

**国联安德盛优势混合型证券投资基金**  
**2018 年半年度报告摘要**  
**2018 年 6 月 30 日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

## 1 重要提示

### 1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 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	国联安优势混合	
基金主代码	257030	
交易代码	257030(前端)	257031(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 1 月 24 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	332,831,872.36 份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行的债券，在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，实现基金资产的持续、稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金属于混合型基金，在运作期间，将会结合宏观经济、政策、资金供求、市场波动周期等因素的判断，以及各类证券风险收益特征的相对变化，适度地动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、行业及股票投资策略</p> <p>本基金将优选个股做为投资重点。行业配置是在股票优选的基础之上形成。即我们在构建组合的过程中，会首先优选出具有竞争优势的公司。在此基础上，通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，同时考虑行业的成长性，得出各行业的相对投资价值与投资时机，结合这些行业评估值来确定上述优势公司的配置比例。我们主要对行业经济基本面因素、上市公司基本面因素以及证券市场交易信息这三类相关因素进行分析，最终形成本基金行业的配置。</p> <p>3、个股选择</p> <p>个股的选择的流程如下：</p> <p>（1）通过毛利率，费用指标、资产负债率等财务指标选择出备选库。</p> <p>（2）在备选股的基础上，本公司研究员通过对公司的实地调研及安联的草根研究方法对上市公司的成长性等进行深入的分析构建核心股票库。</p> <p>（3）在核心股票库的基础上通过一系列衡量上市公司的优势指标（如每股资源储量，研发费用占销售收入比等）对投资标的进一步优选，构建本公司的投资组合。</p> <p>总体而言，本基金的投资标的是指那些具备估值潜力又有强大竞争优势的上市公司。</p> <p>4、债券投资</p> <p>本基金将采取“自上而下”投资策略，对各类债券进行合理的配置。本基</p>

	<p>金将深入分析国内外宏观经济形势、国内财政货币政策以及结构调整因素对债券市场的影响，判断债券市场的走势，采取相应的资产配置策略。本基金在债券投资组合构建和管理过程中，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略等积极的投资策略，力求获取高于市场平均水平的投资回报。</p> <p>5、权证投资</p> <p>权证投资的包括两个方面：一是基金经理提出投资要求；二是数量策略研究员提供投资建议。</p> <p>基金经理提出投资权证的要求，相关的数量策略研究员应该根据投资目的进行相关的投资价值分析，作为投资决策的依据。对于作为基础证券备选方案的权证，研究基础证券与权证在风险和收益方面的区别；对于在组合管理层面利用权证调整组合风险收益特征的投资，测算所选权证与投资组合的相关性及其稳定性，并研究此项投资的风险因素等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%
风险收益特征	较高的预期收益和风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	褚怡之	张燕
	联系电话	021-38992807	0755-83199084
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95555
传真		021-50151582	0755-83195201

### 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.cpicfunds.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（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	11,604,675.05
本期利润	-33,871,322.54
加权平均基金份额本期利润	-0.1232

本期基金份额净值增长率	-9.19%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配基金份额利润	0.0795
期末基金资产净值	359,289,808.39
期末基金份额净值	1.079

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
过去一个月	-6.57%	1.56%	-5.26%	0.90%	-1.31%	0.66%
过去三个月	-8.83%	1.22%	-6.57%	0.80%	-2.26%	0.42%
过去六个月	-9.19%	1.17%	-8.28%	0.81%	-0.91%	0.36%
过去一年	-0.59%	0.99%	-1.86%	0.67%	1.27%	0.32%
过去三年	1.80%	1.88%	-11.47%	1.04%	13.27%	0.84%
自基金合同生效起至今	123.62%	1.71%	56.88%	1.26%	66.74%	0.45%

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

国联安德盛优势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

(2007 年 1 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%；

2、本基金基金合同于 2007 年 1 月 24 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，由中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股；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，公司共管理三十七只开放式基金。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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
刘斌	本基金基金经理、兼任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理。	2015-04-28	-	11 年(自 2007 年起)	刘斌,硕士研究生, 2004 年 4 月至 2007 年 8 月在杭州城建设计研究院有限公司担任工程师; 2007 年 9 月至 2009 年 8 月在群益国际控股有限公司担任行业研究员。2009 年 8 月起加入国联安基金管理有限公司, 担任研究员; 2013 年 12 月起至 2015 年 3 月担任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理, 2013 年 12 月起兼任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理, 自 2014 年 2 月起至 2015 年 12 月兼任国联安德盛精选混合型证券投资基金的基金经理, 2014 年 6 月起至 2015 年 12 月兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 4 月起兼任国联安德盛优势混合型证券投资基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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》、《国联安德盛优势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，及时执行交易系统内的公平交易模块；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

