

# 国联安价值优选股票型证券投资基金

## 2019 年半年度报告

### 2019 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：二〇一九年八月二十八日

## 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 2019 年 8 月 27 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 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.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 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.....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9  |
| 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.....             | 10 |
| 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 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 11 |
| 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..... | 11 |
| 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 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 13 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 16 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 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.....                    | 33 |
| 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.....       | 34 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 36 |
| 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.....      | 37 |
| 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.....   | 37 |
| 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.....   | 37 |
| 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.....      | 37 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 37 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 38 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 38 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 39 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 39        |
| 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 ..... | 40        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | <b>40</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | <b>40</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 40        |
| 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 .....  | 40        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 40        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 40        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 40        |
| 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 .....     | 41        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 41        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 43        |
| <b>11 备查文件目录</b> .....                  | <b>43</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                       | 43        |
| 11.2 存放地点 .....                         | 44        |
| 11.3 查阅方式 .....                         | 44        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 国联安价值优选股票型证券投资基金 |
| 基金简称       | 国联安价值优选股票        |
| 基金主代码      | 006138           |
| 交易代码       | 006138           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2018 年 9 月 20 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 | 15,917,089.44 份  |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制基金资产投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。   |
| 投资策略   | 本基金坚持价值投资理念，采用定量分析与定性分析相结合的方法，优选经营稳健、具有核心竞争优势、具备一定安全边际并且业绩可持续增长的上市公司进行投资。本基金将深入分析公司的业绩增长潜力，以发展的眼光评估公司的长期投资价值，同时积极关注公司基本面发生变化所带来的投资机会。      |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型证券投资基金，属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                          | 基金托管人                |
|-------------|------|--------------------------------|----------------------|
| 名称          |      | 国联安基金管理有限公司                    | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李华                             | 田青                   |
|             | 联系电话 | 021-38992888                   | 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                  | 北京市西城区金融大街25号        |

|       |                               |                       |
|-------|-------------------------------|-----------------------|
|       | 陆家嘴环路1318号9楼                  |                       |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼 | 北京市西城区闹市口大街1号<br>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       | 证券时报                          |
| 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<br>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 | 国联安基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路<br>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（2019年1月1日至2019年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 10,770,132.84             |
| 本期利润          | 15,227,347.88             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3685                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 34.12%                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 25.57%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 3,550,967.76              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2231                    |
| 期末基金资产净值      | 19,468,057.20             |
| 期末基金份额净值      | 1.2231                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 22.31%                    |

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。

4、本基金基金合同于 2018 年 9 月 20 日生效。截至报告期末，本基金成立未满一年。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 6.06%    | 1.28%       | 4.41%      | 0.93%         | 1.65%  | 0.35% |
| 过去三个月      | -6.75%   | 1.61%       | -0.71%     | 1.23%         | -6.04% | 0.38% |
| 过去六个月      | 25.57%   | 1.62%       | 21.89%     | 1.24%         | 3.68%  | 0.38% |
| 过去一年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 22.31%   | 1.34%       | 13.51%     | 1.26%         | 8.80%  | 0.08% |

注：1、本基金基金合同于 2018 年 9 月 20 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；

2、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

国联安价值优选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 9 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日)



- 注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%；
- 2、本基金基金合同于 2018 年 9 月 20 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
- 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；
- 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，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，公司共管理四十六只开放式基金。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<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>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、国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理、权益投资部总经理。 | 2018-09-30           | -    | 15 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》、《国联安价值优选股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”)，用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行

交易系统中的公平交易模块；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

2019 年上半年市场先扬后抑，但整体表现良好。由于 2019 年初股指的起始位置很低，同时全球央行表态鸽派和中美贸易谈判不断取得进展等利好因素频出，驱动市场风险偏好提升，一季度 A 股市场一路向上，个股呈现普涨格局。4 月中旬市场风险偏好的整体修复达到顶峰，这和我们预期较为符合，但随着政策的重新定调，市场情绪快速降温，特别是 5 月，由于中美谈判再次恶化，市场情绪急转直下，个股普跌。而结构上则分化巨大，食品饮料行业由于预期稳定成为市场资金的避难所，逆势上涨；而大量中小市值股票则大幅下挫。

