

# 国寿安保安康纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 28 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。

基金托管人广发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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 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                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 8         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 8         |
| 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             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 9         |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10        |
| 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        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 11        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 15        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>31</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 31        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 31        |
| 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       | 31        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 31        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 32        |
| 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      | 32        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细    | 32        |
| 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   | 32        |
| 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      | 32        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 32        |
| 7.11 投资组合报告附注                           | 33        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b>                     | <b>34</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 34        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 34        |
| 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 .....  | 34        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                | <b>34</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>35</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 35        |
| 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 .....   | 35        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 35        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 35        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 35        |
| 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 .....      | 35        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 35        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 36        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>37</b> |
| 11.1 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 ..... | 37        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 37        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                  | <b>38</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 38        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 38        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 38        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 国寿安保安康纯债债券型证券投资基金   |
| 基金简称       | 国寿安保安康纯债债券          |
| 基金主代码      | 003285              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2016 年 9 月 2 日      |
| 基金管理人      | 国寿安保基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 广发银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 19,805,164,043.76 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略、回购套利策略投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中债综合（全价）指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险/收益品种，其预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、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      |      | 国寿安保基金管理有限公司                     | 广发银行股份有限公司                |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张彬                               | 戴辉                        |
|         | 联系电话 | 010-50850744                     | 010-65169958              |
|         | 电子邮箱 | public@gsfunds.com.cn            | daihui@cgbchina.com.cn    |
| 客户服务电话  |      | 4009-258-258                     | 4008308003                |
| 传真      |      | 010-50850776                     | 010-65169555              |
| 注册地址    |      | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号        | 广东省广州市越秀区东风东路 713 号       |
| 办公地址    |      | 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层 | 北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦 |
| 邮政编码    |      | 100033                           | 100053                    |
| 法定代表人   |      | 王军辉                              | 王滨                        |

## 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                      |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gsfunds.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人处              |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                             |
|--------|--------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国寿安保基金管理有限公司 | 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层 |

## § 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 - 2019 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 476,904,364.83                        |
| 本期利润          | 463,253,018.40                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0236                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.27%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.30%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | 490,431,402.56                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0248                                |
| 期末基金资产净值      | 20,634,234,437.03                     |
| 期末基金份额净值      | 1.0419                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                 |
| 基金份额累计净值增长率   | 12.86%                                |

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

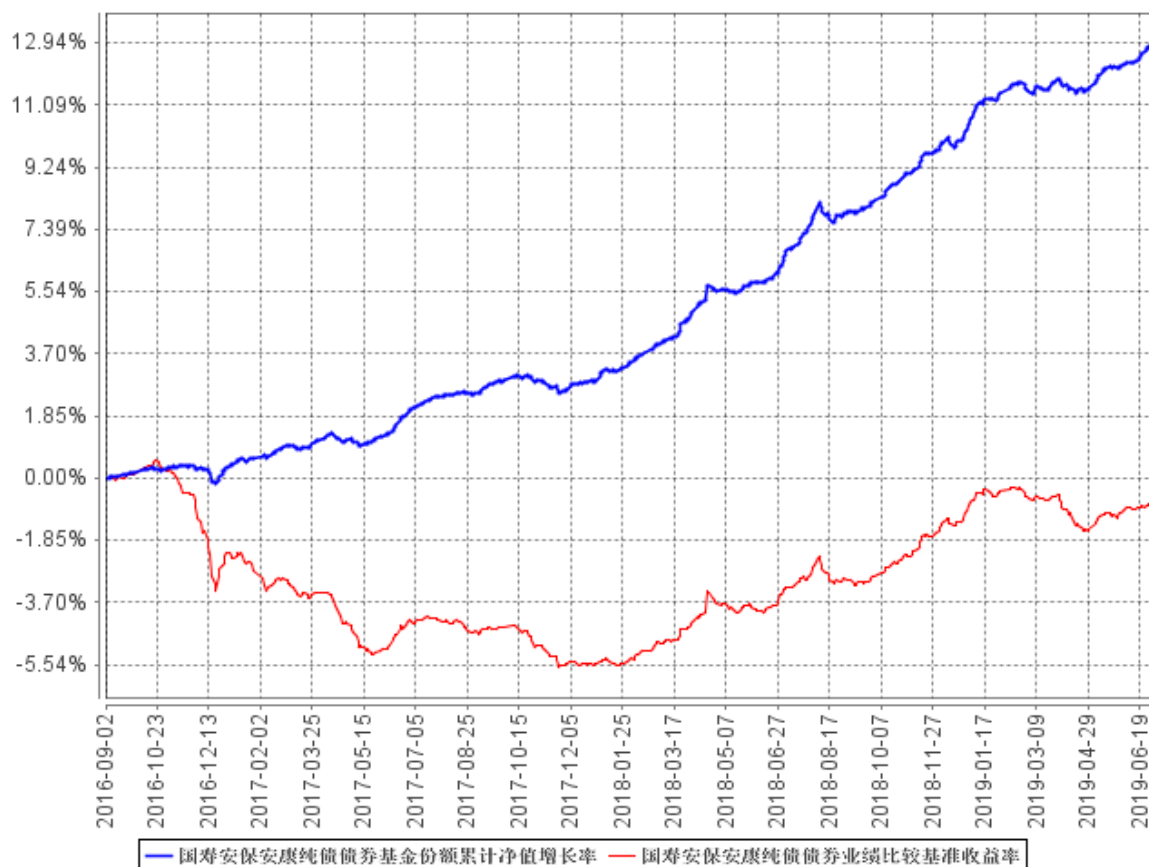
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.55%    | 0.02%       | 0.28%      | 0.03%         | 0.27%  | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.90%    | 0.04%       | -0.24%     | 0.06%         | 1.14%  | -0.02% |
| 过去六个月 | 2.30%    | 0.05%       | 0.24%      | 0.06%         | 2.06%  | -0.01% |
| 过去一年  | 6.17%    | 0.05%       | 2.82%      | 0.06%         | 3.35%  | -0.01% |
| 自基金合同 | 12.86%   | 0.04%       | -0.76%     | 0.08%         | 13.62% | -0.04% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

