

国联安德盛小盘精选证券投资基金
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：中国工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

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 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	国联安小盘精选混合
基金主代码	257010
交易代码	257010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 4 月 12 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	972,158,229.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是一只积极成长型股票基金，专注投资于中国 A 股市场上具有成长潜力的小盘股。基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验，在严格的风险控制机制下，采用积极主动的投资策略，通过多角度、多层次的基本面研究，充分发掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会，并通过波段操作的择时策略追求较高的资本利得收益，从而实现投资者资产的长期增值。
投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次：第一个层次是自下而上的证券选择。总体上说，对于本基金的投资重点——小盘股而言，将采取自下而上的方式，综合使用数量化的金融工程模型、科学严谨的财务分析和深入的上市公司调研与独特的草根研究等多种手段精选个股，并在此基础上构建股票投资组合。第二个层次是资产类别配置层面的风险管理，即对基金资产在股票、债券和现金三大资产类别间的配置进行实时监控，并根据当时的宏观经济形势和证券市场行情调整资产配置比例，达到控制基金风险的目的。总之，本基金在投资管理的每一个层次都将定性研究和量化分析有机地结合起来，从而保证投资决策的科学性与风险收益结构的最优性。
业绩比较基准	$(\text{天相小盘股指数} \times 60\% + \text{天相中盘股指数} \times 40\%) \times 60\% + \text{上证国债指数} \times 40\%$
风险收益特征	本基金是一只积极成长型的股票基金，由于其股票投资组合以小盘股为主，本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。

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	姓名	褚怡之	郭明

负责人	联系电话	021-38992807	010-66105798
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95588
传真		021-50151582	010-66105799

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	41,442,267.15
本期利润	-153,629,416.35
加权平均基金份额本期利润	-0.1556
本期基金份额净值增长率	-14.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0454
期末基金资产净值	928,016,613.31
期末基金份额净值	0.955

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	-5.91%	1.36%	-5.74%	1.04%	-0.17%	0.32%
过去三个月	-9.22%	1.08%	-7.99%	0.79%	-1.23%	0.29%
过去六个月	-14.12%	1.11%	-9.09%	0.80%	-5.03%	0.31%
过去一年	-3.92%	0.97%	-9.17%	0.67%	5.25%	0.30%
过去三年	-14.68%	1.52%	-21.85%	1.07%	7.17%	0.45%
自基金合同生效起至今	396.48%	1.39%	191.33%	1.14%	205.15%	0.25%

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

国联安德盛小盘精选证券投资基金

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

(2004 年 4 月 12 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为（天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%）×60%+上证国债指数×40%；

2、本基金基金合同于 2004 年 4 月 12 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外，其他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		
邹新进	本基金基金经理、兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、权益投资部总监。	2010-03-06	-	14 年(自 2004 年起)	邹新进先生, 硕士。于 2004 年 7 月加盟中信建投证券有限责任公司(前身为华夏证券有限责任公司)任分析师。2007 年 7 月加入国联安基金管理有限公司, 历任高级研究员、基金经理助理; 现担权益投资部总监。2010 年 3 月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理。2012 年 2 月至 2013 年 4 月兼任国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月起兼任国联安安稳灵活配置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》、《国联安德盛小盘精选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 年上半年市场整体呈疲软态势。1 月份市场延续 2017 年走势，大盘蓝筹处于继续亢奋的状态；2 月份国内外风险事件频发，导致市场整体大跌，特别是 5 月下旬之后，随着债券违约事件频发等情况导致资金面相对比较紧张，加上中美贸易摩擦加剧，整体市场情绪急转直下，大盘连续下探低点。但结构上则分化巨大，大消费类板块由于预期稳定成为市场资金的避难所，相对抗跌；而与资金、杠杆等相关的重资产行业以及大部分中小市值公司股价则大幅下挫。

本基金报告期内在仓位上基本不变。在行业配置上，本基金主要按照年初的投资思路以稳定的医药板块为主，并较大力度的参与了集中度提升的家居、地产、农化等板块，并适度配置了低估值的周期类板块。由于本基金合同对于大市值股票比例的限制，在本报告期内操作难度较大，基金报告期内收益一般。

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-14.12%，同期业绩比较基准收益率为-9.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金管理人认为有两点值得关注：一是宏观经济是否能继续企稳；二是改革措施（包括资本市场）的实质性实施：如新政府对于改革的部署等。