本基金报告期内建仓完毕，并维持高仓位。在行业配置上，本基金主要按照年初的投资思路以集中度提升同时估值相对较低的医药流通、地产及其下游、农化等板块为主；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，适时适度配置了部分科技成长板块（5G、部分化工新材料等）和券商板块。

##### 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 25.57%，同期业绩比较基准收益率为 21.89%。

#### 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，由于 6 月底中美元首会晤给中美谈判重新定调，市场的风险偏好将再度提升，关注点将回到国内，包括科创板开板、逆周期调节政策等。从中长期角度看，中美竞争依然存在，但发展好中美关系仍然是国际社会的普遍期待，中国持续崛起的态势不变，所以，站在目前较低的位置，中长期投资的性价比较高。市场节奏可能以“进二退一”方式演进。

在行业配置上，本基金将从性价比的角度出发，重点关注集中度较高同时估值相对较低的医药流通、地产、农化、工程机械等板块；同时，鉴于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。

我们坚信，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，我们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

2019 年 2 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日，本基金资产净值低于 5000 万元。

基金管理人拟开展持续营销活动，提升基金规模。

## 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：国联安价值优选股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 878,805.35                     | 6,503,092.29                     |
| 结算备付金           |            | 13,442.26                      | 363,164.02                       |
| 存出保证金           |            | 26,032.52                      | 17,581.40                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 18,870,542.00                  | 74,083,258.65                    |
| 其中：股票投资         |            | 18,570,782.00                  | 60,703,646.25                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 299,760.00                     | 13,379,612.40                    |
| 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    | -                              | 20,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 180,982.64                     | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 3,330.76                       | 415,596.63                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 4,717.43                       | 1,440.39                         |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>19,977,852.96</b>           | <b>101,384,133.38</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 69.00                          | 243,277.64                       |
| 应付赎回款           |            | 375,029.85                     | 300,395.72                       |
| 应付管理人报酬         |            | 24,547.50                      | 132,779.60                       |
| 应付托管费           |            | 4,091.20                       | 22,129.94                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 8,630.76                       | 74,844.10                        |
| 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  | 97,427.45            | 185,754.46            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>509,795.76</b>    | <b>959,181.46</b>     |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                    | -                     |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 15,917,089.44        | 103,103,438.33        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 3,550,967.76         | -2,678,486.41         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>19,468,057.20</b> | <b>100,424,951.92</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>19,977,852.96</b> | <b>101,384,133.38</b> |

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2231 元，基金份额总额 15,917,089.44 份。

2、本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，上年度期间为 2018 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日（下同）。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安价值优选股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>15,875,906.75</b>                  |
| 1.利息收入                |          | 113,198.58                            |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 24,897.68                             |
| 债券利息收入                |          | 61,092.74                             |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                     |
| 买入返售金融资产收入            |          | 27,208.16                             |
| 其他利息收入                |          | -                                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 11,033,899.09                         |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 10,781,027.02                         |
| 基金投资收益                |          | -                                     |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | -25,057.50                            |
| 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 | 277,929.57                            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 4,457,215.04                          |
| 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 | 271,594.04                            |

|                            |          |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>648,558.87</b>    |
| 1. 管理人报酬                   |          | 343,721.65           |
| 2. 托管费                     |          | 57,286.82            |
| 3. 销售服务费                   |          | -                    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 142,135.72           |
| 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 | 105,414.68           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>15,227,347.88</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>15,227,347.88</b> |

注：本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，截至本报告期末本基金成立不满一年，因此无上年度可比期间数据（下同）。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安价值优选股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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）                        | 103,103,438.33                        | -2,678,486.41  | 100,424,951.92  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 15,227,347.88  | 15,227,347.88   |
| 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）      | -87,186,348.89                        | -8,997,893.71  | -96,184,242.60  |
| 其中：1.基金申购款                             | 9,809,135.15                          | 2,597,937.49   | 12,407,072.64   |
| 2.基金赎回款                                | -96,995,484.04                        | -11,595,831.20 | -108,591,315.24 |
| 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）                        | 15,917,089.44                         | 3,550,967.76   | 19,468,057.20   |

注：本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，截至本报告期末本基金成立不满一年，因此无上年度可比期间数据（下同）。