2018 年上半年市场出现较大幅度下跌，申万行业指数中位数下跌幅度达 17.7%，上证综指下跌 13.9%，HS300 指数下跌 12.9%，创业板指下跌 8.3%。分月度来看，市场的波动也异常的大，1 月上证指数上涨达 8%，2 月上旬则大幅下跌达 12%，之后便呈现出震荡下跌的态势。截至上半年末仅有休闲服务、医药生物、食品饮料取得了正收益，其余行业指数均呈下跌走势。

考虑到年初房地产、非银金融等行业的估值水平大幅提升，本基金管理人在 1 季度降低了房地产、非银金融等行业的配置，相应的增配了医药、轻工、电力设备等估值与增长匹配度更好的行业。2 季度本基金继续优化调整配置，在季末时又增加了地产和金融业的配置比例，主因是这类品种经历了近半年的大幅调整，其估值与基本面的匹配又一次达到了较好的水平，拥有很高的性价比。

纵观整个上半年的操作，1 季度本基金虽然增加了较多医药股的配置，但表现非常平淡，个股甚至跑输了医药行业指数，但本基金管理人认为这依然符合本基金对组合管理的基本原则，即在控制风险的基础之上寻求合理的回报，且回报周期也不限于季度这样的长度，本基金管理人依然对本基金组合保有足够的信心。

#### 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-9.19%，同期业绩比较基准收益率为-8.28%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国的宏观经济层面新闻不断，银行理财新规、金融系统降杠杆、中美贸易摩擦，每一项都对宏观经济造成了负面的影响，即使如此，上半年 GDP 增速仍维持在 6.7% 的中高水平，经济的韧性可见一斑。对于宏观经济，本基金管理人持乐观态度，经济发展中必然会遇到各种各样的问



题，中国近 40 年的高速发展就是一个不断解决问题和积累经验的过程，未来我们也将能够妥善的处理发展中的各种问题，最重要的是我们要看到我们的生产率与目前世界先进水平相比仍有很大的发展空间，这是未来最重要的机遇所在。

从中观的角度看，中国的大多数行业都在从量向质的方向转变，过去很多行业规模增长快，各类层次不齐的企业都获得了发展的机会，而近几年里各行各业的规模增长都在减速，有些行业规模甚至已经开始收缩，相应的企业之间的经营能力高下立现，行业头部公司市占率快速提升，本基金管理人认为这个趋势刚刚开始，也只有行业集中度大幅提高，规模优势持续扩大的时候，研发占比才能继续提升，我们的企业也才能真正的脱胎换骨从简单制造业走向研发推动的高技术企业，这也是投资人所乐见的，或许我们寻觅已久的长期投资机会现在正在显现。

短期看，经历了上半年的大幅下跌，市场的估值水平又到了历史较低分位水平，部分行业估值则创出了新低，当然不同时期的基本面是不同的，简单的比较估值并不可取，需要具体问题具体对待，但整体上本基金管理人认为目前的市场已然呈现出了较好的投资机会，从年度这样的时间周期来看，是非常值得重视的。

本基金管理人一如既往地看好消费升级和工业升级类相关行业的投资机会，尤其是行业的头部公司，这会成为本基金管理人未来很长时间内研究和发掘重点。

#### 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，本基金对本报告期内利润分配情况如下，符合本基金基金合同的相关规定。

本基金以截止至 2017 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准，于 2018 年 6 月 28 日实施分红，向截止至 2018 年 6 月 27 日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额

持有人，按每 10 份基金份额 0.55 元派发红利。共发放红利 17,807,654.85 元。

#### 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

托管人声明：在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 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：国联安德盛优势混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	56,327,544.82	31,711,864.43
结算备付金	386,056.14	10,444,524.60
存出保证金	272,732.35	509,409.71

