

国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安睿祺灵活配置混合
基金主代码	001157
交易代码	001157
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 8 日
报告期末基金份额总额	302,908,120.85 份
投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司力争获得长期稳定的收益。
投资策略	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。
业绩比较基准	沪深 300 指数×50%+上证国债指数×50%
风险收益特征	本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较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	招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
	(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	93,317.84
2.本期利润	-14,950,614.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0491
4.期末基金资产净值	511,318,449.05
5.期末基金份额净值	1.6880

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	-2.83%	0.23%	-7.28%	0.44%	4.45%	-0.21%
过去六个月	0.25%	0.27%	-3.77%	0.60%	4.02%	-0.33%
过去一年	-0.30%	0.25%	-9.29%	0.59%	8.99%	-0.34%
过去三年	33.52%	0.31%	7.61%	0.63%	25.91%	-0.32%
过去五年	64.27%	0.51%	13.33%	0.64%	50.94%	-0.13%
自基金合同生效起至今	68.80%	0.44%	14.64%	0.72%	54.16%	-0.28%

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

国联安睿祺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
(2015 年 4 月 8 日至 2022 年 9 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为：沪深300指数×50%+上证国债指数×50%；
2、本基金基金合同于2015年4月8日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，

建仓期结束时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。

§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		
洪阳场	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	2020-11-17	-	9 年(自 2013 年起)	洪阳场先生，学士学位。曾任富国基金管理有限公司基金会计助理、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、基金经理。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 月起兼任国联安短债债券型证券投资基金和国联安 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 11 月起兼任国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金、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；2022 年 6 月起兼任国联安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。

	<p>指数证券投资基金基金经理、国联安安泰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、国联安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。</p>				
王欢	<p>本基金基金经理、兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫享灵活</p>	2019-06-18	-	14 年（自 2008 年起）	<p>王欢先生，硕士研究生。曾任华宝兴业基金管理有限公司研究员。2014 年 6 月加入国联安基金管理有限公司，历任研究员、专户投资经理、基金经理。2017 年 12 月起担任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金和国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月至 2022 年 9 月兼任国联安信心增长债券型证券投资基</p>

	配置混合型证券投资基金基金经理、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫乾混合型证券投资基金基金经理。				金的基金经理；2017 年 12 月至 2020 年 5 月兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 6 月起兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月至 2021 年 12 月兼任国联安添利增长债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 11 月起兼任国联安鑫乾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》、《国联安睿祺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

权益投资部分：三季度初我们对市场总体的判断是弱经济，流动性尚可；而预期之外的因素主要是地缘冲突的深化和影响扩散以及国内消费实际恢复低于预期。基于此，我们认为全球衰退的风险在增大，同时地缘冲突的不可控进一步加剧了未来的进一步摩擦，这些可能都会带来相关权益资产的风险。在这种背景下，我们在三季度相对增持了一些相对偏内循环又在国民经济中有明显影响的品种，比如煤炭、汽车和地产。同时，三季度后半段的调整幅度和速度确实也超出了预期，这种情况下，我们也更需要坚持一贯的基本面出发，认真筛选，争取在充满不确定的市场上获得相对稳健的业绩回报。

固定收益部分：三季度，央行政策例会中指出稳健的货币政策灵活适度，保持连续性、稳定性、可持续性，科学管理市场预期，切实服务实体经济，有效防控金融风险。

三季度，债市总体走势呈先下行后上行趋势。8 月 15 日，7 天逆回购利率和 1 年期 MLF 利率均下调了 10bp。在此节点之前，市场流动性持续宽松，且宏观政策工具并未超预期。另外由于地产风波等因素对经济基本面造成负面影响，债市收益率以下行趋势为主。之后随着 mlf 缩量 2000 亿，资金面边际有所缩紧，加权利率逐渐提升。且随着国内房地产政策持续宽松、美国加息及人民币兑美元持续贬值，债券利率出现了明显的上行趋势。

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-2.83%，同期业绩比较基准收益率为-7.28%。

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	121,037,452.83	23.60
	其中：股票	121,037,452.83	23.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	384,337,562.39	74.93
	其中：债券	384,337,562.39	74.93
	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	6,233,476.10	1.22
8	其他各项资产	1,294,411.75	0.25
9	合计	512,902,903.07	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	6,156,761.68	1.20
C	制造业	80,604,869.66	15.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,696,800.00	0.92
E	建筑业	515,000.00	0.10
F	批发和零售业	2,179,399.98	0.43
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	2,400,786.04	0.47
J	金融业	13,205,282.00	2.58
K	房地产业	4,709,800.00	0.92
L	租赁和商务服务业	1,999,513.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	2,601,359.75	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	1,931,099.22	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,314.50	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,467.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	121,037,452.83	23.67

