

国联安德盛红利混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
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
5 托管人报告	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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	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
7 投资组合报告	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.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
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
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
9 开放式基金份额变动	42
10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安德盛红利混合型证券投资基金	
基金简称	国联安红利混合	
基金主代码	257040	
交易代码	257040(前端)	257041(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 10 月 22 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	
报告期末基金份额总额	62,186,713.24 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于盈利稳定增长的、具有较高股息收益率的、财务稳健的上市公司，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金属于混合型基金，在运作期间，本基金将分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析，在股票与债券资产之间进行策略性资产配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合，规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>(二) 行业及股票投资策略</p> <p>本基金将个股选择做为投资重点。行业配置是在股票选择的基础之上形成。即在构建组合的过程中，会首先优选出具有较高分红预期的公司。在此基础上，通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，同时考虑行业的成长性，得出各行业的相对投资价值与投资时机，结合这些行业评估值来确定上述公司的配置比例。我们主要对行业经济基本面因素、上市公司基本面因素以及证券市场交易信息这三类相关因素进行分析，最终形成本基金的行业配置。</p> <p>(三) 个股选择</p> <p>本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略，精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象，以增强本基金的股息收益和资本增值能力。本基金投资于红利型股票的比例不低于本基金持有的股票资产的 80%。</p> <p>1、确定备选股</p> <p>本基金综合考察上市公司分红记录和分红预期等指标来确定基金的股票备选库。具体选股标准包括满足以下一项或多项特征的股票：</p> <p>(1) 过去三年内具有较高的分红率的公司，其中分红包括现金股利和股票股利；</p> <p>(2) 预期今后股息分配率提高的公司；</p> <p>(3) 预期每股收益大幅提高的公司。</p>

	<p>2、在备选股的基础上，通过毛利率，费用指标、资产负债率等财务指标的分析构建核心股票库。</p> <p>3、在核心股票库的基础上通过公司研究员对公司的实地调研和安联的草根研究方法对上市公司的成长性等进行深入一系列衡量构建本公司的投资组合。</p> <p>（四）债券投资</p> <p>基于策略性资产配置的需要，本基金在预期股票市场阶段性回报率低于债券资产回报率时，本基金将会将一部分基金资产投资于国债、金融债、中央银行票据及企业债券等固定收益资产。本基金在固定收益证券投资与研究方面，实行投资策略研究专业化分工制度，专业研究人员分别从利率、信用风险等角度，提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略，具体包括利率策略、信用策略、债券选择策略等。本基金在固定收益证券总体指导性投资策略基础上，结合本基金流动性要求的特点，形成具体投资策略。</p> <p>（五）权证投资</p> <p>权证投资的包括两个方面：一是基金经理提出投资要求；二是数量策略研究员提供投资建议。</p> <p>基金经理提出投资权证的要求，相关的数量策略研究员应该根据投资目的进行相关的投资价值分析，作为投资决策的依据。对于作为基础证券备选方案的权证，研究基础证券与权证在风险和收益方面的区别；对于在组合管理层面利用权证调整组合风险收益特征的投资，测算所选权证与投资组合的相关性及其稳定性，并研究此项投资的风险因素等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	张燕
	联系电话	021-38992888	0755-83199084
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95555
传真		021-50151582	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200121	518040

法定代表人	于业明	缪建民
-------	-----	-----

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

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 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	10,362,353.06
本期利润	4,382,039.95
加权平均基金份额本期利润	0.0537
本期加权平均净值利润率	4.70%
本期基金份额净值增长率	1.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	358,665.70
期末可供分配基金份额利润	0.0058
期末基金资产净值	69,523,361.85
期末基金份额净值	1.118
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	153.94%

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。

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	-5.09%	0.49%	-1.58%	0.64%	-3.51%	-0.15%
过去三个月	-2.95%	0.72%	3.00%	0.78%	-5.95%	-0.06%
过去六个月	1.91%	1.01%	0.69%	1.05%	1.22%	-0.04%
过去一年	21.13%	1.62%	20.89%	1.07%	0.24%	0.55%
过去三年	-0.36%	1.54%	42.38%	1.09%	-42.74%	0.45%
自基金合同生效起至今	153.94%	1.61%	163.31%	1.23%	-9.37%	0.38%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安德盛红利混合型证券投资基金

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

(2008 年 10 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1、本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%；

