

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金
2018 年半年度报告
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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.4 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.....	44
9 开放式基金份额变动.....	44
10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金		
基金简称	国联安双禧中证 100 指数分级		
场内简称	双禧 100		
基金主代码	162509		
交易代码	162509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 4 月 16 日		
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		
报告期末基金份额总额	134,615,987.88 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2010 年 6 月 18 日		
下属分级基金的基金简称	国联安双禧 A 中 证 100 指数	国联安双禧 B 中 证 100 指数	国联安双禧中证 100 指数
下属分级基金的场内简称	中证 100A	中证 100B	双禧 100
下属分级基金的交易代码	150012	150013	162509
报告期末下属分级基金的份额总额	43,878,956.00 份	65,818,434.00 份	24,918,597.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中证 100 指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p>
业绩比较基准	95%×中证 100 指数收益率+5%×活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
下属分级基金的风险	中证 100A：低风险低 中证 100B：高风险高 双禧 100：本基金为被

收益特征	收益。	收益。	动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
------	-----	-----	--

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	褚怡之	田青
	联系电话	021-38992807	010-67595096
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		于业明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及深交所网站
登载基金半年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

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	2,405,230.94
本期利润	-19,461,785.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1403
本期加权平均净值利润率	-10.53%
本期基金份额净值增长率	-10.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	41,414,559.40
期末可供分配基金份额利润	0.3076
期末基金资产净值	161,413,006.14
期末基金份额净值	1.199
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	34.49%

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	-5.66%	1.17%	-6.40%	1.19%	0.74%	-0.02%
过去三个月	-7.77%	1.10%	-8.22%	1.12%	0.45%	-0.02%
过去六个月	-10.92%	1.13%	-11.17%	1.16%	0.25%	-0.03%
过去一年	0.25%	0.94%	-0.13%	0.96%	0.38%	-0.02%
过去三年	-9.90%	1.40%	-9.91%	1.36%	0.01%	0.04%
自基金合同生效起至今	34.49%	1.40%	12.38%	1.40%	22.11%	0.00%

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

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金
 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
 (2010 年 4 月 16 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率 (税后)}$ ；

2、本基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，2010 年 10 月 15 日建仓期结束当日除股票投资比例略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、本基金于 2010 年 6 月 18 日已基本建仓完毕，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值 90%，其他各项资产配置比例自该日起均符合基金合同的约定。由于 2010 年 10 月 15 日有连续大额申购从而导致股票投资比例当日被动未达标，本基金已于 2010 年 10 月 20 日及时调整完毕；

4、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		
黄欣	本基金基金经理、兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理、国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理、国联安添鑫灵活配置配置混合型证券投资基金基金经理。	2010-04-16	-	16 年（自 2002 年起）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士。2003 年 10 月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 4 月起担任国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金经理，2010 年 5 月至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 3 月起兼任国联安添鑫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》、《国联安双禧中证 100 指数分级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

2018 年上半年，宏观经济形势多变，金融去杠杆继续进行中，中美之间的贸易战不断升级且超出市场预期。股市先扬后抑，整体呈现下跌状态，大盘蓝筹股表现相对较好。从整个上半年来看，沪深 300 指数下跌 12.9%，中证 100 指数下跌 11.77%，而中小板综指下跌 16.30%。从本基金的各个板块表现来看，上半年医药、家电、食品饮料等行业表现较好，证券、通讯等行业表现较差。

依据基金合同的约定，本基金始终保持较高的仓位，采用完全复制的方法跟踪中证 100 指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.199 元，本报告期份额净值增长率为-10.92%，同期业绩比较基准收益率为-11.17%。本报告期内，日均跟踪偏离度绝对值为 0.04%，年化跟踪误差为 0.94%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，以及年化跟踪误差不超过 4.0%的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，美国经济呈现出较强的复苏态势，但中美之间的贸易摩擦问题给全球的宏观经济带来较大的不确定性。经过上半年的回调，整个 A 股的估值水平已经下降，释放了较大的风险。随着经济复苏，本基金管理人预计下半年周期类、成长类股票，应该是较好的投资选择。