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

国联安价值优选股票型证券投资基金(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”)证监许可[2018]第 985 号《关于准予国联安价值优选股票型证券投资基金注册的批复》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《国联安价值优选股票型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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 290,177,243.91 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1800184 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安价值优选股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 290,267,911.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 90,667.72 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(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安价值优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；权证投资占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

### 6.4.2 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》、《国联安价值优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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)对于内地投资者持有的基金类别，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。

对基金通过沪港通及深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通及深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通及深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

## 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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 878,805.35             |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 878,805.35             |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |               |              |
|---------------|------------------------|---------------|--------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 16,473,212.08          | 18,570,782.00 | 2,097,569.92 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场                  | 299,505.00    | 299,760.00   |
|               | 银行间市场                  | -             | -            |
|               | 合计                     | 299,505.00    | 299,760.00   |
| 资产支持证券        | -                      | -             | -            |
| 基金            | -                      | -             | -            |
| 其他            | -                      | -             | -            |
| 合计            | 16,772,717.08          | 18,870,542.00 | 2,097,824.92 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有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

本基金本报告期末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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 180.22                 |
| 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  | 6.10                   |
| 应收债券利息     | 3,132.74               |
| 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         | 11.70                  |
| 合计         | 3,330.76               |

注：此处其他列示的是应收交易保证金利息。

#### 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<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 8,630.76          |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 8,630.76          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 1,187.60          |
| 预提审计费       | 32,232.48         |
| 预提信息披露费     | 59,507.37         |
| 预提账户维护费     | 4,500.00          |
| 合计          | 97,427.45         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 103,103,438.33             | 103,103,438.33 |
| 本期申购          | 9,809,135.15               | 9,809,135.15   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -96,995,484.04             | -96,995,484.04 |
| 本期末           | 15,917,089.44              | 15,917,089.44  |

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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 | -73,426.03 | -2,605,060.38 | -2,678,486.41 |

|                |               |               |                |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期利润           | 10,770,132.84 | 4,457,215.04  | 15,227,347.88  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,591,595.26 | -4,406,298.45 | -8,997,893.71  |
| 其中：基金申购款       | 2,833,659.94  | -235,722.45   | 2,597,937.49   |
| 基金赎回款          | -7,425,255.20 | -4,170,576.00 | -11,595,831.20 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -              |
| 本期末            | 6,105,111.55  | -2,554,143.79 | 3,550,967.76   |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 23,907.43                  |
| 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 | 723.62                     |
| 其他        | 266.63                     |
| 合计        | 24,897.68                  |

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入和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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 66,413,332.76              |
| 减：卖出股票成本总额 | 55,632,305.74              |
| 买卖股票差价收入   | 10,781,027.02              |

#### 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<br>2019年1月1日至2019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 | -25,057.50                 |
| 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                           | -25,057.50                 |

##### 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 15,855,060.63              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 15,380,616.10              |
| 减：应收利息总额               | 499,502.03                 |
| 买卖债券差价收入               | -25,057.50                 |

**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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 277,929.57                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 277,929.57                 |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 4,457,215.04               |
| ——股票投资     | 4,456,956.34               |
| ——债券投资     | 258.70                     |
| ——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<br>预估增值税 | -            |
| 合计                         | 4,457,215.04 |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 271,489.58                 |
| 转换费收入   | 104.46                     |
| 合计      | 271,594.04                 |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 142,135.72                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 交易基金产生的费用 | -                          |
| 其中：申购费    | -                          |
| 赎回费       | -                          |
| 合计        | 142,135.72                 |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 32,232.48                  |
| 信息披露费    | 59,507.37                  |
| 银行划款费用   | 3,174.83                   |
| 银行间帐户维护费 | 10,500.00                  |
| 合计       | 105,414.68                 |

**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，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

##### 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)   | 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            |
| 安联集团                   | 基金管理人的股东            |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无支付关联方的佣金。

##### 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                   |  |
|-----------------|----------------------|--|
|                 | 2019年1月1日至2019年6月30日 |  |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 343,721.65           |  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 251,100.06           |  |

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的 1.50% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   |  |
|----------------|----------------------|--|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 |  |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 57,286.82            |  |

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的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，无上年度可比期间数据。