交易性金融资产	302,195,635.86	345,618,585.60
其中：股票投资	287,463,635.86	345,119,335.60
基金投资	-	-
债券投资	14,732,000.00	499,250.00
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	-	-
应收证券清算款	7,807,306.06	1,138,758.89
应收利息	174,146.25	41,790.02
应收股利	-	-
应收申购款	14,455.01	22,644.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>367,177,876.49</b>	<b>389,487,577.25</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	-	-
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	6,852,512.75	-
应付赎回款	38,572.38	1,377,195.24
应付管理人报酬	434,413.47	1,111,281.63
应付托管费	72,402.23	185,213.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	304,193.62	2,356,664.19
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	185,973.65	378,370.49
<b>负债合计</b>	<b>7,888,068.10</b>	<b>5,408,725.15</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	332,831,872.36	307,866,502.58
未分配利润	26,457,936.03	76,212,349.52
<b>所有者权益合计</b>	<b>359,289,808.39</b>	<b>384,078,852.10</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>367,177,876.49</b>	<b>389,487,577.25</b>

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.079 元，基金份额总额 332,831,872.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安德盛优势混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>-29,859,125.40</b>	<b>27,932,961.11</b>
1.利息收入	407,634.38	126,360.68
其中：存款利息收入	105,145.07	126,360.68
债券利息收入	302,489.31	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	15,144,886.39	10,651,197.93
其中：股票投资收益	11,812,223.89	8,513,074.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-250.00	-
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	3,332,912.50	2,138,123.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-45,475,997.59	17,149,265.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	64,351.42	6,137.39
<b>减：二、费用</b>	<b>4,012,197.14</b>	<b>3,640,869.91</b>
1. 管理人报酬	2,517,726.74	2,316,624.28
2. 托管费	419,621.12	386,104.02
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	885,148.74	749,827.71
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7. 其他费用	189,700.54	188,313.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-33,871,322.54</b>	<b>24,292,091.20</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-33,871,322.54</b>	<b>24,292,091.20</b>

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：国联安德盛优势混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	307,866,502.58	76,212,349.52	384,078,852.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,871,322.54	-33,871,322.54
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）	24,965,369.78	1,924,563.90	26,889,933.68
其中：1.基金申购款	74,844,338.58	15,745,107.03	90,589,445.61
2.基金赎回款	-49,878,968.80	-13,820,543.13	-63,699,511.93
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）	-	-17,807,654.85	-17,807,654.85
五、期末所有者权益（基金净值）	332,831,872.36	26,457,936.03	359,289,808.39
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	245,872,050.91	64,350,142.32	310,222,193.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,292,091.20	24,292,091.20
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）	21,819,562.70	8,867,739.59	30,687,302.29
其中：1.基金申购款	41,279,780.40	14,922,300.13	56,202,080.53
2.基金赎回款	-19,460,217.70	-6,054,560.54	-25,514,778.24
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）	267,691,613.61	97,509,973.11	365,201,586.72

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

国联安德盛优势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)(原“国联安德盛优势股票证券投资基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意德盛优势股票证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]223 号文)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》等相关法规和《德盛优势股票证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2007 年 1 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 4,462,883,026.84 份基金份额。根据《国联安基金管理有限公司关于旗下五只基金变更基金名称的公告》，自 2015 年 8 月 8 日起，“国联安德盛优势股票证券投资基金”更名为“国联安德盛优势混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《德盛优势混合型证券投资基金基金合同》和《国联安德盛优势混合型证券投资基金招募说明书(更新)》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。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票资产占基金资产的 60%-90%；债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的 10%-40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况、2018 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

##### 主要税项说明

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e)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。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

## 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

本报告期内，本基金管理人原控股股东国泰君安证券股份有限公司已将其所持有的公司 51%股权转让给太平洋资产管理有限责任公司。截至 2018 年 5 月 4 日，本基金管理人已正式完成上海市工商局变更登记，变更其控股股东为太平洋资产管理有限责任公司。同时，本基金管理人新增关联方：中国太平洋保险(集团)股份有限公司，为本基金管理人的最终控制人。

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方无变化。

### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东（截止至 2018 年 5 月 3 日）
安联集团	基金管理人的股东
太平洋资产管理有限责任公司	基金管理人的股东（自 2018 年 5 月 4 日起）



中国太平洋保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控制人（自 2018 年 5 月 4 日起）
-------------------	--------------------------------