### 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

国寿安保安康纯债债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于 2016 年 9 月 2 日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2016 年 9 月 2 日至 2019 年 6 月 30 日。

## § 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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 48 只证券投资基金及部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2,070.27 亿元，其中证券投资基金管理规模为 1,538.97

亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 |        |  |
| 李一鸣 | 基金经理 | 2016年9月2日       | -    | 11年    | 曾任中银国际定息收益部研究员、中信证券固定收益部研究员，2013年11月加入国寿安保基金任基金经理助理，现任国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保安康纯债债券型证券投资基金、国寿安保安享纯债债券型证券投资基金、国寿安保稳嘉混合型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金及国寿安保稳寿混合型证券投资基金基金经理。 |

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在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的 5% 的情形。



## 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 年上半年海外经济持续恶化，全球各主要央行先后结束货币紧缩，进入新一轮宽松周期。受贸易摩擦升温及全球经济共振下行影响，净出口对经济负贡献继续扩大。在这一背景下，央行密集出台逆周期调控政策，一季度中国经济初现企稳迹象，基建及房地产投资增速均有反弹，持续收缩的货币信用环境边际上有所改善，社会融资增速小幅回升，宽货币向宽信用的传导初现成效。资本市场对经济的悲观预期也有明显修复，投资者风险偏好显著提升，股市呈现普涨行情。进入 4 月份，政治局会议的政策定调微调，虽有房地产及基建投资支撑固定资产投资增速，政府还出台了专项债配套融资政策和汽车家电等行业政策以提振内需，但整体来看二季度宏观经济增速略有放缓，宏观杠杆率增长势头得到遏制。

货币政策方面，稳健的货币政策仍然松紧适度，在保持定力的同时加强了相机抉择的灵活性。4 月货币市场资金面有所收紧，但此后中美贸易摩擦升级，加上包商事件打破市场对同业业务的刚兑预期，部分中小银行的同业负债被动收缩，部分非银机构也遭遇了流动性紧缩，央行适时适度给予了必要的流动性支持，缓解了流动性分层带来的负面影响。

债券市场方面，一季度宽松资金面驱动债市整体上涨，但受央行货币政策态度转谨慎、增长数据边际改善以及通胀预期升温等因素影响，4 月债市整体走弱，各品种各期限出现较大幅度调整。随后在中美贸易谈判局势生变、美联储降息预期攀升、国内经济下行压力加大及流动性宽松等利好因素综合发力下，债市全线反弹，各品种各期限收益率均有显著下行。

投资运作方面，本基金在报告期内调整信用债及存单持仓，提高组合杠杆，继续以高等级信用债及利率债为主要配置品种。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0419 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.30%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年全球经济将继续面临共振下行及贸易摩擦升温的挑战，中国对外贸易形势仍难以乐观。去年四季度以来密集出台的逆周期调控政策一度推动中国经济在一季度出现企稳改善迹象，特别是社融数据拐点意味着货币信贷环境显著改善。但总