##### 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

报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，无上年度可比期间数据。

##### 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                   |        |
|-------|----------------------|--------|
|       | 2019年1月1日至2019年6月30日 |        |
|       | 期末余额                 | 当期利息收入 |
|       |                      |        |

|      |            |           |
|------|------------|-----------|
| 建设银行 | 878,805.35 | 23,907.43 |
|------|------------|-----------|

注：本基金于 2018 年 9 月 20 日成立，无上年度可比期间数据。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 2019 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 13,442.26 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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

### 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0%（上年度 2018 年 12 月 31 日：0%）。

#### 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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的 10%。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，本基金的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票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金的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票未超过该上市公司可流通股票的 30%。

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。基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 19,749,347.35 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及

对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或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、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月30<br>日 | 1个月以<br>内  | 1-3<br>个月 | 6个月以<br>内 | 3个月<br>-1年 | 6个月<br>-1年 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|-----------------------|------------|-----------|-----------|------------|------------|------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                    |            |           |           |            |            |      |      |      |               |               |
| 银行存款                  | 878,805.35 | -         | -         | -          | -          | -    | -    | -    | -             | 878,805.35    |
| 结算备付金                 | 13,442.26  | -         | -         | -          | -          | -    | -    | -    | -             | 13,442.26     |
| 存出保证金                 | 26,032.52  | -         | -         | -          | -          | -    | -    | -    | -             | 26,032.52     |
| 交易性金融资产               | -          | -         | -         | 299,760.00 | -          | -    | -    | -    | 18,570,782.00 | 18,870,542.00 |
| 买入返售金融资产              | -          | -         | -         | -          | -          | -    | -    | -    | -             | -             |
| 应收证券清算款               | -          | -         | -         | -          | -          | -    | -    | -    | 180,982.64    | 180,982.64    |

|                     |               |       |       |               |        |      |      |      |               |               |
|---------------------|---------------|-------|-------|---------------|--------|------|------|------|---------------|---------------|
| 应收利息                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 3,330.76      | 3,330.76      |
| 应收股利                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | -             |
| 应收申购款               | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 4,717.43      | 4,717.43      |
| 其他资产                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | -             |
| 资产总计                | 918,280.13    | -     | -     | 299,760.00    | -      | -    | -    | -    | 18,759,812.83 | 19,977,852.96 |
| 负债                  |               |       |       |               |        |      |      |      |               |               |
| 卖出回购金融资产款           | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | -             |
| 应付证券清算款             | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 69.00         | 69.00         |
| 应付赎回款               | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 375,029.85    | 375,029.85    |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 24,547.50     | 24,547.50     |
| 应付托管费               | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 4,091.20      | 4,091.20      |
| 应付销售服务费             | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | -             |
| 应付交易费用              | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 8,630.76      | 8,630.76      |
| 应付税费                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | -             |
| 应付利息                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | -             |
| 其他负债                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 97,427.45     | 97,427.45     |
| 负债总计                | -             | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | 509,795.76    | 509,795.76    |
| 利率敏感度缺口             | 918,280.13    | -     | -     | 299,760.00    | -      | -    | -    | -    | 18,250,017.07 | 19,468,057.20 |
| 上年度末<br>2018年12月31日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 6个月以内 | 3个月-1年        | 6个月-1年 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                  |               |       |       |               |        |      |      |      |               |               |
| 银行存款                | 6,503,092.29  | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | 6,503,092.29  |
| 结算备付金               | 363,164.02    | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | 363,164.02    |
| 存出保证金               | 17,581.40     | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | 17,581.40     |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -     | 13,379,612.40 | -      | -    | -    | -    | 60,703,646.25 | 74,083,258.65 |
| 买入返售金融资产            | 20,000,000.00 | -     | -     | -             | -      | -    | -    | -    | -             | 20,000,000.00 |

