

国联安安泰灵活配置混合型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国联安安泰灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 000058 |
| 交易代码 | 000058 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 6 月 5 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 542,113,367.76 份 |
| 投资目标 | 通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中的潜在投资机会，实现基金资产长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 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。本基金主要根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险筛选出备选股票池。并在此基础上通过定性和定量相结合的方法，主要通过对品质、成长性和估值三个方面进行评估，筛选出各个子行业中具有竞争优势的优质上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45% |
| 风险收益特征 | 本基金为灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，风险与预期收益高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金。 |
| 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 |

§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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |
| 1.本期已实现收益 | 27,146,807.65 |
| 2.本期利润 | 2,349,793.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0068 |
| 4.期末基金资产净值 | 801,340,151.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4782 |

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 | 1.05% | 0.38% | -3.08% | 0.66% | 4.13% | -0.28% |
| 过去六个月 | 3.54% | 0.34% | -0.79% | 0.60% | 4.33% | -0.26% |
| 过去一年 | 10.92% | 0.39% | 5.41% | 0.67% | 5.51% | -0.28% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 41.48% | 0.61% | 24.56% | 0.69% | 16.92% | -0.08% |

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

国联安安泰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
(2019 年 6 月 5 日至 2021 年 9 月 30 日)



- 注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%；
- 2、本基金基金合同于2019年6月5日生效；
- 3、本基金的投资转型期为基金合同生效日起的3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 | | |
| 林涿 | 本基金基金经理、兼任国联安鑫发混合型证券投资基金 | 2019-07-05 | - | 10年(自2011年起) | 林涿先生，硕士研究生。2011年4月至2014年11月在国金证券股份有限公司研究所担任分析师。2014年12月加入国联安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2019年6月起担任国联安鑫发混合 |

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|-------------------|---|
| | 基金经 理、国 联安新 精选灵 活配置 混合型 证券投资 基金基 金经 理、国 联安鑫 稳 3 个 月持有 期混合 型证券 投资基 金基 金经 理、 国联安 鑫元 1 个月持 有期混 合型证 券投资 基金基 金经 理。 | | | | 型证券投资基金的基金经 理,2019 年 7 月起担任国联 安安泰灵活配置混合型证 券投资基金的基金经理, 2020 年 11 月起兼任国联安 新精选灵活配置混合型证 券投资基金的基金经理, 2021 年 6 月起兼任国联安 鑫稳 3 个月持有期混合型证 券投资基金的基金经理, 2021 年 8 月起兼任国联安 鑫元 1 个月持有期混合型证 券投资基金的基金经理。 |
| 洪阳珧 | 本基金 基金经 理、兼 任国联 安 6 个 月定期 开放债 券型证 券投资 基金基 金经 理、国 联安短 债债券 型证券 投资基 金基 金 | 2020-11-17 | - | 8 年(自 2013 年起) | 洪阳珧先生, 学士学位。 2014 年 9 月至 2018 年 7 月 在富国基金管理有限公司 工作, 历任运营部基金会计 助理、固定收益部风控员。 2018 年 7 月加入国联安基 金管理有限公司, 历任固定 收益部基金经理助理、现金 管理部基金经理助理。2019 年 9 月起担任国联安货币市 场证券投资基金的基金经 理, 2020 年 2 月起兼任国联 安 6 个月定期开放债券型证 券投资基金和国联安短债 债券型证券投资基金的基 金经理, 2020 年 11 月起兼 任国联安睿祺灵活配置混 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 经理、 国联安 货币市 场证券 投资基 金基金 经理、 国联安 中债 1-3 年 政策性 金融债 指数证 券投资 基金基 金经 理、国 联安睿 祺灵活 配置混 合型证 券投资 基金基 金经 理、国 联安新 精选灵 活配置 混合型 证券投 资基金 基金经 理。 | | | | 合型证券投资基金、国联安 中债 1-3 年政策性金融债指 数证券投资基金和国联安 安泰灵活配置混合型证券 投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国联安新精选 灵活配置混合型证券投资 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》、《国联安安泰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超过该证券当日成交量 5% 的交易次数为 1 次，发生原因是为了满足产品合同中相关投资比例的限制要求。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