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

如在报表附注 6.4.7.1 中所述，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，太平洋资产管理有限责任公司和中国太平洋保险(集团)股份有限公司属于本基金的关联方。本半年度报告所披露的与国泰君安证券股份有限公司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、中国太平洋保险(集团)股份有限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，本基金与关联方无股票交易。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

###### 6.4.8.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

###### 6.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

###### 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，本基金无应支付关联方的佣金。

##### 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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日

当期发生的基金应支付的管理费	2,517,726.74	2,316,624.28
其中：支付销售机构的客户维护费	357,427.20	386,699.67

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	419,621.12	386,104.02

注：支付基金托管人招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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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
招商银行股份有限公司	56,327,544.82	95,937.98	46,295,477.37	122,176.54

注：1.本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

2.本基金通过“招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 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 386,056.14 元。(2017 年 6 月 30 日余额:人民币 278,013.31 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（2018 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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股待上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股待上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股待上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603156	养元饮品	2018-02-02	2019-02-12	新股锁定	78.73	54.86	52,804	2,969,459.41	2,896,827.44	本基金持有的流通受限股票养元饮品，于 2018 年 5 月 8 日实施 2017

										<p>年年度权益分派方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 26.00 元 (含税)；同时，每 10 股派送红股 4 股。本基金于 2018 年 2 月 2 日成功认购 37,717 股，本次派送新增 15,087 股，派送后共持有 52,804 股。</p>
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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 2018 年 6 月 30 日止，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为 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 2018 年 6 月 30 日止，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	287,463,635.86	78.29
	其中：股票	287,463,635.86	78.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,732,000.00	4.01
	其中：债券	14,732,000.00	4.01
	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	56,713,600.96	15.45

8	其他各项资产	8,268,639.67	2.25
9	合计	367,177,876.49	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	167,949,349.87	46.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,780,000.00	3.00
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	14,220,000.00	3.96
J	金融业	19,482,000.00	5.42
K	房地产业	57,787,500.00	16.08
L	租赁和商务服务业	11,520,000.00	3.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,653,226.14	1.57
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	287,463,635.86	80.01

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 7.2.2 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股票投资。

## 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002572	索菲亚	650,000	20,917,000.00	5.82
2	600048	保利地产	1,650,000	20,130,000.00	5.60
3	000002	万科A	750,000	18,450,000.00	5.14
4	002475	立讯精密	700,000	15,778,000.00	4.39
5	002223	鱼跃医疗	800,000	15,592,000.00	4.34
6	600196	复星医药	350,000	14,486,500.00	4.03
7	600406	国电南瑞	900,000	14,220,000.00	3.96
8	300285	国瓷材料	600,000	11,964,000.00	3.33
9	600584	长电科技	700,000	11,858,000.00	3.30
10	601166	兴业银行	800,000	11,520,000.00	3.21
11	002707	众信旅游	1,200,000	11,520,000.00	3.21

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002223	鱼跃医疗	16,767,791.00	4.37
2	000002	万科A	16,338,932.20	4.25
3	600196	复星医药	16,191,374.60	4.22
4	600406	国电南瑞	15,629,264.00	4.07
5	600511	国药股份	15,514,239.00	4.04
6	002456	欧菲科技	12,926,323.44	3.37
7	002191	劲嘉股份	12,824,395.98	3.34
8	002707	众信旅游	12,769,233.96	3.32
9	001979	招商蛇口	11,967,175.00	3.12
10	600690	青岛海尔	10,417,557.00	2.71
11	002146	荣盛发展	10,383,614.49	2.70
12	000538	云南白药	10,061,035.00	2.62
13	000776	广发证券	9,868,806.00	2.57
14	002585	双星新材	9,460,638.52	2.46
15	601877	正泰电器	8,845,639.44	2.30
16	600048	保利地产	8,477,375.00	2.21

17	601818	光大银行	8,092,000.00	2.11
18	603019	中科曙光	6,672,158.00	1.74
19	002373	千方科技	6,336,878.25	1.65
20	600567	山鹰纸业	6,305,000.00	1.64

