

# 国联安德盛小盘精选证券投资基金

## 2018 年年度报告摘要

### 2018 年 12 月 31 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：二〇一九年三月三十日

## §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 2019 年 3 月 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	949,502,746.58 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	$(\text{天相小盘股指数} \times 60\% + \text{天相中盘股指数} \times 40\%) \times 60\% + \text{上证国债指数}$

	×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 负责人	姓名	李华	郭明
	联系电话	021-38992888	010-66105799
	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	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-5,489,592.71	118,910,661.46	13,079,780.54
本期利润	-282,199,396.35	135,620,894.00	-181,973,554.21
加权平均基金份额本期利润	-0.2891	0.1090	-0.1470
本期基金份额净值增长率	-26.17%	10.83%	-9.41%

3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1790	0.1117	0.0437
期末基金资产净值	779,530,446.93	1,124,022,583.92	1,421,032,331.86
期末基金份额净值	0.821	1.112	1.044

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。

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
过去三个月	-9.98%	1.29%	-6.28%	1.06%	-3.70%	0.23%
过去六个月	-14.03%	1.21%	-10.54%	0.92%	-3.49%	0.29%
过去一年	-26.17%	1.16%	-18.67%	0.86%	-7.50%	0.30%
过去三年	-25.87%	1.11%	-26.52%	0.85%	0.65%	0.26%
过去五年	59.40%	1.47%	19.46%	1.02%	39.94%	0.45%
自基金合同生效起至今	326.81%	1.38%	160.64%	1.13%	166.17%	0.25%

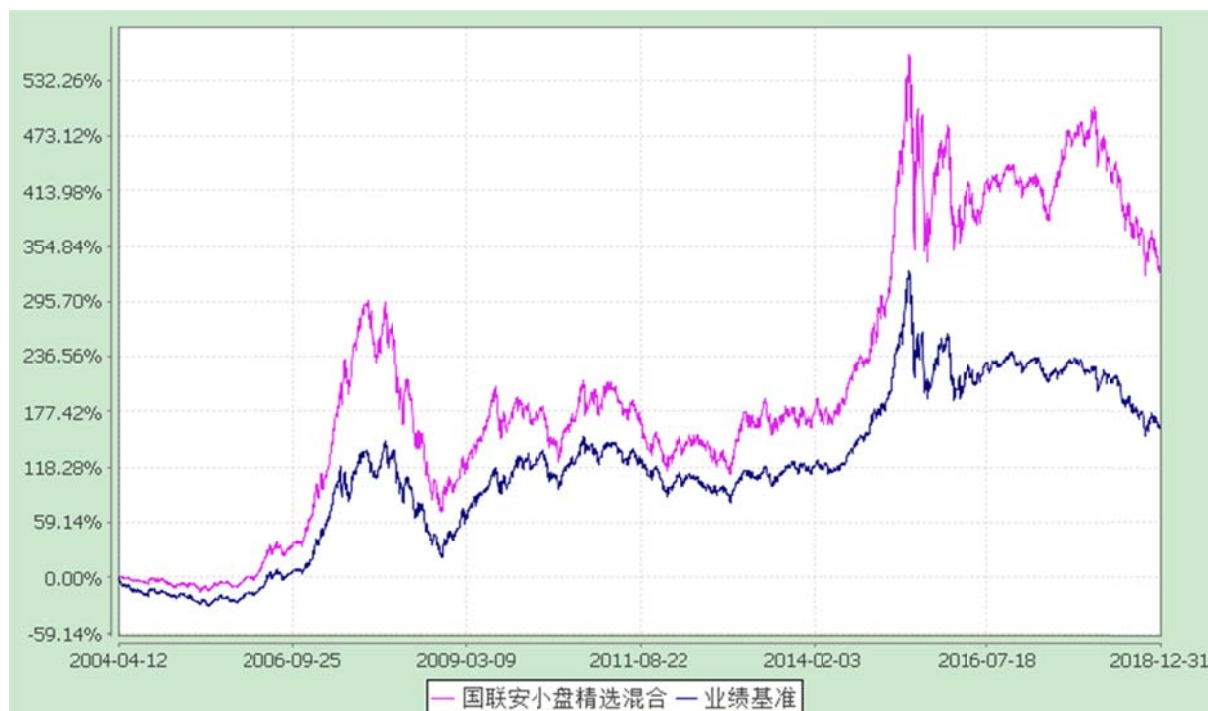
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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的历史走势对比图

(2004 年 4 月 12 日至 2018 年 12 月 31 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%；

