

国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国联安安稳灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 002367 |
| 交易代码 | 002367 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 3 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 271,458,082.43 份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略 本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现 |

| | |
|--|---|
| | <p>金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健、具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。</p> <p>（1）定量分析</p> <p>本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。</p> <p>本基金考察的成长指标主要包括：主营收入增长率、净利润增长率。</p> <p>本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。</p> <p>本基金考察的估值指标主要包括：市盈率、市盈率/净利润增长率。</p> <p>（2）定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的经营情况，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备核心优势、经营稳健的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>（1）久期配置：基于宏观经济趋势性变化，自上而下的资产配置。</p> <p>利用宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本</p> |
|--|---|

| | |
|--|---|
| | <p>方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，为各种稳健收益类金融工具进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置。</p> <p>（2）期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。</p> <p>在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。</p> <p>子弹组合，即使组合的现金流尽量集中分布；杠铃组合，即使组合的现金流尽量呈两极分布；</p> <p>梯形组合，即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。</p> <p>（3）债券类别配置/个券选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。</p> <p>本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债等利率债券，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。</p> <p>个券选择：基于各个投资品种具体情况，自下而上的资产配置。</p> <p>个券选择应遵循如下原则：</p> <p>相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低品种。流动性原则：其它条件类似，选择流</p> |
|--|---|

动性较好的品种。

(4) 中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资策略，在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

4、权证投资策略

本基金在买入股票等风险资产时，同时投资以其为标的的看跌期权；或者在买入债券等稳健资产时，同时投资看涨期权，以实现控制下行风险、获取上行收益的目标。

本基金将在以上理论框架的基础上，运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。

5、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，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。

6、国债期货投资管理

| | |
|--------|---|
| | <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其长期平均预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 |
|-----------|----------------------------------|
| | (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日) |
| 1.本期已实现收益 | 11,799,104.90 |

| | |
|----------------|----------------|
| 2.本期利润 | 8,420,447.99 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0337 |
| 4.期末基金资产净值 | 431,304,827.05 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5888 |

注：1、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。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | 1.70% | 0.73% | -1.00% | 0.80% | 2.70% | -0.07% |
| 过去六个月 | 5.94% | 0.58% | 5.81% | 0.66% | 0.13% | -0.08% |
| 过去一年 | 48.58% | 1.00% | 18.92% | 0.66% | 29.66% | 0.34% |
| 过去三年 | 55.41% | 1.28% | 23.49% | 0.69% | 31.92% | 0.59% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 55.64% | 1.27% | 21.01% | 0.69% | 34.63% | 0.58% |

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 自基金转型以来基金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

国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金
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3月20日至2021年3月31日)



注：1、2018年3月12日，国联安安稳保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期。根据基金合同的约定，因未能符合保本基金存续条件，国联安安稳保本混合型证券投资基金自2018年3月20日（即保本期到期操作期间截止日的次日）起转型为非保本的混合型基金，更名为“国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金”，《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效；

2、本基金的业绩比较基准自2018年3月20日起变更为：沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%；

3、本基金的投资转型期为自本基金转型日起的6个月，投资转型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 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----|-------------|------|------------|--------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 邹新进 | 本基金 | 2018-03-20 | - | 17年(自2004) | 邹新进先生，硕士研究生。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|-----|--|
| | 基金经 理、兼 任国联 安德盛 小盘精 选证券 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、 国联安 添利增 长债券 型证券 投资基 金基金 经理、 权益投 资部总 经理。 | | | 年起) | 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，2019 年 12 月起兼任国联安添利增 长债券型证券投资基金的 基金经理。 |
|--|--|--|--|-----|--|

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

春节在某种程度上对于中国股市来说具有强烈的日历效应，今年也不例外。以 2021 年春节为界，持续 2 年多的结构性牛市告一段落，或者更准确地说，持续一年的疫情牛市和抱团牛市或已结束。疫情牛（抱团牛）的演绎动力来源：1）疫情导致上市公司的基本面发生变化，核心资产的相对确定性更强；2）疫情导致流动性泛滥，进而导致贴现率下降，远期确定性更强的核心资产 DCF 估值无限扩张；3）抱团资产的 K 线图好看，动量投资愈演愈烈；4）抱团基金净值表现与申购资金形成正循环。而随着疫情的缓解和局部抱团的难以为继（估值和集中度都达到了极致），春节之后的中国股市经过短期抱团资产的暴跌之后趋向于回归正常。我们投资的基本理念和策略依然是从性价比角度出发的价值投资，即关注公司的基本面，但也同时关注股票的估值，我们会综合评估股票的性价比并做出投资决策。在一季度的市场大幅震荡中，本基金保持了策略上的定力，依然取得了不错的正收益。从同业角度来说，我们的组合与主流公募基金的偏离较大，市场关注度很高且前期涨幅较大的板块如 TMT 和白酒配置都很低。这与我们的投资理念和经验相关，我们更加看重资产的安全性，也更愿意持有相对熟悉和有把握的资产即能力圈内的资产。当然，能力圈外的资产特别是市场关注度较高的，将是我们学习和反思的重点。对于接下去的市场形势，虽然目前的抱团核心资产仍难言企稳，但我们相信既不会是全面熊市，也不会是非核心资产的牛市，而是回归正常（既看基本面，也看估值）的市场趋势，这将更加考验投资和研究的能力，也更加体现