|           |               |   |   |               |   |   |   |   |               |                |
|-----------|---------------|---|---|---------------|---|---|---|---|---------------|----------------|
| 应收证券清算款   | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 应收利息      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 415,596.63    | 415,596.63     |
| 应收股利      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 应收申购款     | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 1,440.39      | 1,440.39       |
| 其他资产      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 资产总计      | 26,883,837.71 | - | - | 13,379,612.40 | - | - | - | - | 61,120,683.27 | 101,384,133.38 |
| 负债        |               |   |   |               |   |   |   |   |               |                |
| 卖出回购金融资产款 | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 应付证券清算款   | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 243,277.64    | 243,277.64     |
| 应付赎回款     | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 300,395.72    | 300,395.72     |
| 应付管理人报酬   | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 132,779.60    | 132,779.60     |
| 应付托管费     | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 22,129.94     | 22,129.94      |
| 应付销售服务费   | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 应付交易费用    | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 74,844.10     | 74,844.10      |
| 应付税费      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 应付利息      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | -             | -              |
| 其他负债      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 185,754.46    | 185,754.46     |
| 负债总计      | -             | - | - | -             | - | - | - | - | 959,181.46    | 959,181.46     |
| 利率敏感度缺口   | 26,883,837.71 | - | - | 13,379,612.40 | - | - | - | - | 60,161,501.81 | 100,424,951.92 |

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

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 1.54%(上年度 2018 年 12 月 31 日：13.32%)，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析(上年度 2018 年 12 月 31 日：同)。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，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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<br>2019 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2018 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  | 18,570,782.00          | 95.39         | 60,703,646.25            | 60.45         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 299,760.00             | 1.54          | 13,379,612.40            | 13.32         |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -             | -                        | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -             | -                        | -             |
| 合计            | 18,870,542.00          | 96.93         | 74,083,258.65            | 73.77         |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。



## 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|    |                      | 本期末<br>2019年6月30日               | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加 1,190,510.28                 | 增加 1,199,672.73     |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 减少 1,190,510.28                 | 减少 1,199,672.73     |

## 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                  | 18,570,782.00 | 92.96         |
|    | 其中：股票                 | 18,570,782.00 | 92.96         |
| 2  | 基金投资                  | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资                | 299,760.00    | 1.50          |
|    | 其中：债券                 | 299,760.00    | 1.50          |
|    | 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<br>售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合<br>计      | 892,247.61    | 4.47          |
| 8  | 其他各项资产                | 215,063.35    | 1.08          |
| 9  | 合计                    | 19,977,852.96 | 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<br>（%） |
|----|----------|--------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -            | -                |
| B  | 采矿业      | 1,523,130.00 | 7.82             |
| C  | 制造业      | 8,204,002.00 | 42.14            |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| 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           | 2,495,280.00  | 12.82 |
| 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  | 284,480.00    | 1.46  |
| J | 金融业              | 2,897,320.00  | 14.88 |
| K | 房地产业             | 2,276,720.00  | 11.69 |
| L | 租赁和商务服务业         | 317,250.00    | 1.63  |
| M | 科学研究和技术服务业       | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 572,600.00    | 2.94  |
| 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               | 18,570,782.00 | 95.39 |

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  | 000028 | 国药一致 | 30,000  | 1,254,900.00 | 6.45         |
| 2  | 600511 | 国药股份 | 54,000  | 1,240,380.00 | 6.37         |
| 3  | 600486 | 扬农化工 | 22,000  | 1,203,400.00 | 6.18         |
| 4  | 000671 | 阳光城  | 182,000 | 1,179,360.00 | 6.06         |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 86,000  | 1,097,360.00 | 5.64         |
| 6  | 601688 | 华泰证券 | 48,000  | 1,071,360.00 | 5.50         |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 44,000  | 1,047,640.00 | 5.38         |
| 8  | 000902 | 新洋丰  | 96,000  | 1,030,080.00 | 5.29         |
| 9  | 600997 | 开滦股份 | 164,000 | 1,003,680.00 | 5.16         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 10 | 000923 | 河北宣工 | 57,000  | 975,270.00 | 5.01 |
| 11 | 600031 | 三一重工 | 68,000  | 889,440.00 | 4.57 |
| 12 | 601100 | 恒立液压 | 22,000  | 690,360.00 | 3.55 |
| 13 | 002706 | 良信电器 | 115,000 | 648,600.00 | 3.33 |
| 14 | 002159 | 三特索道 | 35,000  | 572,600.00 | 2.94 |
| 15 | 601699 | 潞安环能 | 69,000  | 547,860.00 | 2.81 |
| 16 | 002463 | 沪电股份 | 40,000  | 544,800.00 | 2.80 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 24,000  | 438,960.00 | 2.25 |
| 18 | 002643 | 万润股份 | 40,000  | 404,000.00 | 2.08 |
| 19 | 002572 | 索菲亚  | 20,000  | 371,200.00 | 1.91 |
| 20 | 002142 | 宁波银行 | 14,000  | 339,360.00 | 1.74 |
| 21 | 600138 | 中青旅  | 25,000  | 317,250.00 | 1.63 |
| 22 | 000400 | 许继电气 | 35,000  | 317,100.00 | 1.63 |
| 23 | 600380 | 健康元  | 36,000  | 311,400.00 | 1.60 |
| 24 | 300316 | 晶盛机电 | 24,000  | 304,560.00 | 1.56 |
| 25 | 300349 | 金卡智能 | 16,000  | 284,480.00 | 1.46 |
| 26 | 603365 | 水星家纺 | 15,000  | 271,350.00 | 1.39 |
| 27 | 002916 | 深南电路 | 2,100   | 214,032.00 | 1.10 |