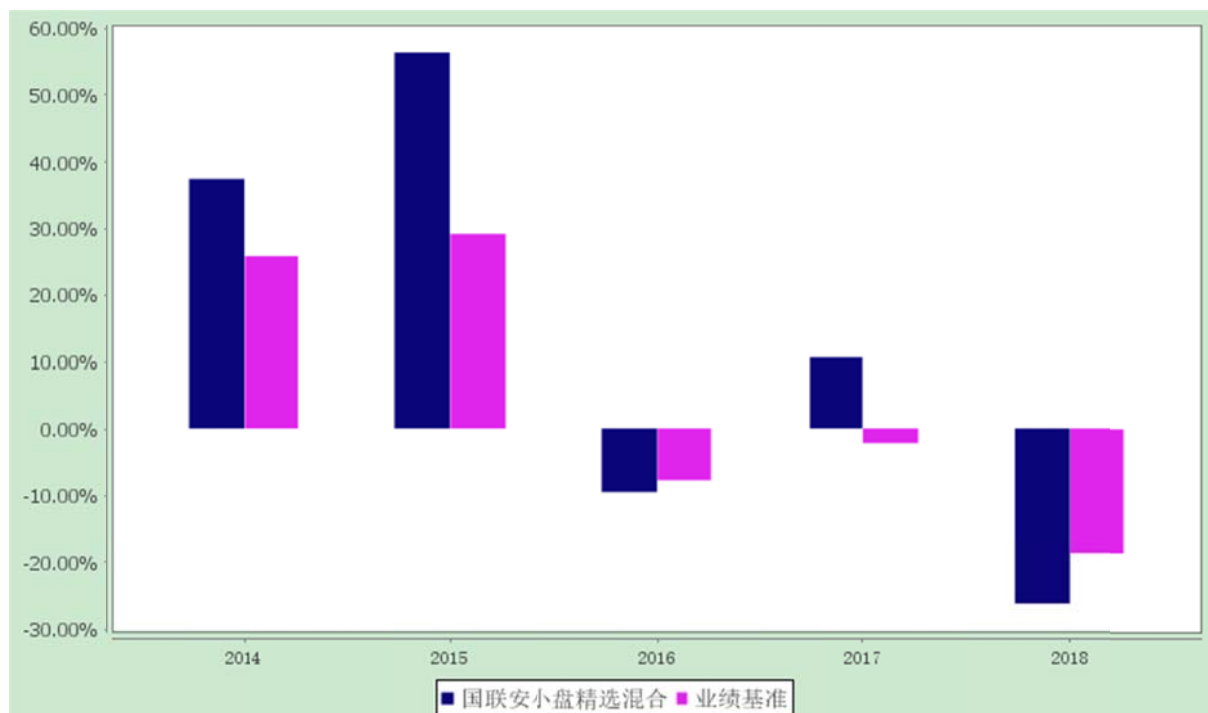
2、本基金基金合同于 2004 年 4 月 12 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定；

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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安德盛小盘精选证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	-
2017	0.400	17,995,223.37	31,647,828.18	49,643,051.55	-
2016	5.000	596,348,713.31	281,826,210.22	878,174,923.53	-
合计	5.400	614,343,936.68	313,474,038.40	927,817,975.08	-

注：2017 年度利润分配的收益基准日为 2016 年 12 月 31 日，2016 年度利润分配的收益基准日为 2015 年 12 月 31 日。

## §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，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股

份有限公司控股的资产管理公司；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，公司共管理四十只开放式基金。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、国联安价值优选股票型证券投资基金基金经理、权益投资部总经理。	2010-03-06	-	14 年(自 2004 年起)	邹新进先生，硕士研究生。2004 年 7 月至 2007 年 7 月在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）担任分析师。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、研究部副总监，现任权益投资部总经理。2010 年 3 月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金的基金经理，2012 年 2 月至 2013 年 4 月兼任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理，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的基金经理，2018 年 9 月起兼任国联安价值优选股票型证券投资基金的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法



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。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部对银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。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。本基金管理人对不同投资合同同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的不同投资合同同向交易的交易价差进行了分析，执行了 95% 置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验，同时进一步对不同投资合同同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析，未发现明显异

常。

公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 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

对于中国股市来说，2018 年是非常困难的一年，是内忧外患的一年。除了一月份市场延续 2017 年走势有所表现外，二月份开始在国内外风险事件频发下市场整体大跌，特别是五月下旬之后，随着金融去杠杆（内因）的持续推进，债券违约事件频发，民营经济的资金流动性出现巨大危机；加上中美贸易摩擦（外因）加剧，市场对中国经济的中长期基本面产生信任危机，整体市场情绪急转直下，大盘连续下探低点。直到年底，随着中央一系列会议的纠偏和应对，市场才有所企稳。结构上，大小盘分化仍然严重，以上证 50 为代表的大市值股票因有国家信用的背书成为市场资金的避难所，相对抗跌；而大部分中小市值公司股价则大幅下挫。