本基金管理人认为，由于宏观经济数据尚可，同时目前市场所处位置已经较低，预计继续下跌空间有限，但上半年影响市场的两大因素（去杠杆、严监管和中美贸易战）若不出现明显好转，将压制市场整体反弹空间，直到四中全会前期。

在行业配置上，本基金管理人从性价比的角度出发，重点以稳定的医药板块为主；并较大力度地提升家居、地产、农化等板块以及新材料等新兴板块的配置；另外，将适时适度配置部分低估值的周期类板块。

本基金管理人坚信，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，本基金管理人将努力为基金份额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。

4.6 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小盘精选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，国联安德盛小盘精选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小盘精选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，国联安德盛小盘精选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小盘精选证券投资基金 2018 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：国联安德盛小盘精选证券投资基金

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	1,801,031.89	7,822,462.85
结算备付金	636,831.27	1,162,258.94
存出保证金	177,715.84	263,868.28
交易性金融资产	924,085,751.51	1,067,289,257.45
其中：股票投资	692,543,282.27	832,956,860.43
基金投资	-	-
债券投资	231,542,469.24	234,332,397.02
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	-	49,500,194.25
应收证券清算款	2,692,340.45	1,179,441.58
应收利息	1,782,397.76	4,268,031.14
应收股利	-	-
应收申购款	60,757.17	52,497.05
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	931,236,825.89	1,131,538,011.54
负债和所有者权益	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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	-	1,529,598.98
应付赎回款	215,675.40	2,140,764.64
应付管理人报酬	1,186,154.13	1,484,733.32
应付托管费	197,692.34	247,455.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	288,032.22	579,670.10
应交税费	1,134,125.21	1,132,463.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,533.28	400,741.44
负债合计	3,220,212.58	7,515,427.62
所有者权益：	-	-
实收基金	972,158,229.40	1,011,076,874.67
未分配利润	-44,141,616.09	112,945,709.25
所有者权益合计	928,016,613.31	1,124,022,583.92
负债和所有者权益总计	931,236,825.89	1,131,538,011.54

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.955 元，基金份额总额 972,158,229.40 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安德盛小盘精选证券投资基金

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	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
一、收入	-143,008,946.65	1,953,907.00
1.利息收入	3,334,196.43	5,005,600.23
其中：存款利息收入	111,757.72	124,515.23
债券利息收入	3,127,451.00	4,711,096.12
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	94,987.71	169,988.88
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	48,710,619.45	-8,792,432.17
其中：股票投资收益	42,560,982.70	-14,846,016.69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-400,970.52	-705,492.39
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	6,550,607.27	6,759,076.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-195,071,683.50	5,429,622.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	17,920.97	311,116.54
减：二、费用	10,620,469.70	13,753,617.09
1. 管理人报酬	7,779,205.76	10,065,905.50
2. 托管费	1,296,534.31	1,677,650.90
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,335,634.40	1,780,164.51
5. 利息支出	-	22,007.90
其中：卖出回购金融资产支出	-	22,007.90
6.税金及附加	1,412.95	-
7. 其他费用	207,682.28	207,888.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-153,629,416.35	-11,799,710.09
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-153,629,416.35	-11,799,710.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安德盛小盘精选证券投资基金

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	1,011,076,874.67	112,945,709.25	1,124,022,583.92

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-153,629,416.35	-153,629,416.35
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)	-38,918,645.27	-3,457,908.99	-42,376,554.26
其中: 1.基金申购款	12,542,047.16	801,451.87	13,343,499.03
2.基金赎回款	-51,460,692.43	-4,259,360.86	-55,720,053.29
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)	972,158,229.40	-44,141,616.09	928,016,613.31
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)	1,361,512,053.00	59,520,278.86	1,421,032,331.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,799,710.09	-11,799,710.09
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)	-97,283,556.39	-6,289,336.92	-103,572,893.31
其中: 1.基金申购款	168,496,969.14	6,658,916.66	175,155,885.80
2.基金赎回款	-265,780,525.53	-12,948,253.58	-278,728,779.11
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)	-	-49,643,051.55	-49,643,051.55
五、期末所有者权益(基金净值)	1,264,228,496.61	-8,211,819.70	1,256,016,676.91