权益部分：整个三季度市场一直反映的都是经济偏弱、流动性不会更紧的场景，所以高增长的公司是相对稀缺的。因此我们延续着业绩这条主线，略微淡化估值的考量，主要挖掘业绩亮眼，且未来 2-4 个季度业绩确定性较高、增长性较强的公司进行投资，这里面包括了电动车、半导体、光伏这些超高景气赛道以及有色化工等部分偏上游的品种。作为对经济偏弱后续可能会有政策对冲的情景假设，本基金也提前布局了一些与基建相关的公司，包括电网投资、水泥等相关品种，取得较好收益。由于本基金的权益策略是兼顾收益以及控制最大回撤，因此所投资行业相对均衡，消费、医药等板块在报告期内表现较差，但其中的优质品种其实所隐含的预期回报率又更加提升，我们对这部分持仓依然很有信心。后续本基金依然会不断在高景气高估值高波动品种以及相对低估值“左侧”品种中做平衡。

固收部分：2021 年，央行货币政策委员会第三季度例会提出稳健的货币政策保持连续

性、稳定性、可持续性，科学管理市场预期，努力服务实体经济，有效防控金融风险。

2021 年 7 月 9 日，中国人民银行决定于 2021 年 7 月 15 日下调金融机构存款准备金率 0.5%，降准释放长期资金约 1 万亿元。降准之后货币政策维持平稳操作，但地产和城投监管未见放松，经济下行压力逐步加大的背景下，债券市场进入宽信用和宽货币的博弈。在此基础上，十年期国债到期收益率从 3.1% 附近下行至 2.9% 左右。9 月 MLF 等额续作，回笼量继续下降，从 9 月 17 日开始，央行重启并连续开展 14 天逆回购，以维护季末流动性平稳。

报告期内，本基金仍以利息和骑乘为主要策略，通过久期和杠杆调整，灵活应对市场波动。

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 1.05%，同期业绩比较基准收益率为-3.08%。

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 | 249,529,235.82 | 30.90 |
| | 其中：股票 | 249,529,235.82 | 30.90 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 539,676,717.00 | 66.82 |
| | 其中：债券 | 539,676,717.00 | 66.82 |
| | 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 | 12,599,462.30 | 1.56 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,806,667.76 | 0.72 |
| 9 | 合计 | 807,612,082.88 | 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 | 18,116.82 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 4,767,525.00 | 0.59 |
| C | 制造业 | 157,660,798.10 | 19.67 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,745,200.00 | 0.84 |
| E | 建筑业 | 20,183.39 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 77,729.83 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 40,233.44 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,319,100.00 | 0.54 |
| J | 金融业 | 58,908,012.00 | 7.35 |
| K | 房地产业 | 10,427,455.00 | 1.30 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,317,680.00 | 0.16 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,749,015.84 | 0.22 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,684,613.78 | 0.34 |
| 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 | 793,572.62 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 249,529,235.82 | 31.14 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 601288 | 农业银行 | 7,400,000 | 21,756,000.00 | 2.71 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 2,296,000 | 13,707,120.00 | 1.71 |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 85,000 | 9,073,750.00 | 1.13 |
| 4 | 000002 | 万科A | 400,500 | 8,534,655.00 | 1.07 |
| 5 | 002353 | 杰瑞股份 | 158,200 | 7,660,044.00 | 0.96 |
| 6 | 000301 | 东方盛虹 | 266,000 | 7,479,920.00 | 0.93 |
| 7 | 002384 | 东山精密 | 352,800 | 7,366,464.00 | 0.92 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 204,000 | 7,284,840.00 | 0.91 |
| 9 | 600900 | 长江电力 | 306,600 | 6,745,200.00 | 0.84 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 30,200 | 6,625,578.00 | 0.83 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本报告期末本基金未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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 | 20,128,000.00 | 2.51 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 224,217,492.80 | 27.98 |
| | 其中：政策性金融债 | 203,937,492.80 | 25.45 |
| 4 | 企业债券 | 24,919,000.00 | 3.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 231,008,000.00 | 28.83 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 492,224.20 | 0.06 |