2、本基金基金合同于 2008 年 10 月 22 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时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。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐俊	本基金基金经理。	2019-06-24	-	13 年（自 2008 年起）	徐俊先生，硕士研究生。2008 年 7 月至 2012 年 1 月在光大证券股份有限公司金融衍生品部担任研究员兼投资经理。2012 年 2 月至 2015 年 6 月在光大保德信基金管理有限公司担任研究员。2015 年 6 月加入国联安基金管理有限公司担任研究员。2019 年 6 月起担任国联安德盛红利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》、《国联安德盛红利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 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，及时执行交易系统内的公平交易模块；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

今年上半年本基金的投资策略相比去年有了较多的改变。去年由于整体市场热度持续提升，资本市场改革持续推进，本基金重点配置了证券板块。在去年底，我们判断今年整体市场的热度相比去年将有所下降，流动性相比去年也难有进一步宽松。同时，银行行业的基本面数据开始全面好转。在此背景下，本基金减持了证券板块，增持了银行板块，基金投资组合相比去年更加均衡。除了板块配置之外，上半年我们还加强了行业内个股的选择，争取通过个股选择提升基金的超额收益，并取得了一定的效果。

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 1.91%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年，我们认为整体经济将保持平稳。证券市场的结构性机会将持续，整体市场和各个板块内将持续分化，不论是整体市场还是行业板块，难有持续性的明显投资机会。投资机会将以阶段性、个股性机会为主。基于这些判断，本基金下半年将淡化行业配置，以深挖个股为主要操作手段，争取为基金持有人获得稳健的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：国联安德盛红利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	17,091,408.70	27,613,268.15
结算备付金		439,283.30	203,641.68
存出保证金		127,104.59	137,386.45
交易性金融资产	6.4.7.2	61,800,045.76	136,360,517.73
其中：股票投资		61,800,045.76	136,360,517.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		31,948.67	-
应收利息	6.4.7.5	2,547.45	2,332.86
应收股利		-	-
应收申购款		245,321.77	410,901.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		79,737,660.24	164,728,048.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-
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		5,461,383.53	14,593,355.31
应付赎回款		4,357,770.78	2,230,221.20
应付管理人报酬		93,240.93	192,850.86
应付托管费		15,540.14	32,141.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	178,347.06	381,889.51
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	108,015.95	197,470.61
负债合计		10,214,298.39	17,627,929.32
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	62,186,713.24	134,106,220.25
未分配利润	6.4.7.10	7,336,648.61	12,993,899.28
所有者权益合计		69,523,361.85	147,100,119.53
负债和所有者权益总计		79,737,660.24	164,728,048.85

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.118 元，基金份额总额 62,186,713.24 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安德盛红利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		6,104,605.57	-4,007,670.48
1.利息收入		45,170.15	12,098.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,170.15	12,098.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,898,089.11	-405,892.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,147,091.38	-707,957.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	750,997.73	302,064.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,980,313.11	-3,624,587.28
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	141,659.42	10,710.71
减：二、费用		1,722,565.62	568,155.61
1. 管理人报酬		697,225.61	350,239.26

2. 托管费		116,204.28	58,373.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	813,937.99	91,179.74
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	95,197.74	68,363.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,382,039.95	-4,575,826.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,382,039.95	-4,575,826.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安德盛红利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	134,106,220.25	12,993,899.28	147,100,119.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,382,039.95	4,382,039.95
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）	-71,919,507.01	-10,039,290.62	-81,958,797.63
其中：1.基金申购款	25,105,606.38	3,493,107.10	28,598,713.48
2.基金赎回款	-97,025,113.39	-13,532,397.72	-110,557,511.11
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）	62,186,713.24	7,336,648.61	69,523,361.85
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	57,161,586.42	-13,409.86	57,148,176.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-4,575,826.09	-4,575,826.09

润)			
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)	-9,898,187.92	932,715.49	-8,965,472.43
其中: 1.基金申购款	11,761,618.89	-1,127,623.77	10,633,995.12
2.基金赎回款	-21,659,806.81	2,060,339.26	-19,599,467.55
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)	47,263,398.50	-3,656,520.46	43,606,878.04

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：王琤，主管会计工作负责人：叶培智，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

国联安德盛红利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)(原“国联安德盛红利股票证券投资基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准德盛红利股票证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]997号文)批准,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》等相关法规和《德盛红利股票证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年10月22日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集规模为729,757,551.04份基金份额。根据《国联安基金管理有限公司关于旗下五只基金变更基金名称的公告》,自2015年8月8日起,“国联安德盛红利股票证券投资基金”更名为“国联安德盛红利混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《德盛红利混合型证券投资基金基金合同》和《国联安德盛红利混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票,债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产占基金资产的60%-95%,其中80%以上的股票资产将投资于具有较高预期股息收益率的股票,包括当期股息收益率较高的股票、预期盈利大幅增长的股票以及预期股息分配率将提高的股票;债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的