本基金 2018 年整体表现不太理想。本基金报告期内在仓位上没有大的变化。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低估值的周期类板块。

#### 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-26.17%，同期业绩比较基准收益率为-18.67%。

### 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 2019 年，本基金认为宏观基本面下行已经是普遍预期，但稳增长的逆周期政策效果和改革的力度可能会超出预期。中央经济工作会议提出的“促进形成强大国内市场”可能会越来越现实，外部的影响也将会变弱。另一方面，中美摩擦将是“持久战”，边打边谈可能是更加现实的选择，2019 年市场将会更加理性的看待这个问题；换一个角度看，这也将对中国进一步的改革开放提供倒逼的压力。而目前 A 股估值已处于历史底部区域，科创板的加速推进也将带来风险偏好的提升。所以，本基金认为当前是中长期投资的较好位置。

在行业配置上，本基金将从性价比的角度出发，重点关注集中度提升同时估值相对较低的医药流通、地产、农化等板块；同时，鉴于预期 2019 年风险偏好的提升和科创板等证券市场制度的创新，将适时适度配置部分科技成长板块（5G、部分化工新材料等）和券商板块。

本基金坚信，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，本基金将努力为基金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，本基金本报告期末进行利润分配，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 审计报告**

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师单峰，钱祎彤签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21215 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

**§7 年度财务报表****7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	7,420,022.74	7,822,462.85
结算备付金	219,406.90	1,162,258.94
存出保证金	79,403.24	263,868.28
交易性金融资产	759,016,536.40	1,067,289,257.45
其中：股票投资	574,547,440.00	832,956,860.43
基金投资	-	-
债券投资	184,469,096.40	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	13,879,571.20	1,179,441.58
应收利息	1,811,100.25	4,268,031.14
应收股利	-	-
应收申购款	19,346.73	52,497.05
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>782,445,387.46</b>	<b>1,131,538,011.54</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
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	47,238.58	2,140,764.64
应付管理人报酬	1,034,807.01	1,484,733.32
应付托管费	172,467.83	247,455.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	128,364.86	579,670.10
应交税费	1,134,048.53	1,132,463.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	398,013.72	400,741.44
<b>负债合计</b>	<b>2,914,940.53</b>	<b>7,515,427.62</b>
<b>所有者权益:</b>	-	-
实收基金	949,502,746.58	1,011,076,874.67
未分配利润	-169,972,299.65	112,945,709.25

所有者权益合计	<b>779,530,446.93</b>	<b>1,124,022,583.92</b>
负债和所有者权益总计	<b>782,445,387.46</b>	<b>1,131,538,011.54</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.821 元，基金份额总额 949,502,746.58 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-263,164,564.87</b>	<b>162,924,949.45</b>
1.利息收入	5,430,079.27	9,417,259.72
其中：存款利息收入	157,078.60	233,725.99
债券利息收入	5,178,012.96	8,925,500.35
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	94,987.71	258,033.38
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	8,086,921.65	136,188,735.58
其中：股票投资收益	2,059,456.37	115,226,653.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,908,214.51	10,550,609.84
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	10,935,679.79	10,411,472.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-276,709,803.64	16,710,232.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	28,237.85	608,721.61

<b>减：二、费用</b>	<b>19,034,831.48</b>	<b>27,304,055.45</b>
1. 管理人报酬	14,305,423.47	19,533,953.72
2. 托管费	2,384,237.29	3,255,658.96
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,925,970.34	4,069,263.63
5. 利息支出	-	26,109.14
其中：卖出回购金融资产支出	-	26,109.14
6. 税金及附加	2,632.38	-
7. 其他费用	416,568.00	419,070.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-282,199,396.35</b>	<b>135,620,894.00</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-282,199,396.35</b>	<b>135,620,894.00</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	1,011,076,874.67	112,945,709.25	1,124,022,583.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-282,199,396.35	-282,199,396.35
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）	-61,574,128.09	-718,612.55	-62,292,740.64
其中：1.基金申购款	17,616,532.38	270,107.22	17,886,639.60