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	28,460,240.00	7.41
2	600016	民生银行	21,632,557.00	5.63
3	600048	保利地产	20,883,024.00	5.44
4	603816	顾家家居	20,444,616.00	5.32
5	601318	中国平安	19,048,809.47	4.96
6	300124	汇川技术	17,695,599.00	4.61
7	002293	罗莱生活	15,980,738.14	4.16
8	000725	京东方 A	15,429,400.00	4.02
9	000910	大亚圣象	14,671,156.00	3.82
10	601766	中国中车	14,438,456.40	3.76
11	601166	兴业银行	13,922,483.00	3.62
12	603707	健友股份	13,169,250.90	3.43
13	002341	新纶科技	9,214,228.00	2.40
14	002572	索菲亚	8,107,350.00	2.11
15	601818	光大银行	7,788,000.00	2.03
16	002585	双星新材	7,754,208.60	2.02
17	603111	康尼机电	7,742,121.08	2.02
18	600388	龙净环保	7,514,062.00	1.96
19	603019	中科曙光	5,745,833.00	1.50
20	002373	千方科技	5,691,886.00	1.48

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	279,284,368.90
卖出股票的收入（成交）总额	302,456,285.34

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	----------



			例(%)
1	国家债券	1,022,000.00	0.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,710,000.00	3.82
	其中：政策性金融债	13,710,000.00	3.82
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	14,732,000.00	4.10

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 7.6 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	占基金资产净值比例(%)
1	018003	国开 1401	120,000	13,710,000.00	3.82
2	010107	21 国债(7)	10,000	1,022,000.00	0.28

#### 7.7 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。

#### 7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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股指期货，没有相关投资政策。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	272,732.35
2	应收证券清算款	7,807,306.06
3	应收股利	-
4	应收利息	174,146.25
5	应收申购款	14,455.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,268,639.67

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
6,106	54,508.99	94,604,472.35	28.42%	238,227,400.01	71.58%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	20,502.19	0.01%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 1 月 24 日）基金份额总额	4,462,883,026.84
本报告期期初基金份额总额	307,866,502.58
本报告期基金总申购份额	74,844,338.58
减：本报告期基金总赎回份额	49,878,968.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	332,831,872.36

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。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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、2018 年 4 月 27 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变更公告》，于业明先生担任公司董事长及法定代表人，庾启斌先生不再担任公司董事长及法定代表人。

2、2018 年 4 月 27 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司董事、独立董事变更公告》，于业明先生、杨一君先生、Jiachen Fu 女士和 Eugen Loeffler 先生担任公司第五届董事会董事，公司总经理孟朝霞女士继续担任公司第五届董事会董事；贝多广先生、岳志明先生担任公司第五届董事会独立董事，胡斌先生继续担任公司第五届董事会独立董事。庾启斌先生、汪卫杰先生不再担任本公司董事；程静萍女士不再担任本公司独立董事。

3、2018 年 3 月 30 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，刘轶先生不再担任公司督察长职务，由总经理孟朝霞女士代行督察长职务。

4、2018 年 4 月 28 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，满黎先生不再担任公司副总经理职务。

5、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

### 10.5 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1.本报告期内，中国证券监督管理委员会上海监管局就现场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，本基金管理人高度重视，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监督管理委员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没有受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	206,207,916.42	35.74%	187,917.42	35.36%	-
联讯证券股份有限公司	1	151,409,979.03	26.24%	141,007.85	26.53%	-
中国银河证券股份有限公司	1	117,730,164.16	20.40%	109,642.08	20.63%	-
华泰证券股份有限公司	1	57,238,121.94	9.92%	52,161.19	9.81%	-
国金证券有限责任公司	1	29,240,467.25	5.07%	26,647.05	5.01%	-
申万宏源证券有限公司	1	12,161,138.58	2.11%	11,325.73	2.13%	-
中信建投证券股份有限公司	2	2,999,360.90	0.52%	2,793.32	0.53%	-

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择标准

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、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、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，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同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 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- 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资讯。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。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、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的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元新增：联讯证券 39937。

## 10.7.2 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

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	1,012,891.00	7.03%	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	13,399,099.40	92.97%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2018 年 5 月 4 日发布公告，经本基金管理人股东会第五十五次会议决议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2018]557 号），本基金管理人原股东国泰君安证券股份有限公司将所持 51%股权转让给太平洋资产管理有限责任公司。上述事项涉及的相关工商变更登记等事宜，已按规定办理完毕。变更后，本基金管理人的股东为太平洋资产管理有限责任公司和安联集团。

国联安基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日