业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期内本基金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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2021 年 6 月 30 日

活期存款	17,091,408.70
定期存款	-
其他存款	-
合计	17,091,408.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	66,426,151.94	61,800,045.76	-4,626,106.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	66,426,151.94	61,800,045.76	-4,626,106.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金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 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,292.55
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	197.70
应收债券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	57.20
合计	2,547.45

注：此处其他列示的是基金上交所和深交所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	178,347.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	178,347.06

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,276.10
应付证券出借违约金	-
预提审计费	32,232.48
预提信息披露费	59,507.37
合计	108,015.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	134,106,220.25	134,106,220.25
本期申购	25,105,606.38	25,105,606.38

本期赎回（以“-”号填列）	-97,025,113.39	-97,025,113.39
本期末	62,186,713.24	62,186,713.24

注：此处申购含转换入份额，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	-15,655,542.34	28,649,441.62	12,993,899.28
本期利润	10,362,353.06	-5,980,313.11	4,382,039.95
本期基金份额交易产生的变动数	5,651,854.98	-15,691,145.60	-10,039,290.62
其中：基金申购款	-1,765,335.40	5,258,442.50	3,493,107.10
基金赎回款	7,417,190.38	-20,949,588.10	-13,532,397.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	358,665.70	6,977,982.91	7,336,648.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	40,104.58
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	4,009.34
其他	1,056.23
合计	45,170.15

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及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
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	295,412,916.72
减：卖出股票成本总额	284,265,825.34
买卖股票差价收入	11,147,091.38

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

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益买卖债券差价收入

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	750,997.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	750,997.73

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-5,980,313.11
——股票投资	-5,980,313.11
——债券投资	-
——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 预估增值税	-
合计	-5,980,313.11

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	136,949.01
转换费收入	4,710.41
合计	141,659.42

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	813,937.99
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	813,937.99

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,457.89
合计	95,197.74

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）	基金管理人的股东
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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	697,225.61	350,239.26

其中：支付销售机构的客户维护费	334,090.85	100,533.51
-----------------	------------	------------

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	116,204.28	58,373.27

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末，除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	17,091,408.70	40,104.58	3,677,414.18	11,287.83

注：1.本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

2.本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 6 月 30 日的相关余额为 439,283.30 人民币元。（2020 年 6 月 30 日余

额：人民币 10,269.30 元)

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定	24.60	163.00	168	4,132.80	27,384.00	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-07-07	新股锁定	74.46	373.24	535	39,836.10	199,683.40	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股待上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金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 2021 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 2021 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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 2021 年 06 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 0.00%（2020 年 12 月 31 日：0.00%）。

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时间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管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2021 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 0.36%。

本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 2021 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超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本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 2021年6 月30日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,091,408.70	-	-	-	-	-	17,091,408.70
结算备付金	439,283.30	-	-	-	-	-	439,283.30
存出保证金	127,104.59	-	-	-	-	-	127,104.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	61,800,045.76	61,800,045.76
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	31,948.67	31,948.67
应收利息	-	-	-	-	-	2,547.45	2,547.45
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	245,321.77	245,321.77
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,657,796.59	-	-	-	-	62,079,863.65	79,737,660.24
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,461,383.53	5,461,383.53
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,357,770.78	4,357,770.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	93,240.93	93,240.93
应付托管费	-	-	-	-	-	15,540.14	15,540.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	178,347.06	178,347.06
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	108,015.9	108,015.95

						5	
负债总计	-	-	-	-	-	10,214,298.39	10,214,298.39
利率敏感度缺口	17,657,796.59	-	-	-	-	51,865,565.26	69,523,361.85
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	27,613,268.15	-	-	-	-	-	27,613,268.15
结算备付金	203,641.68	-	-	-	-	-	203,641.68
存出保证金	137,386.45	-	-	-	-	-	137,386.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	136,360,517.73	136,360,517.73
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,332.86	2,332.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	410,901.98	410,901.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,954,296.28	-	-	-	-	136,773,752.57	164,728,048.85
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,593,355.31	14,593,355.31
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,230,221.20	2,230,221.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	192,850.86	192,850.86
应付托管费	-	-	-	-	-	32,141.83	32,141.83