2.基金赎回款	-79,190,660.47	-988,719.77	-80,179,380.24
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）	949,502,746.58	-169,972,299.65	779,530,446.93
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	-	135,620,894.00	135,620,894.00
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）	-350,435,178.33	-32,552,412.06	-382,987,590.39
其中：1.基金申购款	229,553,616.49	8,119,636.86	237,673,253.35
2.基金赎回款	-579,988,794.82	-40,672,048.92	-620,660,843.74
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）	1,011,076,874.67	112,945,709.25	1,124,022,583.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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”)证监基金字[2004]第 19 号《关于同意国联安德盛小盘精选证券投资基金设立的批复》核准，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》和《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，业经毕马威华振会计师事务所 KPMG-B(2004)CR No.0013 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》于 2004 年 4 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 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(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》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。本基金的投资组合比例为：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： $(60\% \times \text{天相小盘股指数} + 40\% \times \text{天相中盘股指数}) \times 60\% + \text{上证国债指数} \times 40\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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《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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司(“太平洋资管”)	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)基金销售机构
安联集团	基金管理人的股东

注：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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期内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之间的关联方交易均为发生在自 2018 年 5 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日止期间的交易。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.8.1.2 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.8.1.3 债券交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

**7.4.8.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,305,423.47	19,533,953.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,909,475.36	1,891,491.19

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,384,237.29	3,255,658.96

注：支付基金托管人中国工商银行的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。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	7,420,022.74	141,685.66	7,822,462.85	202,520.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。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12月31日的相关余额为人民币219,406.90元(2017年12月31日：人民币1,162,258.94元)。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
603156	养元饮品	2018-02-02	2019-02-12	新股锁定	78.73	40.68	37,717	2,969,459.41	1,534,327.56	-
603156	养元饮品	2018-05-08	2019-02-12	新股锁定	-	40.68	15,087	-	613,739.16	-
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股待上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

注：基金可作为特定投资者，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份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

#### 7.4.9.2 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	复牌开盘单盘价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项	16.01	2019-01-10	17.15	600,000.00	10,388,000.00	9,606,000.00	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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为 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 651,687,913.88 元，属于第二层次的余额为 107,328,622.52 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 805,732,802.07 元，第二层次 261,556,455.38 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	574,547,440.00	73.43
	其中：股票	574,547,440.00	73.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	184,469,096.40	23.58
	其中：债券	184,469,096.40	23.58
	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	7,639,429.64	0.98
8	其他各项资产	15,789,421.42	2.02
9	合计	782,445,387.46	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。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	42,144,000.00	5.41
C	制造业	267,929,790.99	34.37
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	144,770,323.00	18.57
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	28,422,326.01	3.65
K	房地产业	69,306,000.00	8.89
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	21,975,000.00	2.82
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	574,547,440.00	73.70

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 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	2,407,100	55,965,075.00	7.18
2	000028	国药一致	1,300,000	53,872,000.00	6.91
3	000671	阳光城	8,700,000	45,153,000.00	5.79
4	600486	扬农化工	1,100,000	41,426,000.00	5.31
5	600123	兰花科创	4,500,000	29,340,000.00	3.76
6	000910	大亚圣象	2,700,000	27,837,000.00	3.57
7	600997	开滦股份	4,564,381	25,880,040.27	3.32
8	002643	万润股份	2,300,000	23,276,000.00	2.99
9	000902	新洋丰	2,490,000	22,310,400.00	2.86
10	002159	三特索道	1,250,000	21,975,000.00	2.82

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

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	49,907,560.15	4.44
2	600486	扬农化工	46,962,403.76	4.18
3	000671	阳光城	39,472,429.14	3.51
4	600997	开滦股份	27,616,307.04	2.46
5	000902	新洋丰	27,196,348.25	2.42
6	002022	科华生物	24,260,968.40	2.16
7	002191	劲嘉股份	19,017,586.00	1.69
8	601168	西部矿业	18,999,070.00	1.69
9	600019	宝钢股份	18,722,000.00	1.67
10	000400	许继电气	17,989,868.82	1.60
11	600713	南京医药	17,943,523.00	1.60
12	000001	平安银行	17,556,000.00	1.56
13	601818	光大银行	17,030,000.00	1.52
14	002572	索菲亚	16,671,754.16	1.48
15	601155	新城控股	15,174,154.00	1.35
16	600567	山鹰纸业	13,241,478.90	1.18
17	600380	健康元	11,971,657.00	1.07
18	002366	台海核电	11,523,940.00	1.03
19	002643	万润股份	11,480,113.83	1.02
20	002159	三特索道	11,159,504.00	0.99

