

国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式证券投资基 金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安新蓝筹红利一年定开混合
基金主代码	008878
交易代码	008878
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 13 日
报告期末基金份额总额	429,029,439.25 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，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。在控制投资风险的前提

	<p>下，形成大类资产的配置方案。</p> <p>伴随供给侧改革为代表的供给结构调整，以及消费升级的需求结构调整，中国经济在未来仍将保持稳定增长。在经济结构优化的进程中，国内资本市场将有一大批新蓝筹公司涌现。本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，精选出其中兼具稳定的分红能力和核心竞争优势的上市公司股票进行投资，以增强本基金的股息收益和资本增值能力。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率*35%+沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	<p>本基金属于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。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。</p>
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

注：本基金以开放期和封闭期相结合的方式运作。封闭期指自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）一年的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延。首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。开放期指自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的，开放期时间顺延，直到满足开放期的时间要

求。

§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
	(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-13,632,994.16
2.本期利润	-29,891,161.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0697
4.期末基金资产净值	291,833,639.49
5.期末基金份额净值	0.6802

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

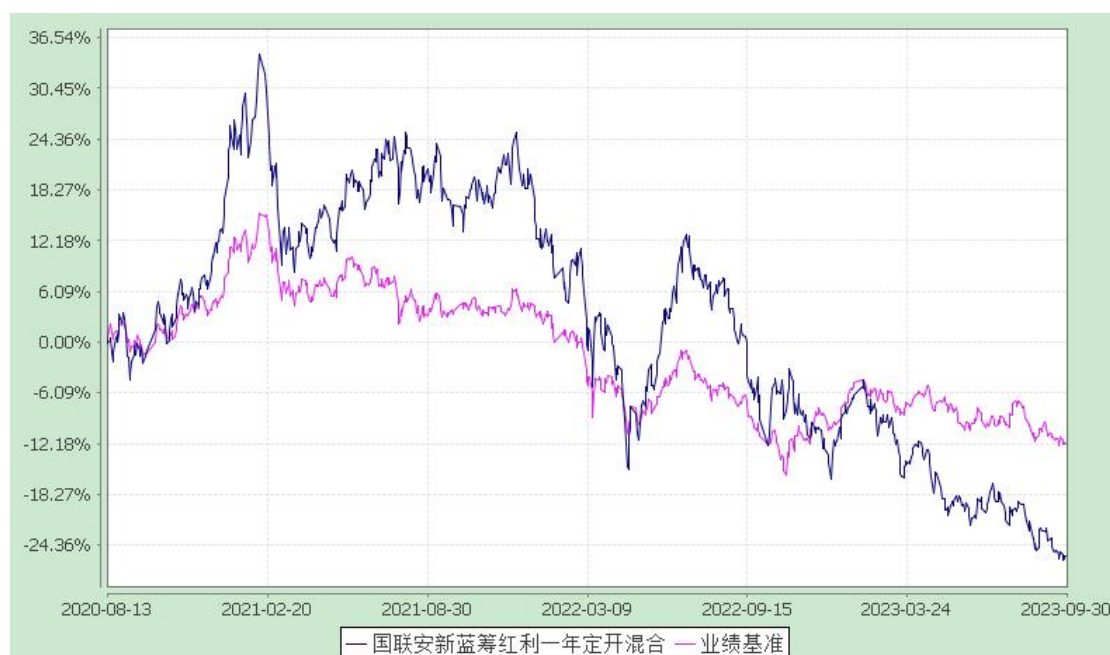
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.29%	0.92%	-2.62%	0.59%	-6.67%	0.33%
过去六个月	-14.73%	0.93%	-5.65%	0.57%	-9.08%	0.36%
过去一年	-17.99%	1.11%	-1.09%	0.65%	-16.90%	0.46%
过去三年	-24.89%	1.35%	-10.96%	0.73%	-13.93%	0.62%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同	-25.63%	1.35%	-12.15%	0.73%	-13.48%	0.62%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2020 年 8 月 13 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*35%+恒生指数收益率*5%；