应付交易费用	-	-	-	-	-	381,889.51	381,889.51
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	197,470.61	197,470.61
负债总计	-	-	-	-	-	17,627,929.32	17,627,929.32
利率敏感度缺口	27,954,296.28	-	-	-	-	119,145,823.25	147,100,119.53

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 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 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)，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(2020 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资产占基金资产的 60%-95%，其中 80% 以上的股票资产将投资于具有较高预期股息收益率的股票，包括当期股息收益率较高的股票、预期盈利大幅增长的股票以及预期股息分配率将提高的股票；债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%。此外，本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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	61,800,045.76	88.89	136,360,517.73	92.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	61,800,045.76	88.89	136,360,517.73	92.70

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 1,721,590.51	增加 10,088,579.65
	业绩比较基准下降 5%	减少 1,721,590.51	减少 10,088,579.65

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	61,800,045.76	77.50
	其中：股票	61,800,045.76	77.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	17,530,692.00	21.99
8	其他各项资产	406,922.48	0.51
9	合计	79,737,660.24	100.00

注：1、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。

2、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（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	265,717.82	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.02
F	批发和零售业	-	-
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	12,230.40	0.02
J	金融业	61,506,421.10	88.47
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	61,800,045.76	88.89

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

本报告期末本基金未持有港股通股票。

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	601318	中国平安	100,000	6,428,000.00	9.25
2	601166	兴业银行	230,000	4,726,500.00	6.80
3	601818	光大银行	1,200,000	4,536,000.00	6.52
4	600908	无锡银行	780,000	4,524,000.00	6.51
5	601998	中信银行	880,000	4,488,000.00	6.46
6	600999	招商证券	230,000	4,374,600.00	6.29
7	000776	广发证券	270,000	4,087,800.00	5.88
8	600109	国金证券	300,000	3,807,000.00	5.48
9	601398	工商银行	700,000	3,619,000.00	5.21
10	002807	江阴银行	850,000	3,349,000.00	4.82
11	601288	农业银行	1,000,000	3,030,000.00	4.36
12	002839	张家港行	500,000	2,720,000.00	3.91
13	601658	邮储银行	500,000	2,510,000.00	3.61
14	601169	北京银行	500,000	2,435,000.00	3.50
15	603323	苏农银行	470,000	2,058,600.00	2.96
16	600000	浦发银行	200,000	2,000,000.00	2.88
17	601128	常熟银行	300,000	1,860,000.00	2.68
18	601336	新华保险	20,000	918,200.00	1.32
19	688617	惠泰医疗	535	199,683.40	0.29
20	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.05
21	300919	中伟股份	168	27,384.00	0.04
22	300894	火星人	369	25,092.00	0.04
23	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
24	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
25	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
26	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

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	000776	广发证券	14,215,768.53	9.66
2	601377	兴业证券	11,838,255.00	8.05
3	600999	招商证券	10,755,803.70	7.31
4	601998	中信银行	10,362,716.00	7.04
5	600958	东方证券	9,980,398.00	6.78
6	600908	无锡银行	9,718,500.00	6.61
7	601211	国泰君安	8,973,810.00	6.10
8	601688	华泰证券	8,973,681.00	6.10
9	601169	北京银行	8,712,000.00	5.92
10	000001	平安银行	8,701,220.00	5.92
11	601128	常熟银行	8,665,230.00	5.89
12	002142	宁波银行	8,310,799.00	5.65
13	002839	张家港行	6,660,500.00	4.53
14	300059	东方财富	6,246,344.00	4.25
15	600000	浦发银行	6,154,000.00	4.18
16	600837	海通证券	5,726,600.00	3.89
17	000783	长江证券	5,494,600.00	3.74
18	601166	兴业银行	5,289,792.00	3.60
19	601818	光大银行	4,953,500.00	3.37
20	601658	邮储银行	4,801,700.00	3.26
21	601881	中国银河	4,493,116.00	3.05
22	600030	中信证券	4,193,794.58	2.85
23	601838	成都银行	4,113,216.00	2.80
24	600109	国金证券	3,794,500.00	2.58
25	601398	工商银行	3,647,000.00	2.48
26	002807	江阴银行	3,630,500.00	2.47
27	601336	新华保险	3,465,214.00	2.36
28	601288	农业银行	3,310,000.00	2.25
29	600919	江苏银行	3,266,000.00	2.22

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	600958	东方证券	21,198,920.16	14.41