**8.4.2 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	000513	丽珠集团	28,750,992.99	2.56
3	300054	鼎龙股份	24,323,433.00	2.16
4	600581	八一钢铁	21,866,589.00	1.95
5	600123	兰花科创	21,058,371.34	1.87
6	600782	新钢股份	20,278,444.00	1.80
7	601600	中国铝业	18,639,500.00	1.66
8	601818	光大银行	16,376,202.61	1.46
9	600376	首开股份	16,155,342.00	1.44
10	600019	宝钢股份	16,096,000.00	1.43
11	603686	龙马环卫	15,331,407.46	1.36
12	600380	健康元	15,077,460.90	1.34
13	000400	许继电气	14,631,004.64	1.30
14	600567	山鹰纸业	12,518,802.70	1.11
15	300335	迪森股份	12,369,383.41	1.10
16	000417	合肥百货	11,767,887.76	1.05
17	002157	正邦科技	10,498,206.00	0.93
18	600997	开滦股份	10,449,447.04	0.93
19	300197	铁汉生态	9,811,344.53	0.87
20	000060	中金岭南	9,554,187.20	0.85

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	651,360,025.36
卖出股票的收入（成交）总额	633,207,460.83

注：不考虑相关交易费用

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

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	25,418,000.00	3.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	44,908,910.00	5.76
	其中：政策性金融债	44,908,910.00	5.76
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）	114,142,186.40	14.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	184,469,096.40	23.66

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开 1701	420,670	42,252,094.80	5.42
2	132009	17 中油 EB	250,000	25,197,500.00	3.23
3	128024	宁行转债	231,406	24,524,407.88	3.15
4	123006	东财转债	208,000	24,125,920.00	3.09
5	110032	三一转债	172,480	20,563,065.60	2.64

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	79,403.24
2	应收证券清算款	13,879,571.20
3	应收股利	-
4	应收利息	1,811,100.25
5	应收申购款	19,346.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	15,789,421.42
---	----	---------------

#### 8.12.4 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	128024	宁行转债	24,524,407.88	3.15
2	123006	东财转债	24,125,920.00	3.09
3	110032	三一转债	20,563,065.60	2.64
4	123002	国祯转债	11,647,962.00	1.49
5	127005	长证转债	7,869,600.00	1.01

#### 8.12.5 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
19,986	47,508.39	38,838,548.33	4.09%	910,664,198.25	95.91%

#### 9.2 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	1,079,111.93	0.11%

#### 9.3 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

## §10 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	17,616,532.38
减：本报告期基金总赎回份额	79,190,660.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	949,502,746.58

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。

## §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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。

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。

3、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。

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、2018年9月21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》，李华先生担任公司督察长职务，总经理孟朝霞女士不再代为履行督察长职责。

6、2018年9月21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》，

蔡蓓蕾女士担任公司副总经理兼市场总监职务。

7、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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2018 年 12 月 11 日起更换会计师事务所,由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)变更为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。此次变更已经国联安基金管理有限公司董事会审议通过和通知基金托管人,并报中国证券监督管理委员会、上海证监局备案。

本基金报告年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 9.8 万元人民币。目前该事务所已向本基金提供连续 1 年的审计服务。

### 11.6 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《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,制定并落实相关整改措施,及时向中国证券监督管理委员会上海监管局提交整改报告,顺利通过了该局的整改验收。

2、本报告期内,托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元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	2.38%	27,639.87	2.35%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	57,070,953.74	4.47%	53,149.96	4.53%	-
中国国际金融股份有限公司	1	13,371,115.65	1.05%	12,185.08	1.04%	-
海通证券股份有限公司	2	59,758,803.10	4.69%	55,652.77	4.74%	-
平安证券股份	1	228,691,332.05	17.93%	212,982.31	18.14%	-



有限公司						
招商证券股份 有限公司	1	569,801,392.00	44.68%	519,260.51	44.22%	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	7,585,095.72	0.59%	6,912.52	0.59%	-
华泰证券股份 有限公司	1	9,911,550.00	0.78%	9,230.69	0.79%	-
国信证券股份 有限公司	1	37,796,148.87	2.96%	35,199.49	3.00%	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	208,473,313.63	16.35%	194,150.64	16.53%	-
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	4.12%	47,893.76	4.08%	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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	6,014,114.92	1.45%	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	41,332,128.20	9.95%	-	-	-	-
平安证券股份	144,009,075.	34.68%	150,000,0	83.33%	-	-

有限公司	38		00.00			
招商证券股份 有限公司	127,123,867. 01	30.61%	-	-	-	-
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	0.54%	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	4,918,887.88	1.18%	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	89,672,510.1 1	21.59%	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	-	-	-	-	-	-

## 12 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

二〇一九年三月三十日