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及本基金基金合同的约定，本基金（包括双禧 100 份额、双禧 A 份额、双禧 B 份额）不进行收益分配。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	11,889,874.51	12,434,975.41
结算备付金		34,761.88	1,265.41
存出保证金		6,497.01	7,596.86
交易性金融资产	6.4.7.2	150,064,683.37	185,046,589.84
其中：股票投资		150,064,683.37	184,923,790.38
基金投资		-	-
债券投资		-	122,799.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,370.42	2,888.45
应收股利		-	-
应收申购款		2,675.31	8,726.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		162,000,862.50	197,502,042.22
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		133,336.64	109,751.52
应付管理人报酬		139,684.99	168,124.30
应付托管费		30,730.68	36,987.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	24,523.43	26,074.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	259,580.62	455,570.63
负债合计		587,856.36	796,508.24
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	119,998,446.74	130,310,006.82
未分配利润	6.4.7.10	41,414,559.40	66,395,527.16
所有者权益合计		161,413,006.14	196,705,533.98
负债和所有者权益总计		162,000,862.50	197,502,042.22

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.199 元，基金份额总额 134,615,987.88 份。其中国联安双禧 A 中证 100 指数份额 43,878,956.00 份；国联安双禧 B 中证 100 指数份额 65,818,434.00 份；国联安双禧中证 100 指数份额 24,918,597.88 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		-18,003,811.30	28,907,258.08
1.利息收入		44,770.52	55,967.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,761.36	45,955.48
债券利息收入		9.16	10,012.36
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）		3,790,590.42	2,612,198.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,923,604.70	978,694.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	20,030.09	-2,254.30
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,846,955.63	1,635,758.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-21,867,016.30	26,192,036.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	27,844.06	47,055.11
减：二、费用		1,457,974.06	1,639,297.54
1. 管理人报酬		916,337.11	1,044,471.71
2. 托管费		201,594.17	229,783.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	70,518.46	92,613.22
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	6.4.7.19	269,524.32	272,428.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,461,785.36	27,267,960.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,461,785.36	27,267,960.54

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

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）	130,310,006.82	66,395,527.16	196,705,533.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,461,785.36	-19,461,785.36
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）	-10,311,560.08	-5,519,182.40	-15,830,742.48
其中：1.基金申购款	814,180.47	469,598.87	1,283,779.34
2.基金赎回款	-11,125,740.55	-5,988,781.27	-17,114,521.82
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）	119,998,446.74	41,414,559.40	161,413,006.14
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）	183,569,180.16	32,401,388.83	215,970,568.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,267,960.54	27,267,960.54
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）	-30,420,846.06	-7,340,804.22	-37,761,650.28
其中：1.基金申购款	171,824.79	40,362.83	212,187.62
2.基金赎回款	-30,592,670.85	-7,381,167.05	-37,973,837.90
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）	153,148,334.10	52,328,545.15	205,476,879.25

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

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金（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”）《关于核准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可 [2010] 228 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《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2010 年 4 月 16 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 982,138,906.44 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》和《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》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，包括中证 100 指数的成份股、备选成份股、新股、现金和到期日在一年以内的政府债券等。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，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%。金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，履行适当程序后可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ 。

根据《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》和《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人国联安基金管理有限公司以 2013 年 4 月 15 日、2016 年 4 月 15 日为本基金份额折算基准日，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了定期折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司进行了变更登记。

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 年度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

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	活期存款	11,889,874.51
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	11,889,874.51	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	127,831,449.52	150,064,683.37	22,233,233.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		127,831,449.52	150,064,683.37	22,233,233.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,351.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	15.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.00
合计	2,370.42

注：此处其他列示的是基金上交所和深交所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	24,523.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,523.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	495.51
应付指数使用费	8,662.56
预提上市费	29,752.78
预提审计费	32,232.48
预提信息披露费	188,437.29
合计	259,580.62