2	601377	兴业证券	21,115,972.68	14.35
3	000001	平安银行	20,427,879.00	13.89
4	002142	宁波银行	18,156,654.47	12.34
5	300059	东方财富	17,808,054.19	12.11
6	600999	招商证券	15,830,388.95	10.76
7	600030	中信证券	12,833,132.00	8.72
8	601166	兴业银行	11,240,890.00	7.64
9	000166	申万宏源	10,649,000.00	7.24
10	601336	新华保险	10,595,952.00	7.20
11	000776	广发证券	10,061,359.00	6.84
12	000002	万 科 A	9,135,121.00	6.21
13	601211	国泰君安	8,970,400.00	6.10
14	601688	华泰证券	8,825,842.00	6.00
15	000656	金科股份	8,501,000.00	5.78
16	600048	保利地产	8,099,500.00	5.51
17	601818	光大银行	8,086,156.00	5.50
18	601128	常熟银行	6,813,000.00	4.63
19	601169	北京银行	6,244,000.00	4.24
20	600908	无锡银行	5,873,930.00	3.99
21	601998	中信银行	5,813,790.00	3.95
22	000783	长江证券	5,382,400.00	3.66
23	600837	海通证券	5,208,000.00	3.54
24	601838	成都银行	4,565,533.00	3.10
25	601881	中国银河	4,327,062.00	2.94
26	600000	浦发银行	4,068,000.00	2.77
27	002839	张家港行	3,737,009.00	2.54
28	600919	江苏银行	3,462,000.00	2.35
29	601066	中信建投	3,090,911.00	2.10

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	215,685,666.48
卖出股票的收入（成交）总额	295,412,916.72

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

本报告期末本基金未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

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

本报告期末本基金未持有国债期货，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

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.11.3 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。

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广发证券、国金证券、兴业银行、光大银行、中信银行、工商银行和招商证券外，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。

广发证券（000776）的发行主体广发证券股份有限公司，因在康美药业股份有限公司 2014 年非公开发行优先股项目、2015 年公司债券项目、2016 年非公开发行股票项目、2018 年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司 2017 年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务，于 2020 年

7月10日被广东证监局采取责令改正、暂停保荐机构资格、暂不受理债券承销业务有关文件、限制高级管理人员权利的监管措施。

国金证券（600109）的发行主体国金证券股份有限公司，因在保荐上海翼捷工业安全设备股份有限公司首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责履行相关职责，对招股说明书披露发明专利数量不准确、注册申请文件披露发行人取得发明专利数量存在矛盾未予充分关，于2021年3月25日被中国证监会采取出具警示函的监管措施。

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。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。

光大银行（601818）的发行主体中国光大银行股份有限公司，因违规办理内保外贷业务、未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查、违反规定办理资本项目资金收付、违反规定办理结汇业务等违法违规行为，于2020年8月25日被国家外汇管理局北京外汇管理部罚没601万元。因侵害消费者知情权、自主选择权、公平交易权、财产安全权等基本权利，于2021年2月2日被中国银保监会消费者权益保护局通报批评并责令整改。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诫勉谈话、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，在相关债务融资工具的簿记建档过程中未妥善保存工作底稿，未就簿记建档工作建立有效的内部监督制度，于2020年11月6日被交易商协会采取诫勉谈话、责令整改的行政监管措施。昆明分行因以受让不良贷款本金为条件向企业融资，违规处置不良资产，且部分新增贷款已形成风险等六项违法违规行为，于2021年6月7日被中国银保监会云南监管局罚款人民币385万元。

中信银行（601998）的发行主体中信银行股份有限公司，因客户信息保护体制机制不健全、客户信息收集环节管理不规范等违法违规行为，于2021年3月17日被中国银保监会罚款450万元。因违规办理内保外贷业务、未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付等违法违规行为，于2020年8月25日被国家外汇管理局北京外汇管理部合计

罚没 2662.79 万元。因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等一系列违法违规行为，于 2021 年 2 月 5 日被中国人民银行罚款 2890 万元。天津分行因以信贷资金办理存单及存单质押贷款等违法违规事由，于 2020 年 11 月 3 日被天津银保监局累积罚没 308.52 万元。济南分行因商业承兑汇票贸易背景审查不严、二手房按揭贷款审查不到位等违法违规事由，于 2021 年 2 月 20 日被山东银保监局罚款 225 万元。太原分行因违规提供兜底承诺，于 2021 年 3 月 4 日被山西银保监局责令改正并罚款 600 万元。