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

国联安德盛小盘精选证券投资基金(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”)《关于同意德盛小盘精选证券投资基金设立的批复》(证监基金字 [2004] 19 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》及其配套规则和《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2004 年 4 月 12 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 8,324,975,786.82 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》和《国联安德盛小盘精选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 20%-75%; 债券资产 20%-65%; 现金类资产 5%-15%。本基金的业绩比较基准为: $(60% \times \text{天相小盘股指数} + 40% \times \text{天相中盘股指数}) \times 60% + \text{上证国债指数} \times 40%$ 。

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 年上半年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

(1)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。

(2)应交税费 (元)

	2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
应交增值税	1,483.58	-
应交城市维护建设税	103.85	-
应交教育费附加及地方教育费附加	74.18	-
债券利息收入所得税	1,132,463.60	1,132,463.60

债券利息收入所得税是基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人
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)
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
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	7,779,205.76	10,065,905.50
其中：支付销售机构的客户维护费	1,036,078.51	912,302.35

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	1,296,534.31	1,677,650.90

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自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		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
工商银行	1,801,031.89	100,630.28	21,686,619.90	107,924.95

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计算。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 2018 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 636,831.27 元。(2017 年 6 月 30 日:人民币 874,522.06 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
300713	英可瑞	2017-10-23	2018-11-01	新股锁定	40.29	39.07	12,614	282,352.32	492,828.98	本基金持有的流通受限股票英可瑞，于 2018 年 6 月 19 日实施 2017 年年度权益分派方案，向全体股东每 10 股派发现金红利人民

										币 1.0000 00 元 (含税) , 同 时, 以资 本公 积金 向全 体股 东每 10 股 转增 8.0000 00 股。 本基 金于 2017 年 10 月 23 日 成功 认购 7,008 股, 本次 转增 新增 5,606 股, 转增 后共 持有 12,614 股。
60310 5	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	-
60369 3	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	-
60370 6	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 年年度权益分派方案，向全体股东每股派发现金红利人民币 2.60 元（含税），每股派送红股 0.4 股。本基金于 2018 年 2 月 2 日成功认购 37,717 股，
--------	------	------------	------------	------	-------	-------	--------	--------------	--------------	---

										本次派送红股 15,087 股，分配后共持有 52,804 股。
002892	科力尔	2017-08-10	2018-08-17	新股锁定	17.56	29.90	11,000	193,160.00	328,900.00	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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 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 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	692,543,282.27	74.37
	其中：股票	692,543,282.27	74.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	231,542,469.24	24.86
	其中：债券	231,542,469.24	24.86
	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	2,437,863.16	0.26
8	其他各项资产	4,713,211.22	0.51
9	合计	931,236,825.89	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	67,479,150.00	7.27
C	制造业	333,837,532.12	35.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	186,250,152.50	20.07
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	20,223,000.00	2.18

K	房地产业	56,280,661.66	6.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	28,401,226.14	3.06
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	692,543,282.27	74.63

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	600511	国药股份	2,334,300	62,909,385.00	6.78
2	000028	国药一致	1,115,005	55,638,749.50	6.00
3	600337	美克家居	7,700,000	45,122,000.00	4.86
4	000639	西王食品	3,046,000	39,080,180.00	4.21
5	000910	大亚圣象	2,164,747	36,584,224.30	3.94
6	000671	阳光城	5,986,878	35,741,661.66	3.85
7	600123	兰花科创	4,995,000	34,815,150.00	3.75
8	600380	健康元	2,900,000	34,394,000.00	3.71
9	000513	丽珠集团	725,011	31,864,233.45	3.43
10	600486	扬农化工	561,900	31,427,067.00	3.39

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	000910	大亚圣象	38,052,942.15	3.39
2	002022	科华生物	24,260,968.40	2.16
3	000671	阳光城	23,883,429.14	2.12
4	601168	西部矿业	18,999,070.00	1.69
5	600019	宝钢股份	18,722,000.00	1.67
6	000400	许继电气	17,989,868.82	1.60
7	000001	平安银行	17,556,000.00	1.56
8	601818	光大银行	17,030,000.00	1.52
9	600486	扬农化工	16,918,793.10	1.51
10	600713	南京医药	16,125,252.00	1.43
11	000902	新洋丰	13,985,017.00	1.24
12	002572	索菲亚	13,510,254.16	1.20
13	002191	劲嘉股份	13,232,796.00	1.18
14	002643	万润股份	11,480,113.83	1.02
15	002159	三特索道	11,159,504.00	0.99
16	300054	鼎龙股份	10,426,554.40	0.93
17	000060	中金岭南	10,385,654.00	0.92
18	601155	新城控股	10,174,666.00	0.91
19	600567	山鹰纸业	10,077,478.90	0.90
20	600380	健康元	7,594,657.00	0.68