专业投资和研究的价值。

4.5 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 1.70%，同期业绩比较基准收益率为-1.00%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 183,830,240.68 | 39.30 |
| | 其中：股票 | 183,830,240.68 | 39.30 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 154,915,578.31 | 33.12 |
| | 其中：债券 | 154,915,578.31 | 33.12 |
| | 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 | 23,000,000.00 | 4.92 |
| | 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 | 52,760,863.86 | 11.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 53,225,905.30 | 11.38 |
| 9 | 合计 | 467,732,588.15 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 5,568,156.00 | 1.29 |
| C | 制造业 | 88,358,975.32 | 20.49 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 18,573,774.06 | 4.31 |
| 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 | 214,706.06 | 0.05 |
| J | 金融业 | 28,526,223.00 | 6.61 |
| K | 房地产业 | 32,356,728.30 | 7.50 |
| 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 | 10,207,641.82 | 2.37 |
| 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 | 183,830,240.68 | 42.62 |

5.2.2 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。

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 000028 | 国药一致 | 441,000 | 18,566,100.00 | 4.30 |
| 2 | 600597 | 光明乳业 | 1,000,000 | 18,330,000.00 | 4.25 |
| 3 | 000581 | 威孚高科 | 656,600 | 15,548,288.00 | 3.60 |
| 4 | 000671 | 阳光城 | 2,519,100 | 15,316,128.00 | 3.55 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|---------------|------|
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 521,500 | 12,562,935.00 | 2.91 |
| 6 | 600380 | 健康元 | 816,700 | 10,470,094.00 | 2.43 |
| 7 | 000002 | 万 科 A | 340,000 | 10,200,000.00 | 2.36 |
| 8 | 002706 | 良信股份 | 329,400 | 10,155,402.00 | 2.35 |
| 9 | 000910 | 大亚圣象 | 634,200 | 9,944,256.00 | 2.31 |
| 10 | 002159 | 三特索道 | 731,100 | 8,824,377.00 | 2.05 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 28,441,698.00 | 6.59 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 126,276,882.90 | 29.28 |
| | 其中：政策性金融债 | 126,276,882.90 | 29.28 |
| 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） | 196,997.41 | 0.05 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 154,915,578.31 | 35.92 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 108604 | 国开 1805 | 450,000 | 45,247,500.00 | 10.49 |
| 2 | 018006 | 国开 1702 | 316,110 | 32,006,137.50 | 7.42 |
| 3 | 010303 | 03 国债(3) | 281,100 | 28,441,698.00 | 6.59 |
| 4 | 018082 | 农发 1902 | 275,410 | 27,722,770.60 | 6.43 |
| 5 | 018010 | 国开 1902 | 212,410 | 21,300,474.80 | 4.94 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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阳光城、国药一致和兴业银行外，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。

阳光城（000671）的发行主体阳光城集团股份有限公司，因存在未披露财务资助

的表外项目，于 2020 年 5 月 27 日被深交所出具监管函。

国药一致（000028）的发行主体国药集团一致药业股份有限公司，因涉嫌销售不符合标准医疗器械，于 2021 年 3 月 22 日被深圳市市场监督管理局福田局没收违法所得、没收非法财物。

兴业银行（601166）的发行主体兴业银行股份有限公司，因同业投资用途不合规、授信管理不尽职等违法违规事由，于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局合计罚没 2232.36 万元。因在作为永城煤电控股集团有限公司主承销商期间存在涉嫌违反银行间债券市场自律管理规则的行为，于 2021 年 1 月 15 日被中国银行间市场交易商协会采取通报批评、责令整改的行政监管措施，并将有关违规情况报送中国人民银行、中国银保监会。因作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本，于 2020 年 5 月 15 日被中国银行间市场交易商协会予以警告，并责令整改。福州分行因违规转接清算、银行卡收单外包等违法违规行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行罚没 2469.953 万元。上海分行因同业资金违规用于股权投资、房地产项目等违法违规行为，于 2020 年 7 月 28 日被银保监会上海监管局责令改正并处罚款 450 万元。福州三明分行因为非法交易平台提供条码支付服务等五项违规行为，于 2020 年 6 月 9 日被中国人民银行福州中心支行累计罚没 376.53 万元。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 123,035.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | 303,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,605,110.08 |
| 5 | 应收申购款 | 49,194,759.71 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 53,225,905.30 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 317,912,780.21 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 70,551,255.12 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 117,005,952.90 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 271,458,082.43 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安安稳保本混合型证券投资基金（现国联安安稳灵活配置混合

型证券投资基金) 发行及募集的文件

- 2、《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安安稳灵活配置混合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

8.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

8.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司
二〇二一年四月二十二日