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,183,729.04	130,310,006.82
本期申购	913,390.01	814,180.47
本期赎回（以“-”号填列）	-12,481,131.17	-11,125,740.55
本期末	134,615,987.88	119,998,446.74

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金合同规定，投资者可申购、赎回国联安双禧中证 100 指数分级份额，国联安双禧 A 中证 100 指数和国联安双禧 B 中证 100 指数只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露国联安双禧 A 中证 100 指数和国联安双禧 B 中证 100 指数的情况。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	93,925,139.49	-27,529,612.33	66,395,527.16
本期利润	2,405,230.94	-21,867,016.30	-19,461,785.36
本期基金份额交易产生的变动数	-7,548,852.50	2,029,670.10	-5,519,182.40
其中：基金申购款	602,873.81	-133,274.94	469,598.87
基金赎回款	-8,151,726.31	2,162,945.04	-5,988,781.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,781,517.93	-47,366,958.53	41,414,559.40

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,556.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	144.15
其他	60.53
合计	44,761.36

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,277,066.41
减：卖出股票成本总额	26,353,461.71
买卖股票差价收入	1,923,604.70

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,030.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	20,030.09

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	142,853.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	122,799.46
减：应收利息总额	23.69
买卖债券差价收入	20,030.09

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,846,955.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,846,955.63

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-21,867,016.30
——股票投资	-21,867,016.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-21,867,016.30

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	27,844.06
合计	27,844.06

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	70,518.46
银行间市场交易费用	-
合计	70,518.46

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	188,437.29
银行划款费用	775.00
上市费	29,752.78
指数使用费	18,326.77
合计	269,524.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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）

6.4.10 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 6.4.9.1 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金无关联方债券回购交易。

6.4.10.1.5 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佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 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	916,337.11	1,044,471.71
其中：支付销售机构的客户维护费	95,568.53	113,693.66

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 1.0% 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×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	201,594.17	229,783.81

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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×0.22%/当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

本报告期内及上年度可比期间内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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
中国建设银行股份有限公司	11,889,874.51	44,556.68	11,667,730.86	45,693.29

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

本基金通过“建设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 34,761.88 元。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

根据法律法规的规定及《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金（包括双禧 100 份额、中证 100A 份额、中证 100B 份额）不进行收益分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	50,500.00	1,143,776.68	736,795.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项	6.44	2018-08-20	7.25	123,066.00	1,421,631.29	792,545.04	-
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项	6.34	2018-08-07	5.71	77,639.00	900,420.18	492,231.26	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	52.04	-	-	13,400.00	1,200,110.47	697,336.00	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项	21.46	-	-	33,682.00	699,268.86	722,815.72	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	-	122,799.46
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	122,799.46

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资；

2、根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级；

3、本报告期末，本基金未持有长期信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，建立流动性风险监控与预警机制，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股未超过该上市公司可流通股票的 30%。本报告期末，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%，本基金所持的证券除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,889,874.51	-	-	-	-	-	11,889,874.51
结算备付金	34,761.88	-	-	-	-	-	34,761.88
存出保证金	6,497.01	-	-	-	-	-	6,497.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	150,064,683.37	150,064,683.37
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,370.42	2,370.42
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,675.31	2,675.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,931,133.40	-	-	-	-	150,069,729.10	162,000,862.50
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	133,336.64	133,336.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	139,684.99	139,684.99
应付托管费	-	-	-	-	-	30,730.68	30,730.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	24,523.43	24,523.43
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	259,580.62	259,580.62
负债总计	-	-	-	-	-	587,856.36	587,856.36

