# 国联安价值优选股票型证券投资基金

## 2019 半年度 报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 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 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李华 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38992888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | customer.service@epicfunds.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 021-38784766/4007000365 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-50151582 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | www.epicfunds.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 |

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;

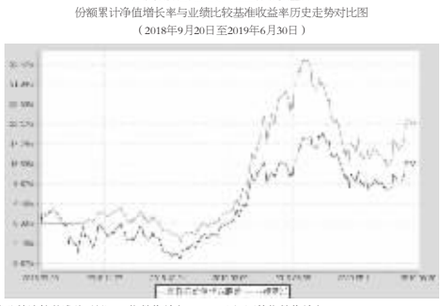
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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(助理)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,本基金本报告期未进行利润分配,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损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等内容的真实、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 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | - | - |
| 银行存款 | 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 | 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 20,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 180,982.64 | - |
| 应收利息 | 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 | - | - |
| 资产总计 | 19,977,852.96 | 101,384,133.38 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负债: | - | - |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 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 | 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 | 97,427.45 | 185,754.46 |
| 负债合计 | 509,795.76 | 959,181.46 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 15,917,089.44 | 103,103,438.33 |
| 未分配利润 | 3,550,967.76 | -2,678,486.41 |
| 所有者权益合计 | 19,468,057.20 | 100,424,951.92 |
| 负债和所有者权益总计 | 19,977,852.96 | 101,384,133.38 |

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 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | 15,875,906.75 |
| 1.利息收入 | 113,198.58 |
| 其中:存款利息收入 | 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 | 10,781,027.02 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | -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 | - |
| 股利收益 | 277,929.57 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 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) | 271,594.04 |
| 减:二、费用 | 648,558.87 |
| 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 | 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 | 105,414.68 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 15,227,347.88 |
| 减:所得税费用 | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 15,227,347.88 |

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 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 关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2 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 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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。

6.4.8.2.2 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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

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售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 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(%) |
|---|---|---|---|
| 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前十名股票投资明细

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 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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 |