体来看，中国经济内生动能不强，上半年内需的主要支撑力量来源于房地产投资，消费、基建投资和制造业投资仍显乏力。在地产信托渠道收紧，房地产因城施策的政策背景下，下半年房地产投资难以维持上半年强度。同时，下半年基建投资托底经济的作用也不宜高估，财政支出前移透支了财政政策潜力，且地方政府隐性债务约束仍未放松，专项债配套融资政策对基建投资的拉动作用预计也相对有限。总体而言，展望 2019 年下半年，由于外需跟随全球经济共振走弱的趋势未发生改变、消费持续反弹动力不足、房地产进入下行周期及基建扩张受限等因素，未来宏观经济仍处于筑底阶段，经济向下保持韧性，但向上弹性不足。7 月政治局会议判断经济下行压力加大，政策稳增长信号更强。

美联储 7 月议息会议如期降息 25bp，同时在 8 月提前结束缩表，外围环境整体仍偏宽松。国内政策层提前传递了货币政策“以内为主”的思路，美联储降息对国内市场影响有限，流动性合理充裕状态有望维持，但进一步放松的空间受限于宏观杠杆率、通胀以及汇率等因素。货币政策预计仍将在保持战略定力的基础上增加政策灵活性，从而平衡稳定经济增长，预防系统性风险和控制宏观杠杆率等多重政策目标。此外利率并轨的市场化改革措施也可能稳步推行，央行可能通过引导 LPR 利率下行进一步降低实体经济的实际融资利率。

整体而言，考虑到全球经济共振下行，主要央行重启货币宽松周期，中国经济内生增长动能偏弱等因素，下半年基本面及政策面正在逐步积累利好债市的积极因素，债券市场的阶段性机会大于风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金报告期内未进行利润分配。

#### **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**

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国寿安保安康纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### **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**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### **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**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：国寿安保安康纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,313,499.28                   | 5,908,067.85                     |
| 结算备付金           |            | 16,002,907.56                  | -                                |
| 存出保证金           |            | 416,118.42                     | 316,808.22                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 26,226,738,590.00              | 26,746,530,400.00                |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 26,148,178,590.00              | 26,634,050,400.00                |
| 资产支持证券投资        |            | 78,560,000.00                  | 112,480,000.00                   |
| 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    | -                              | 665,001,400.00                   |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 453,221,427.34                 | 412,886,816.06                   |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 26,698,692,542.60              | 27,830,643,492.13                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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       |            | 6,054,475,142.14               | 7,258,737,080.03                 |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 5,070,414.51                   | 5,212,912.49                     |
| 应付托管费           |            | 1,690,138.19                   | 1,737,637.53                     |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 233,286.44                     | 258,298.91                       |
| 应交税费            |            | 436,235.52                     | 560,960.83                       |

|               |          |                   |                   |
|---------------|----------|-------------------|-------------------|
| 应付利息          |          | 2,434,336.68      | 4,863,388.15      |
| 应付利润          |          | -                 | 388,179,159.13    |
| 递延所得税负债       |          | -                 | -                 |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 118,552.09        | 220,000.00        |
| 负债合计          |          | 6,064,458,105.57  | 7,659,769,437.07  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                   |                   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 19,805,164,043.76 | 19,805,059,167.43 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 829,070,393.27    | 365,814,887.63    |
| 所有者权益合计       |          | 20,634,234,437.03 | 20,170,874,055.06 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 26,698,692,542.60 | 27,830,643,492.13 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0419 元，基金份额总额 19,805,164,043.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保安康纯债债券型证券投资基金

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                    | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 567,153,910.99                           | 729,785,185.96                                |
| 1.利息收入                |            | 481,138,588.86                           | 447,502,225.02                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 165,420.71                               | 365,427.07                                    |
| 债券利息收入                |            | 477,783,154.60                           | 424,896,924.96                                |
| 资产支持证券利息收入            |            | 2,300,942.13                             | 19,244,723.03                                 |
| 买入返售金融资产收入            |            | 889,071.42                               | 2,995,149.96                                  |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 99,666,568.62                            | -892,171.03                                   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -  | -   |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 99,673,115.12                            | -828,521.08                                   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -6,546.50                                | -63,649.95                                    |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -13,651,346.43                           | 283,175,131.97                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 99.94                                    | -   |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 103,900,892.59                           | 80,008,321.66                                 |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 30,388,950.98                            | 29,690,459.03                                 |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 10,129,650.34                            | 9,896,819.66                                  |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -              | -              |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 69,676.02      | 91,161.85      |
| 5. 利息支出                    |            | 62,879,734.96  | 39,783,997.33  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 62,879,734.96  | 39,783,997.33  |
| 6. 税金及附加                   |            | 295,728.20     | 418,187.85     |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 137,152.09     | 127,695.94     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 463,253,018.40 | 649,776,864.30 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 463,253,018.40 | 649,776,864.30 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保安康纯债债券型证券投资基金