利率敏感度缺口	11,931,133.40	-	-	-	-	149,481,872.74	161,413,006.14
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,434,975.41	-	-	-	-	-	12,434,975.41
结算备付金	1,265.41	-	-	-	-	-	1,265.41
存出保证金	7,596.86	-	-	-	-	-	7,596.86
交易性金融资产	-	-	122,799.46	-	-	184,923,790.38	185,046,589.84
买入返售金融资 产	0.00	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,888.45	2,888.45
应收股利	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	-	8,726.25	8,726.25
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	12,443,837.68	0.00	122,799.46	0.00	0.00	184,935,405.08	197,502,042.22
负债							
卖出回购金融资 产款	0.00	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	109,751.52	109,751.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	168,124.30	168,124.30
应付托管费	-	-	-	-	-	36,987.33	36,987.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,074.46	26,074.46
应交税费	-	-	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	455,570.63	455,570.63
负债总计	0.00	-	-	0.00	0.00	796,508.24	796,508.24
利率敏感度缺口	12,443,837.68	0.00	122,799.46	0.00	0.00	184,138,896.84	196,705,533.98

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金均未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

上年度末，本基金持有的债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.06%，且持有的债券投资均为可转换债券，由于该部分资产的利率敏感性较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 92.97%，无债券及衍生金融资产。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	150,064,683. 37	92.97	184,923,790.3 8	94.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	122,799.46	0.06
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	150,064,683.37	92.97	185,046,589.84	94.07
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 7,877,569.65	增加 9,667,743.21
	业绩比较基准下降 5%	减少 7,877,569.65	减少 9,667,743.21

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	150,064,683.37	92.63
	其中：股票	150,064,683.37	92.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	11,924,636.39	7.36
8	其他各项资产	11,542.74	0.01
9	合计	162,000,862.50	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,111,203.69	3.17
C	制造业	55,062,460.34	34.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,533,803.02	2.81
E	建筑业	5,308,736.80	3.29
F	批发和零售业	1,722,109.60	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	3,118,916.01	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,524,817.36	1.56
J	金融业	62,814,923.04	38.92
K	房地产业	6,951,916.83	4.31
L	租赁和商务服务业	1,481,665.68	0.92
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	148,630,552.37	92.08

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 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	736,795.00	0.46
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	-	-
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	697,336.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	1,434,131.00	0.89

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 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所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	228,458	13,383,069.64	8.29
2	600519	贵州茅台	10,588	7,744,698.48	4.80
3	600036	招商银行	217,504	5,750,805.76	3.56
4	000333	美的集团	97,160	5,073,695.20	3.14

5	000651	格力电器	101,512	4,786,290.80	2.97
6	601166	兴业银行	262,518	3,780,259.20	2.34
7	600887	伊利股份	128,000	3,571,200.00	2.21
8	600276	恒瑞医药	46,570	3,528,143.20	2.19
9	600016	民生银行	498,007	3,486,049.00	2.16
10	601328	交通银行	578,697	3,321,720.78	2.06
11	000858	五粮液	40,953	3,112,428.00	1.93
12	002415	海康威视	77,780	2,887,971.40	1.79
13	601336	新华保险	66,425	2,848,304.00	1.76
14	601288	农业银行	805,225	2,769,974.00	1.72
15	600030	中信证券	165,744	2,746,378.08	1.70
16	600104	上汽集团	73,932	2,586,880.68	1.60
17	000002	万科A	102,568	2,523,172.80	1.56
18	601668	中国建筑	442,843	2,417,922.78	1.50
19	601398	工商银行	454,290	2,416,822.80	1.50
20	600000	浦发银行	247,567	2,366,740.52	1.47
21	600900	长江电力	139,147	2,245,832.58	1.39
22	601169	北京银行	312,177	1,882,427.31	1.17
23	600048	保利地产	150,060	1,830,732.00	1.13
24	000725	京东方A	499,876	1,769,561.04	1.10
25	002304	洋河股份	12,705	1,671,978.00	1.04
26	000001	平安银行	181,080	1,646,017.20	1.02
27	600837	海通证券	170,695	1,616,481.65	1.00
28	601988	中国银行	444,465	1,604,518.65	0.99
29	600309	万华化学	34,600	1,571,532.00	0.97
30	600690	青岛海尔	77,204	1,486,949.04	0.92
31	002027	分众传媒	154,824	1,481,665.68	0.92
32	600019	宝钢股份	187,818	1,463,102.22	0.91
33	600518	康美药业	62,976	1,440,890.88	0.89
34	600028	中国石化	221,636	1,438,417.64	0.89
35	600585	海螺水泥	42,135	1,410,679.80	0.87
36	601229	上海银行	82,320	1,297,363.20	0.80
37	603288	海天味业	17,100	1,259,244.00	0.78
38	601818	光大银行	335,832	1,229,145.12	0.76
39	601766	中国中车	153,949	1,185,407.30	0.73
40	000538	云南白药	10,988	1,175,276.48	0.73
41	601211	国泰君安	79,300	1,168,882.00	0.72
42	002024	苏宁易购	78,520	1,105,561.60	0.68
43	601857	中国石油	136,566	1,052,923.86	0.65
44	601688	华泰证券	68,870	1,030,983.90	0.64
45	601006	大秦铁路	125,423	1,029,722.83	0.64
46	600015	华夏银行	135,190	1,007,165.50	0.62
47	300059	东方财富	76,260	1,005,106.80	0.62
48	600703	三安光电	51,600	991,752.00	0.61