#### 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  | 002159 | 三特索道 | 1,360,025.00 | 1.35            |
| 2  | 002706 | 良信电器 | 1,154,554.00 | 1.15            |
| 3  | 000923 | 河北宣工 | 1,036,140.00 | 1.03            |
| 4  | 601155 | 新城控股 | 750,700.00   | 0.75            |
| 5  | 000671 | 阳光城  | 538,000.00   | 0.54            |
| 6  | 002643 | 万润股份 | 483,500.00   | 0.48            |
| 7  | 300470 | 日机密封 | 478,150.00   | 0.48            |
| 8  | 603365 | 水星家纺 | 437,820.00   | 0.44            |
| 9  | 600486 | 扬农化工 | 352,186.00   | 0.35            |
| 10 | 600380 | 健康元  | 301,560.00   | 0.30            |
| 11 | 300349 | 金卡智能 | 294,770.00   | 0.29            |
| 12 | 600138 | 中青旅  | 254,200.00   | 0.25            |
| 13 | 600308 | 华泰股份 | 240,600.00   | 0.24            |
| 14 | 002916 | 深南电路 | 231,000.00   | 0.23            |
| 15 | 000902 | 新洋丰  | 178,000.00   | 0.18            |
| 16 | 002444 | 巨星科技 | 162,706.00   | 0.16            |
| 17 | 002948 | 青岛银行 | 94,522.24    | 0.09            |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 18 | 601100 | 恒立液压 | 88,560.00 | 0.09 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 87,450.00 | 0.09 |
| 20 | 000400 | 许继电气 | 82,960.00 | 0.08 |

#### 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  | 600486 | 扬农化工 | 6,582,417.00 | 6.55            |
| 2  | 000671 | 阳光城  | 5,550,436.00 | 5.53            |
| 3  | 000028 | 国药一致 | 5,331,872.02 | 5.31            |
| 4  | 600511 | 国药股份 | 5,249,524.58 | 5.23            |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 3,646,964.00 | 3.63            |
| 6  | 300054 | 鼎龙股份 | 3,304,430.00 | 3.29            |
| 7  | 601155 | 新城控股 | 2,828,720.00 | 2.82            |
| 8  | 603686 | 龙马环卫 | 2,407,253.00 | 2.40            |
| 9  | 600030 | 中信证券 | 2,268,070.00 | 2.26            |
| 10 | 601100 | 恒立液压 | 2,227,142.00 | 2.22            |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 2,178,618.80 | 2.17            |
| 12 | 002191 | 劲嘉股份 | 2,152,220.00 | 2.14            |
| 13 | 002142 | 宁波银行 | 1,883,590.00 | 1.88            |
| 14 | 300422 | 博世科  | 1,797,234.00 | 1.79            |
| 15 | 300398 | 飞凯材料 | 1,740,718.00 | 1.73            |
| 16 | 601699 | 潞安环能 | 1,720,710.00 | 1.71            |
| 17 | 601688 | 华泰证券 | 1,661,830.00 | 1.65            |
| 18 | 300316 | 晶盛机电 | 1,477,407.00 | 1.47            |
| 19 | 600138 | 中青旅  | 1,471,450.00 | 1.47            |
| 20 | 600380 | 健康元  | 1,432,589.00 | 1.43            |