2、本基金基金合同于2020年8月13日生效；

3、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；

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		
韦明亮	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、国联安德盛优势混合型证券投资基金基金经理。	2022-09-02	-	23 年（自 2000 年起）	韦明亮先生，硕士研究生。曾任上海国禾投资有限公司研究员，光大证券研究所机械行业高级分析师，华宝兴业基金高级分析师，光大证券投资部投资经理，国联安基金权益投资部总监兼基金经理，望正资产管理有限公司投资经理。2022 年 8 月加入国联安基金管理有限公司，担任研究部总经理。2022 年 9 月起担任国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理；2022 年 11 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；2023 年 7 月起兼任国联安德盛优势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》、《国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式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

国家陆续出台了逆周期的调节政策。但是由于政策作用于经济需要时间，宏观经济仍处于弱复苏状态。另外，美联储的加息过程仍未结束，也抑制了市场的做多情绪。受此影响，三季度市场持续下跌。展望未来，随着上述两个因素的逐步缓解，市场或将逐步企稳上涨。

在投资策略方面，我们继续聚焦于成长性行业。经历了近 3 年的下跌，成长性行业中的优势企业也经历了大幅下跌，而它们的竞争优势得以保持甚至扩大。一旦产业趋势迎来上涨周期，这些公司股价会有不错表现。

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-9.29%，同期业绩比较基准收益率为-2.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截止 2023 年 8 月 12 日，本基金基金合同生效未满三年，基金管理人暂无需对基金持有人数进行预警说明。

2023 年 8 月 13 日至 2023 年 9 月 11 日，本基金账户数低于 200 户。已通过持续营销活动增加基金账户数。

§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	264,097,393.94	90.30
	其中：股票	264,097,393.94	90.30
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	28,238,792.30	9.65
8	其他各项资产	144,162.35	0.05
9	合计	292,480,348.59	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	-	-
C	制造业	198,684,835.73	68.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.01
E	建筑业	6,550.69	0.00

F	批发和零售业	222,798.03	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	10,754,000.00	3.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,945,080.51	3.41
J	金融业	22,544,000.00	7.72
K	房地产业	13,080,000.00	4.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,790,631.52	3.01
N	水利、环境和公共设施管理业	16,847.49	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,086.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	264,097,393.94	90.50

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	9,200	16,546,660.00	5.67
2	601398	工商银行	3,000,000	14,040,000.00	4.81
3	002126	银轮股份	700,000	13,223,000.00	4.53
4	000002	万科A	1,000,000	13,080,000.00	4.48
5	688239	航宇科技	230,144	13,035,356.16	4.47
6	300750	宁德时代	62,000	12,587,860.00	4.31
7	600765	中航重机	450,000	11,169,000.00	3.83
8	002475	立讯精密	350,000	10,437,000.00	3.58
9	002028	思源电气	200,000	10,336,000.00	3.54
10	600941	中国移动	100,000	9,682,000.00	3.32

5.4 报告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。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到云南银保监局、江西证监局、中国银行间市场交易商协会、重庆银保监局、宁波银保监局、浙江银保监局、中国人民银行西安分行、济南市天桥区市场监管局的处罚。万科企业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西安市未央区人民法院的处罚。宁德时代新能源科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁德市市场监督管理局的处罚。

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，除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	144,162.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144,162.35

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	429,029,155.25
报告期期间基金总申购份额	284.00
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	429,029,439.25

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,200.02
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,200.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.33

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	2.33%	10,000,200.02	2.33%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,20 0.02	2.33%	10,000,20 0.02	2.33%	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2023年7月1日至2023年9月30日	249,999,000.0	-	-	249,999,000.00	58.27%
	2	2023年7月1日至2023年9月30日	100,484,843.41	-	-	100,484,843.41	23.42%
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>							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安新蓝筹红利一年定期开放混合型发起式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

10.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

10.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司
二〇二三年十月二十五日