49	601009	南京银行	125,200	967,796.00	0.60
50	600050	中国联通	196,308	965,835.36	0.60
51	001979	招商蛇口	50,000	952,500.00	0.59
52	000568	泸州老窖	15,400	937,244.00	0.58
53	600919	江苏银行	146,100	936,501.00	0.58
54	002594	比亚迪	19,110	911,164.80	0.56
55	002142	宁波银行	53,450	870,700.50	0.54
56	601186	中国铁建	97,032	836,415.84	0.52
57	601088	中国神华	41,700	831,498.00	0.52
58	000776	广发证券	62,394	827,968.38	0.51
59	601390	中国中铁	123,066	792,545.04	0.49
60	601628	中国人寿	35,174	792,118.48	0.49
61	601899	紫金矿业	218,865	790,102.65	0.49
62	601989	中国重工	193,030	779,841.20	0.48
63	002252	上海莱士	33,682	722,815.72	0.45
64	601225	陕西煤业	84,407	693,825.54	0.43
65	600958	东方证券	75,500	689,315.00	0.43
66	000063	中兴通讯	52,117	679,084.51	0.42
67	600999	招商证券	48,212	659,540.16	0.41
68	600795	国电电力	248,695	651,580.90	0.40
69	600340	华夏幸福	24,900	641,175.00	0.40
70	000166	申万宏源	142,578	623,065.86	0.39
71	601933	永辉超市	80,700	616,548.00	0.38
72	600011	华能国际	88,600	563,496.00	0.35
73	601111	中国国航	63,040	560,425.60	0.35
74	601985	中国核电	98,500	556,525.00	0.34
75	000895	双汇发展	20,899	551,942.59	0.34
76	600115	东方航空	82,700	547,474.00	0.34
77	601669	中国电建	96,765	518,660.40	0.32
78	600606	绿地控股	77,000	503,580.00	0.31
79	000069	华侨城 A	69,261	500,757.03	0.31
80	601727	上海电气	77,639	492,231.26	0.30
81	002736	国信证券	51,900	472,290.00	0.29
82	600010	包钢股份	288,408	447,032.40	0.28
83	600893	航发动力	19,010	424,303.20	0.26
84	601998	中信银行	64,635	401,383.35	0.25
85	600023	浙能电力	86,019	400,848.54	0.25
86	600018	上港集团	63,525	378,609.00	0.23
87	601618	中国中冶	112,999	376,286.67	0.23
88	601800	中国交建	32,213	366,906.07	0.23
89	601018	宁波港	83,298	350,684.58	0.22
90	002558	巨人网络	12,840	305,335.20	0.19
91	603993	洛阳钼业	48,400	304,436.00	0.19
92	002352	顺丰控股	5,600	252,000.00	0.16

93	601633	长城汽车	25,397	249,398.54	0.15
94	601360	三六零	8,600	248,540.00	0.15
95	601881	中国银河	27,200	221,136.00	0.14
96	601238	广汽集团	13,440	149,721.60	0.09
97	600025	华能水电	38,000	115,520.00	0.07