#### 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 | 9,042,485.15  |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 66,413,332.76 |

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      | 299,760.00 | 1.54 |
| 2  | 央行票据      | -          | -    |
| 3  | 金融债券      | -          | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -    |
| 4  | 企业债券      | -          | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -    |
| 6  | 中期票据      | -          | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -          | -    |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 299,760.00 | 1.54 |

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  | 019611 | 19 国债 01 | 3,000 | 299,760.00 | 1.54         |

#### 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投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

## 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华泰证券和河北宣工外，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。

华泰证券（601688）的发行主体华泰证券股份有限公司因违反银行间市场相关自律管理规则于 2018 年 9 月 30 日被中国银行间市场交易商协会处以警告处分并责令整改。

河北宣工（000923）的发行主体河北宣化工程机械股份有限公司因违反《上市规则》第 2.1 条规定，于 2018 年 11 月 27 日收到深圳证券交易所公司管理部下发的《关于对河北宣化工程机械股份有限公司的监管函》。

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 | 26,032.52 |

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 180,982.64 |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | 3,330.76   |
| 5 | 应收申购款   | 4,717.43   |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 215,063.35 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 1,141    | 13,950.12     | 8,289.27 | 0.05%      | 15,908,800.17 | 99.95%     |

#### 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 | 2,001,136.35 | 12.57% |
|------------------|--------------|--------|

**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<br>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（2018年9月20日）基金份额总额 | 290,267,911.63 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 103,103,438.33 |
| 本报告期基金总申购份额               | 9,809,135.15   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 96,995,484.04  |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期末基金份额总额               | 15,917,089.44  |

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、2019年6月19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》，李柯女士担任公司首席信息官职务。

2、托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

**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**

本报告期内，基金管理人、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。

**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 |    |
| 东兴证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券股份有限公司   | 1      | 34,969,322.08 | 46.67%       | 32,567.11 | 47.16%     | -  |
| 华创证券有限责任公司   | 1      | 28,710,960.78 | 38.32%       | 26,164.36 | 37.89%     | -  |
| 东北证券股份有限公司   | 1      | 7,394,845.50  | 9.87%        | 6,738.87  | 9.76%      | -  |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | 3,851,085.40  | 5.14%        | 3,586.42  | 5.19%      | -  |

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

本报告期内退租申万宏源证券有限公司一个交易单元。

### 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 |
| 东兴证券股份有限公司   | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 西南证券股份有限公司   | 14,155,109.60 | 80.17%       | 15,000,000.00 | 100.00%      | -    | -            |
| 华创证券有限责任公司   | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 东北证券股份有限公司   | -             | -            | -             | -            | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司   | 3,500,954.00  | 19.83%       | -             | -            | -    | -            |

## 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  | 国联安价值优选股票型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告                                  | 证券时报、公司网站                  | 2019-01-19 |
| 2  | 国联安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司、钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2019-01-29 |
| 3  | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告                        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2019-02-15 |
| 4  | 国联安基金管理有限公司关于增加中证金牛(北京)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、转换及参加费率优惠的公告 | 中国证券报、公司网站                 | 2019-03-08 |
| 5  | 国联安基金管理有限公司关于调整旗下基金风险等级划分情况的公告                                   | 公司网站                       | 2019-03-08 |
| 6  | 国联安价值优选股票型证券投资基金 2018 年年度报告                                      | 证券时报、公司网站                  | 2019-03-30 |
| 7  | 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、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2019-04-01 |
| 8  | 国联安价值优选股票型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告                                  | 证券时报、公司网站                  | 2019-04-22 |
| 9  | 国联安价值优选股票型证券投资基金招募说明书(更新)  | 证券时报、公司网站                  | 2019-05-06 |
| 10 | 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、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2019-06-19 |
| 11 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2019-06-21 |
| 12 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券股份有限公司为代销机构的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2019-06-28 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安价值优选股票型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安价值优选股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安价值优选股票型证券投资基金招募说明书》

- 4、《国联安价值优选股票型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

### **11.2 存放地点**

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### **11.3 查阅方式**

网址：[www.epicfunds.com](http://www.epicfunds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日