工商银行（601398）的发行主体中国工商银行股份有限公司，江苏省分行因未按规定履行客户身份识别义务，于 2020 年 9 月 27 日被人民银行南京分行罚款 220 万元。荆门分行因未经上级授权违规签订业务协议、内控管理不到位开展中间业务不规范，于 2020 年 9 月 7 日被湖北银保监局罚款 380 万元。广东省分行因对企业银行结算账户交易监测不到位，于 2020 年 10 月 30 日被人民银行广州分行警告并处罚款 529.49 万元。重庆市分行因为虚假并购交易发放信贷资金、越权审批、违规开展理财业务等一系列违法违规行为，于 2020 年 12 月 31 日被中国银保监会重庆监管局罚款 1550 万元。襄阳分行因违规出具承诺函、未经上级授权违规签订业务协议、违规启用行政公章、内控管理不到位开展中间业务不规范，于 2020 年 9 月 7 日被中国银保监会湖北监管局罚款 3050 万元。陕西省分行因违反支付结算管理规定，于 2021 年 6 月 23 日被中国人民银行西安分行给予警告，没收违法所得 251312.68 元，并处 296.5 万元罚款。浙江省分行因违规开展“融 e 通 2 号”业务等十项违法违规行为，于 2021 年 5 月 19 日被中国银保监会浙江监管局罚款 440 万元。

招商证券（600999）的发行主体招商证券股份有限公司，因在保荐武汉科前生物股份有限公司科创板首次公开发行股票申请过程中，存在未发现 2016 年-2017 年期间通过列支研发费用或其他费用将资金从发行人账户最终转到财务总监个人卡用于发放部分高管薪酬、奖金或支付无票据费用；未发现发行人员李名义是经销商金华康顺的实际经营者；在首次提交的申报材料中未充分揭示非洲猪瘟疫情可能造成的业绩波动风险等方面问题，于 2020 年 8 月 18 日被中国证监会采取警示的监管措施。因在华晨汽车集团控股有限公司 2017 年非公开发行公司债券(第二期)受托管理过程中，存在未及时履行受托管理人信息披露职责等违法违规行为，于 2020 年 11 月 20 日被上海证券交易所债券业务中心采取出具警示函的行政监管措施。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 2021 年 5 月 26 日被中国人民银行深圳市中心支行罚款人民币 173 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。

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	127,104.59
2	应收证券清算款	31,948.67
3	应收股利	-
4	应收利息	2,547.45
5	应收申购款	245,321.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	406,922.48

7.12.4 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。

7.12.5 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。

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 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
9,469	6,567.40	3,495.18	0.01%	62,183,218.06	99.99%

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	128,606.51	0.21%

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

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008 年 10 月 22 日）基金份额总额	729,757,551.04
本报告期期初基金份额总额	134,106,220.25
本报告期基金总申购份额	25,105,606.38
减：本报告期基金总赎回份额	97,025,113.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	62,186,713.24

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、2021 年 2 月 18 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，李柯女士不再担任公司副总经理（财务总监、首席运营官）及首席信息官职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	502,342,301.06	98.51%	464,593.25	98.53%	-
海通证券股份有限公司	1	7,588,266.47	1.49%	6,915.28	1.47%	-

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

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

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
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

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	国联安基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-01-05
2	国联安德盛红利混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定网站	2021-01-22
3	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2021-01-22
4	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-02-18
5	国联安基金管理有限公司关于终止上海有鱼基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
6	国联安基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
7	国联安基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-30
9	国联安德盛红利混合型证券投资基金 2020 年年度报告	规定网站	2021-03-31
10	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	规定报刊	2021-03-31
11	国联安基金管理有限公司关于在网上直销平台开展货币基金转认/申购业务、网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-09
12	国联安德盛红利混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定网站	2021-04-22
13	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22

14	国联安德盛红利混合型证券投资基金招募说明书更新(2021 年第 1 号)	规定网站	2021-05-20
15	国联安德盛红利混合型证券投资基金（后端）基金产品资料概要更新	规定网站	2021-05-20
16	国联安德盛红利混合型证券投资基金（前端）基金产品资料概要更新	规定网站	2021-05-20
17	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 7 月 24 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，叶培智先生自 2021 年 7 月 23 日起担任公司副总经理（财务总监兼首席运营官）。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安德盛红利股票证券投资基金（现国联安德盛红利混合型证券投资基金）发行及募集的文件

- 2、《国联安德盛红利混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安德盛红利混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安德盛红利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

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日