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600485	信威集团	50,500.00	736,795.00	0.46
2	002739	万达电影	13,400.00	697,336.00	0.43

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	601336	新华保险	2,251,080.00	1.14
2	600309	万华化学	1,695,288.00	0.86
3	601211	国泰君安	1,477,849.00	0.75
4	603288	海天味业	1,316,746.00	0.67
5	002027	分众传媒	1,231,336.00	0.63
6	000568	泸州老窖	1,054,181.00	0.54
7	601229	上海银行	1,015,034.00	0.52
8	300059	东方财富	899,392.00	0.46
9	601933	永辉超市	671,424.00	0.34
10	601360	三六零	314,168.00	0.16
11	601111	中国国航	215,808.00	0.11
12	600690	青岛海尔	208,666.00	0.11
13	000166	申万宏源	204,848.00	0.10
14	601238	广汽集团	184,320.00	0.09
15	600025	华能水电	128,060.00	0.07
16	601881	中国银河	119,860.00	0.06
17	600958	东方证券	110,140.00	0.06
18	601009	南京银行	104,808.00	0.05
19	002352	顺丰控股	33,327.00	0.02
20	601138	工业富联	27,540.00	0.01

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	601601	中国太保	2,428,641.37	1.23
2	601318	中国平安	2,096,000.00	1.07
3	600837	海通证券	1,757,045.06	0.89
4	600519	贵州茅台	1,075,259.00	0.55
5	600036	招商银行	868,694.71	0.44
6	000651	格力电器	679,297.00	0.35
7	000333	美的集团	647,949.46	0.33
8	601166	兴业银行	599,661.00	0.30
9	601901	方正证券	580,669.34	0.30
10	601788	光大证券	561,505.00	0.29
11	600887	伊利股份	557,198.00	0.28
12	600016	民生银行	550,090.00	0.28
13	600637	东方明珠	525,529.60	0.27
14	601328	交通银行	488,027.00	0.25
15	000625	长安汽车	466,310.80	0.24
16	600030	中信证券	436,839.00	0.22
17	000725	京东方 A	436,098.00	0.22
18	000002	万 科 A	427,773.00	0.22
19	601288	农业银行	423,184.00	0.22
20	002415	海康威视	419,433.00	0.21

7.4.3 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	13,361,371.00
卖出股票的收入（成交）总额	28,277,066.41

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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中除招商银行、兴业银行和民生银行外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日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因十四项违法违规事项于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

兴业银行（601166）的发行主体兴业银行股份有限公司因十二项违法违规事项于 2018 年 4 月 19 日被中国银行保险监督管理委员会处以 5870 万元罚款。

民生银行（600016）的发行主体中国民生银行股份有限公司厦门分行由于违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定于 2018 年 3 月 14 日被中国

人民银行给予警告，没收违法所得 48,418,193.27 元，并处罚款 114,639,752.47 元，合计处罚金额 163,057,945.74 元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	6,497.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,370.42
5	应收申购款	2,675.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,542.74

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

7.12.5.1 期末指数投资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指数投资中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	600485	信威集团	736,795.00	0.46	重大事项
2	002739	万达电影	697,336.00	0.43	重大事项

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

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
国联安双禧 A 中证 100 指数	638	68,775.79	11,849,262.00	27.00%	32,029,694.00	73.00%
国联安双禧 B 中证 100 指数	3,603	18,267.68	16,299,855.00	24.76%	49,518,579.00	75.24%
国联安双禧中 证 100 指数	5,322	4,682.19	402,855.51	1.62%	24,515,742.37	98.38%
合计	9,563	14,076.75	28,551,972.51	21.21%	106,064,015.37	78.79%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 期末上市基金前十名持有人

国联安双禧 A 中证 100 指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国银河证券股份有限公 司	6,305,817.00	14.37%
2	陈岩	4,550,941.00	10.37%
3	陈淦	3,761,697.00	8.57%
4	王琬雯	3,349,936.00	7.63%
5	陈宏和	1,932,310.00	4.40%
6	中国太平洋人寿保险股份 有限公司—传统—普通保 险产品	1,800,033.00	4.10%
7	中国太平洋财产保险—传 统—普通保险产品	1,799,600.00	4.10%