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 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	600519	贵州茅台	4,200	7,864,500.00	1.54
2	600926	杭州银行	330,000	4,702,500.00	0.92
3	601238	广汽集团	360,000	4,366,800.00	0.85
4	000933	神火股份	260,000	4,365,400.00	0.85

5	002594	比亚迪	17,000	4,284,170.00	0.84
6	000581	威孚高科	235,200	4,057,200.00	0.79
7	603035	常熟汽饰	220,000	3,867,600.00	0.76
8	000858	五粮液	22,000	3,723,060.00	0.73
9	000002	万科A	200,000	3,566,000.00	0.70
10	300760	迈瑞医疗	10,500	3,139,500.00	0.61

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,347,068.76	23.93
	其中：政策性金融债	50,805,386.57	9.94
4	企业债券	22,247,291.37	4.35
5	企业短期融资券	10,171,423.56	1.99
6	中期票据	226,802,066.85	44.36
7	可转债（可交换债）	2,769,711.85	0.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	384,337,562.39	75.17

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	2228046	22 中信银行 02	300,000	30,087,698.63	5.88
2	102002212	20 广州地铁 MTN003	200,000	21,022,739.73	4.11
3	102102177	21 苏交通 MTN008	200,000	20,883,607.67	4.08

4	102100292	21 南电 MTN001	200,000	20,829,755.62	4.07
5	2128035	21 华夏银 行 02	200,000	20,783,671.23	4.06

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，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中信银行、广州地铁、交通银行和华夏银行外，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。

22 中信银行 02 (2228046) 的发行主体中信银行股份有限公司，厦门分行因抵押物价值审查不严格、未落实授信审批意见发放贷款、贷前未揭示关联关系以及贷后管理不到位导致贷款回流挪用，于 2021 年 11 月 19 日被厦门银保监局处以罚款 950 万元。南昌分行因 1、漏报投诉数据；2、提供虚假的金融统计数据；3、未按规定向人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；4、未按规定履行客户身份识别义务；5、发现假币未收缴；6、未按规定收缴假币；7、现金从业人员不具备反假专业能力；8、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 12 月 31 日被央行南昌中心支行处以罚款 442 万元。沈阳分行因 1、违反金融消费者权益保护制度建设、消费者金融信息保护、金融营销宣传、金融消费争议解决等相关管理规定；2、违反人民币银行结算账户管理相关规定；3、未按规定履行假币收缴程序；4、违反规定占压财政资金；5、未按规定履行客户身份识别义务，于 2022 年 2 月 9 日被央行沈阳分行处以罚款 240.6 万元。因中信银行监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在漏报抵押物价值 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据等六项违法违规行为、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产以及 2018 年行政处罚问题依然存在，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 290 万元。宁波分行因 1、通过借名贷款为房地产企业融资；2、贷款调查审查不尽职、信贷资金违规流入房地产领域；3、房地产业务管理不审慎；4、违规办理无真实贸易背景的票据及信用证业务；5、违规办理自营非标业务；6、贷款管理不审慎；7、违规掩盖及处置不良资产；8、保险代理业务管理不规范，于 2022 年 4 月 11 日被宁波银保监局处以罚款 340 万元。广州增城支行因贷款业务严重违反审慎经营规则，于 2022 年 7 月 22 日被广东银保监局处以罚款 660 万元。杭州分行因 1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；3、与身份不明的客户进行交易，于 2022 年 8 月 10 日被央行杭州中心支行处以罚款 330 万元。嘉兴分行因 1、贷款“三查”不到位，部分流动资金贷款被挪用于土地竞拍保证金；2、贷款“三查”不到位，部分流动资金贷款被挪用于非上市公司股权投资；3、向项目资本金不足房地产企业发放房地产开发贷款；4、未按工程进度发放固定资产贷款；5、贷款“三查”不到位，个人消费贷款被挪用于购房；6、贷款“三查”不到位，个人消费贷款被挪用于股市，于 2022 年 8 月 30 日被嘉兴银保监分局处以罚款 205 万元。

20 广州地铁 MTN003（102002212）的发行主体广州地铁集团有限公司，因未经批准临时占用绿地，于 2022 年 1 月 7 日被广州市越秀区建设和水务局处以罚款 184.95 万元。

21 交通银行小微债（2128013）的发行主体交通银行股份有限公司，因 1、未按规定办理内存外贷业务； 2、未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务； 3、未经登记办理外国投资者投资资金汇出业务； 4、违规办理个人境内银行卡境外年度超额提现； 5、违规向非居民销售外汇理财产品； 6、违反外汇市场交易管理规定； 7、未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料； 8、违反外汇账户管理规定，于 2021 年 10 月 20 日被国家外汇管理局上海市分局罚款 340.00 万元。因交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报不良贷款余额 EAST 数据、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差等十三项违法违规行为、理财产品登记不规范以及 2018 年行政处罚问题依然存在，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 420 万元。陕西省分行因 1、信贷业务违规； 2、未按规定对保险代理机构从业人员进行执业登记和管理； 3、保险代理业务档案不完整； 4、违反规定开展互联网保险业务，于 2022 年 5 月 17 日被陕西银保监局处以罚款 247.3 万元。