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	002714	牧原股份	78,849,951.00	7.01
2	300054	鼎龙股份	24,323,433.00	2.16
3	000513	丽珠集团	22,917,381.65	2.04
4	600581	八一钢铁	21,866,589.00	1.95
5	600782	新钢股份	20,278,444.00	1.80
6	600123	兰花科创	17,571,124.34	1.56
7	601818	光大银行	16,376,202.61	1.46
8	603686	龙马环卫	15,331,407.46	1.36
9	300335	迪森股份	12,369,383.41	1.10
10	002157	正邦科技	10,498,206.00	0.93
11	600997	开滦股份	10,449,447.04	0.93
12	600019	宝钢股份	10,412,000.00	0.93
13	601600	中国铝业	10,148,000.00	0.90
14	300197	铁汉生态	9,811,344.53	0.87

15	000060	中金岭南	9,554,187.20	0.85
16	600266	北京城建	8,454,963.36	0.75
17	300426	唐德影视	8,104,548.20	0.72
18	600376	首开股份	8,003,710.00	0.71
19	002385	大北农	7,904,079.50	0.70
20	002573	清新环境	6,877,712.44	0.61

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	449,918,159.92
卖出股票的收入（成交）总额	440,500,182.24

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	44,005,366.00	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	56,599,894.60	6.10
	其中：政策性金融债	56,599,894.60	6.10
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）	130,937,208.64	14.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	231,542,469.24	24.95

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	018005	国开 1701	420,670	42,226,854.60	4.55
2	132009	17 中油 EB	326,160	31,754,937.60	3.42
3	127005	长证转债	290,554	27,591,007.84	2.97
4	132013	17 宝武 EB	275,000	27,541,250.00	2.97
5	010107	21 国债(7)	236,530	24,173,366.00	2.60

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。

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	177,715.84
2	应收证券清算款	2,692,340.45
3	应收股利	-
4	应收利息	1,782,397.76
5	应收申购款	60,757.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,713,211.22

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	21,205,789.80	2.29
2	128024	宁行转债	17,783,700.00	1.92
3	128022	众信转债	5,060,523.40	0.55

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
20,353	47,764.86	50,580,768.35	5.20%	921,577,461.05	94.80%

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	1,083,710.67	0.11%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年4月12日）基金份额总额	8,324,975,786.82
本报告期期初基金份额总额	1,011,076,874.67
本报告期基金总申购份额	12,542,047.16
减：本报告期基金总赎回份额	51,460,692.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	972,158,229.40

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.本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
浙商证券股份有限公司	1	30,330,197.84	3.43%	27,639.87	3.40%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	13,371,115.65	1.51%	12,185.08	1.50%	-

股份有限公司						
海通证券股份 有限公司	2	7,921,896.00	0.89%	7,377.59	0.91%	-
平安证券股份 有限公司	1	213,494,367.10	24.11%	198,829.50	24.42%	-
招商证券股份 有限公司	1	423,778,902.67	47.87%	386,189.11	47.44%	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	1,968,550.00	0.22%	1,833.32	0.23%	-
国信证券股份 有限公司	1	1,283,686.50	0.14%	1,195.55	0.15%	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	140,629,240.66	15.88%	130,966.55	16.09%	-
中银国际证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	52,555,339.02	5.94%	47,893.76	5.88%	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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

本报告期内，中银国际证券有限责任公司更名为中银国际证券股份有限公司。

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
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	143,984,756. 18	52.78%	150,000,0 00.00	83.33%	-	-
招商证券股份 有限公司	56,833,623.0 6	20.83%	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	2,230,762.80	0.82%	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	4,918,887.88	1.80%	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	64,848,441.2 3	23.77%	30,000,00 0.00	16.67%	-	-
中银国际证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 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