	-013C-CT001 深		
8	王雁	1,758,500.00	4.01%
9	陈维	1,464,587.00	3.34%
10	陈若钿	1,120,000.00	2.55%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双禧B中证100指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	幸福人寿保险股份有限公司-分红	15,044,504.00	22.86%
2	张俊生	6,000,000.00	9.12%
3	幸福人寿保险股份有限公司-自有资金	1,139,200.00	1.73%
4	张俊英	814,534.00	1.24%
5	韦桂生	729,759.00	1.11%
6	张阳光	656,212.00	1.00%
7	张桂香	626,100.00	0.95%
8	郑元岳	600,000.00	0.91%
9	孙英	508,001.00	0.77%
10	郑福顺	502,538.00	0.76%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双禧中证100指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张俊生	1,723,640.00	6.92%
2	李妍	625,222.98	2.51%
3	王兰英	555,769.61	2.23%
4	鞠瑛茹	421,959.27	1.69%
5	胡伟	333,366.05	1.34%
6	李础前	306,294.00	1.23%
7	柳作云	253,656.87	1.02%
8	张俊英	233,994.00	0.94%
9	王春平	230,257.46	0.92%
10	郑元岳	189,883.00	0.76%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 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。

8.4 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、基金投资和研究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

项目	国联安双禧 A 中证 100 指数	国联安双禧 B 中证 100 指数	国联安双禧中证 100 指数
基金合同生效日（2010 年 4 月 16 日）基金份额总额	263,081,728.00	394,622,592.00	324,434,577.44
本报告期期初基金份额总额	48,038,700.00	72,058,050.00	26,086,979.04
本报告期基金总申购份额	-	-	913,390.01
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	12,481,131.17
本报告期基金拆分变动份额	-4,159,744.00	-6,239,616.00	10,399,360.00
本报告期期末基金份额总额	43,878,956.00	65,818,434.00	24,918,597.88

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金定期份额折算变动份额。

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	
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	22,092,251.46	53.11%	20,574.73	53.38%	-
东北证券股份有限公司	1	9,896,703.86	23.79%	9,018.91	23.40%	-
东兴证券股份	1	9,611,712.09	23.10%	8,951.61	23.22%	-

有限公司						
------	--	--	--	--	--	--

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无变更。

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
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	142,853.24	100.00%	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万华化学股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-01-10
2	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2017 年 4 季报	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018-01-20
3	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持东山精密、兆易创新股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-02-03
4	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持台海核电、康得新股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-02-08
5	国联安基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-03-12

	构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告		
6	国联安基金管理有限公司关于旗下基金修改基金合同、托管协议并计划收取短期赎回费的提示性公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-03-23
7	国联安基金管理有限公司关于开展网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-03-26
8	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2017 年年报	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018-03-27
9	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-03-30
10	国联安基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台货币基金转认购业务相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-03-30
11	国联安基金管理有限公司关于旗下基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-03-30
12	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-02
13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-02
14	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-02
15	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-03
16	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2018 年 1 季报	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018-04-20
17	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中兴通讯股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-21
18	国联安基金管理有限公司董事、独立董事变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-27
19	国联安基金管理有限公司董事长及法定代表人变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-27
20	国联安基金管理有限公司关于增加济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-27
21	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-04-28

22	国联安基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-05-04
23	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海莱士股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-05-12
24	国联安基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-05-28
25	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2018-05-30
26	国联安基金管理有限公司关于降低旗下基金在招商银行定期定额投资最低限额的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-06
27	国联安基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-08
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中兴通讯股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-14
29	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持康得新、天齐锂业股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-16
30	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中国中铁股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-21
31	关于警惕冒用国联安基金管理有限公司名义开展活动的特别提示	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-30
32	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2018-06-30

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一八年八月二十四日