21 华夏银行 02（2128035）的发行主体华夏银行股份有限公司，厦门分行因 1、部分分支机构基金销售业务负责人未取得基金从业资格； 2、部分未取得基金从业资格的员工参与销售基金； 3、投资者适当性管理不到位,部分私募资产管理计划的投资者提供的证明材料不足以证明其符合合格投资者条件； 4、未按要求报备反洗钱工作相关材料，于 2021 年 12 月 9 日被厦门证监局采取责令改正的行政监管措施。南京分行因 1.以多种方式违规掩盖风险； 2.贷款管理不到位，违规挪用信贷资金收购不良资产，于 2021 年 12 月 28 日被央行南京分行处以罚款 189 万元。重庆分行因 1.以多种方式违规掩盖风险； 2.贷款管理不到位，违规挪用信贷资金收购不良资产，于 2021 年 12 月 30 日被重庆银保监局处以罚款 950 万元。沈阳分行因 1、违反金融营销宣传、金融消费争议解决相关规定； 2、违反人民币银行结算账户管理相关规定； 3、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送可疑交易报告，于 2022 年 1 月 17 日被央行沈阳分行处以罚款 198 万元。上海分行及其分支机构因存在发放个人经营贷款违规用于购房、发放个人经营贷款违规流入资本市场、发放个人住房贷款首付资金审核严重违反审慎经营规则等八项违法违规行为，于 2022 年 1 月 25 日被上海银保监局处以罚款 320 万元。因华夏银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报抵押物价值 EAST 数据、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据、漏报债券投资业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据、

漏报公募基金投资业务 EAST 数据等十八项违法违规行为,于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 460 万元。南宁分行因 1、贷款管理不到位流动资金贷款被挪用于房地产开发企业; 2、贷款管理不到位信用卡资金被挪用于限控领域; 3、违规以贷转存滚动办理存单质押贷款; 4、贷款管理不到位形成不良; 5、员工消费贷款违规挪用于限控领域; 6、侵害消费者合法权益; 7、利用同业存款虚增一般性存款问题屡查屡犯,于 2022 年 5 月 5 日被广西银保监局处以罚款 285 万元。武汉分行因 1、经营性物业抵押贷款发放不审慎,部分贷款资金未按约定用途使用,且风险分类不准确; 2、通过以贷还贷方式延缓风险暴露; 3、向不具备贷款主体资格的借款人发放贷款,以贷收息,延缓风险暴露; 4、通过借新还旧和贷款展期等方式延缓风险暴露; 5、贷款被挪用于银行承兑汇票保证金并通过重组掩盖不良; 6、未落实授信批复条件,向房地产企业发放流动资金贷款用于偿还银行承兑汇票,延缓风险暴露; 7、以贷款资金开立定期存单并质押发放贷款,虚增资产负债规模; 8、贷后管理不尽职,贷款资金被挪用于购买理财和归还关联企业贷款; 9、贷后管理不尽职,贷款资金回流借款人账户; 10、个人消费贷款违规流入房地产领域; 11、向关系人发放担保贷款的条件优于其他借款人同类贷款条件; 12、未落实授信条件且未严格审核投资用途,于 2022 年 5 月 16 日被湖北银保监局处以罚款 536.24 万元。武汉分行因 1、贷后管理不尽职,个人经营贷被挪用于归还商用房贷款; 2、贷款管理不审慎,流动资金贷款用于固定资产项目建设; 3、贷后管理不尽职,信贷资金回流借款人及关联企业本行账户后被挪用; 4、对贷款用途审查不尽职,信贷资金未按约定用途使用; 5、信贷资金挪作银行承兑汇票保证金; 6、向不具备贷款主体资格的借款人发放贷款掩盖风险; 7、违规宣传理财及代销保险产品; 8、服务收费管理不规范,于 2022 年 8 月 5 日被湖北银保监局处以罚款 270 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	16,229.30
2	应收证券清算款	1,264,069.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	14,112.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,294,411.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110079	杭银转债	2,461,661.37	0.48
2	113052	兴业转债	308,050.48	0.06

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	306,412,350.02
报告期期间基金总申购份额	675,026.21
减：报告期期间基金总赎回份额	4,179,255.38
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	302,908,120.85

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	2022年7月1日至2022年9月30日	70,200,269.19	0.00	0.00	70,200,269.19	23.18%
个人	1	2022年7月1日至2022年9月30日	78,697,589.07	0.00	0.00	78,697,589.07	25.98%
产品特有风险							
<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>							

§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睿祺灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安睿祺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

二〇二二年十月二十六日