| | | | |
|----|------|----------------|-------|
| 8 | 同业存单 | 38,912,000.00 | 4.86 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 539,676,717.00 | 67.35 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 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 | 200207 | 20 国开 07 | 500,000 | 50,300,000.00 | 6.28 |
| 2 | 200212 | 20 国开 12 | 400,000 | 40,548,000.00 | 5.06 |
| 3 | 102101212 | 21 电网 MTN006(可 持续挂钩) | 400,000 | 40,064,000.00 | 5.00 |
| 4 | 102101888 | 21 中电投 MTN010 | 400,000 | 40,012,000.00 | 4.99 |
| 5 | 102100655 | 21 南电 MTN002(乡 村振兴) | 300,000 | 30,408,000.00 | 3.79 |

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，有选择地投资于股指期货，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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

本报告期末本基金未持有国债期货，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

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，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交通银行和农业银行外，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。

21 交通银行小微债（2128013）的发行主体交通银行股份有限公司，北京市分行因理财业务投资运作管理不规范、个人消费贷款业务贷后风控措施严重不到位等违法违规问题，于 2021 年 9 月 26 日被北京银保监局采取责令改正的行政处罚措施，并处以罚款 230 万元。温州分行因内控管理严重缺失、客户经理利用职务便利办理虚假抵押贷款，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，于 2020 年 11 月 3 日被中国银保监会温州监管分局罚款 2820 万元。深圳分行因并购贷款管理不到位、违规为地方政府提供融资等违法违规行为，于 2021 年 3 月 16 日被深圳银保监局罚款 290 万元。

农业银行（601288）的发行主体中国农业银行股份有限公司，因收取已签约开立的代发工资

账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费，于 2020 年 12 月 7 日被中国银保监会合计罚没 198.36 万元。因发生重要信息系统突发事件未报告等违法违规行为，于 2021 年 1 月 19 日被中国银保监会罚款 420 万元。深圳市分行因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，于 2020 年 12 月 30 日被中国人民银行深圳中心支行罚款 230 万元。吉林市江北分行因侵害消费者个人信息依法得到保护的权利、违反反洗钱管理规定泄露客户信息，于 2020 年 10 月 20 日被中国人民银行吉林市中心支行罚款 1223 万元。南平分行人因贷后管理不到位，导致个人信贷资金流入股市等违法违规行为，于 2021 年 7 月 24 日被中国银保监会南平监管分局没收违法所得 4.8 万元，并处以合计 250 万元罚款。云南省分行因未经任职资格核准履行高级管理人员职责等违法违规行为，于 2021 年 6 月 7 日被中国银保监会云南监管局处以罚款 420 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 | 49,283.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,734,155.21 |
| 5 | 应收申购款 | 23,229.11 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,806,667.76 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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 | 308,467,613.74 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 284,679,035.46 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 51,033,281.44 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 542,113,367.76 |

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 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|------------------------|---------------|----------------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2021年9月13日至2021年9月13日 | 47,110,295.14 | 53,697,811.79 | - | 100,808,106.93 | 18.60% |
| | 2 | 2021年9月14日至2021年9月30日 | - | 139,121,582.45 | - | 139,121,582.45 | 25.66% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| (1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回 | | | | | | | |

款项延期获得。

(2) 基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

(3) 基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安保本混合型证券投资基金（现国联安安泰灵活配置混合型证券投资基金）发行及募集的文件
- 2、《国联安安泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安安泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安安泰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

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日