投资范围,基金管理人以50%的沪深300指数和50%的上证国债指数构建的复合指数作为本基金的业绩比较基准,与本基金的投资风格基本一致,可以用来客观公正地衡量本基金的主动管理收益水平。

如果今后法律法规发生变化,或指数编制机构调整或停止该等指数的发布,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、风险收益特征

本基金属于主动式混合型证券投资基金,属于较高预期风险、较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和债券型基金,低于股票型基金。

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日,本报告财务资料未经审计。

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	69,911,357.05	86.62
	其中:股票	69,911,357.05	86.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,995,200.00	7.43
	其中:债券	5,995,200.00	7.43
	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	3,740,048.05	4.63
8	其他各项资产	1,068,439.54	1.32
9	合计	80,715,044.64	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。

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,599,850.00	3.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,308,817.00	55.84
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	3,536,544.00	4.46
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	19,466,146.05	24.53
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,911,357.05	88.11

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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。

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	300347	泰格医药	87,100	6,715,410.00	8.46
2	600763	通策医疗	73,500	6,511,365.00	8.21
3	603288	海天味业	60,000	6,300,000.00	7.94
4	300015	爱尔眼科	201,465	6,239,371.05	7.86
5	600519	贵州茅台	6,243	6,143,112.00	7.74
6	600436	片仔癀	50,700	5,840,640.00	7.36
7	002507	涪陵榨菜	190,000	5,795,000.00	7.30
8	000858	五粮液	41,700	4,918,515.00	6.20
9	300760	迈瑞医疗	29,400	4,798,080.00	6.05
10	600276	恒瑞医药	71,660	4,729,560.00	5.96

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	5,995,200.00	7.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	5,995,200.00	7.56

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	019611	19国债01	60,000	5,995,200.00	7.56

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。

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。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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,没有相关投资政策。

10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

11投资组合报告附注

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没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,040.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,207.70
5	应收申购款	993,191.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,068,439.54

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。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

	基金份额净值增长率①	同期业绩比较基准收益率③	①-③	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差④	②-④
2015-01-26 至 2015-12-31	9.42%	6.81%	2.61%	0.13%	1.24%	-1.11%
2016-01-01 至 2016-12-31	3.35%	-3.64%	6.99%	0.14%	0.70%	-0.56%
2017-01-01 至 2017-12-31	11.15%	10.86%	0.29%	0.41%	0.32%	0.09%
2018-01-01 至 2018-12-31	-28.58%	-10.68%	-17.90%	1.69%	0.67%	1.02%
2019-01-01 至 2019-06-30	45.74%	14.27%	31.47%	1.63%	0.78%	0.85%
2015-01-26 至 2019-06-30	30.83%	16.46%	14.37%	1.00%	0.79%	0.21%

十四、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券/期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、证券/期货账户开户费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述"(一)基金费用的种类中第3-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的律师费、会计师费和信息披露费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人刊登的2019年第1号招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、更新了"三、基金管理人"部分的内容。
2、更新了"五、相关服务机构"部分的内容。
3、更新了"八、基金份额的申购与赎回"部分的内容。
4、更新了"九、基金的投资"部分的内容。
5、更新了"十、基金的业绩"部分的内容。
6、更新了"二十二、其他应披露事项"部分的内容。

国联安基金管理有限公司
二〇一九年九月七日