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<br>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）                        | 19,805,059,167.43                          | 365,814,887.63 | 20,170,874,055.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 463,253,018.40 | 463,253,018.40    |
| 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）      | 104,876.33                                 | 2,487.24       | 107,363.57        |
| 其中：1.基金申购款                             | 241,780.01                                 | 6,849.07       | 248,629.08        |
| 2.基金赎回款                                | -136,903.68                                | -4,361.83      | -141,265.51       |
| 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）                        | 19,805,164,043.76                          | 829,070,393.27 | 20,634,234,437.03 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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)                        | 19,805,062,791.95 | -3,529,951.34   | 19,801,532,840.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                 | 649,776,864.30  | 649,776,864.30    |
| 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)      | -4,569.71         | -29.54          | -4,599.25         |
| 其中：1.基金申购款                             | 286.95            | 1.82            | 288.77            |
| 2.基金赎回款                                | -4,856.66         | -31.36          | -4,888.02         |
| 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) | -                 | -386,198,720.45 | -386,198,720.45   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 19,805,058,222.24 | 260,048,162.97  | 20,065,106,385.21 |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 左季庆      | 王文英       | 韩占锋     |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保安康纯债债券型证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2016]1906 号文《关于核准国寿安保安康纯债债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2016 年 8 月 30 日至 2016 年 8 月 31 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2016)验字第 61090605\_A04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 9 月 2 日正式生效。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 200,037,697.36 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）。

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国家

债券、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、证券公司短期公司债券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款），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的相关规定）。本基金不投资股票、权证等权益类资产，也不投资可转换债券和可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日经营成果和净值变动情况。

#### **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**

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。



#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,313,499.28           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |

|     |              |
|-----|--------------|
| 合计: | 2,313,499.28 |
|-----|--------------|

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年6月30日 |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|               | 成本                | 公允价值              | 公允价值变动            |
| 股票            | -                 | -                 | -                 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -                 | -                 |
| 债券            | 交易所市场             | 6,433,982,616.24  | 6,514,235,590.00  |
|               | 银行间市场             | 19,319,248,526.26 | 19,633,943,000.00 |
|               | 合计                | 25,753,231,142.50 | 26,148,178,590.00 |
| 资产支持证券        | 77,274,609.53     | 78,560,000.00     | 1,285,390.47      |
| 基金            | -                 | -                 | -                 |
| 其他            | -                 | -                 | -                 |
| 合计            | 25,830,505,752.03 | 26,226,738,590.00 | 396,232,837.97    |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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<br>2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,739.65          |
| 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  | 7,201.30          |
| 应收债券利息     | 453,170,557.52    |
| 应收资产支持证券利息 | 41,741.57         |
| 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 | -                 |

|    |                |
|----|----------------|
| 其他 | 187.30         |
| 合计 | 453,221,427.34 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 233,286.44        |
| 合计          | 233,286.44        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 118,552.09        |
| 合计          | 118,552.09        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                   |
|---------------|----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额              |
| 上年度末          | 19,805,059,167.43          | 19,805,059,167.43 |
| 本期申购          | 241,780.01                 | 241,780.01        |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -136,903.68                | -136,903.68       |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -                 |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -                 |
| 本期申购          | -                          | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -                 |
| 本期末           | 19,805,164,043.76          | 19,805,164,043.76 |

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 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           | 13,527,390.79  | 352,287,496.84 | 365,814,887.63 |
| 本期利润           | 476,904,364.83 | -13,651,346.43 | 463,253,018.40 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -353.06        | 2,840.30       | 2,487.24       |
| 其中：基金申购款       | 1,413.99       | 5,435.08       | 6,849.07       |
| 基金赎回款          | -1,767.05      | -2,594.78      | -4,361.83      |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 490,431,402.56 | 338,638,990.71 | 829,070,393.27 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 126,580.90                 |
| 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 | 36,407.50                  |
| 其他        | 2,432.31                   |
| 合计        | 165,420.71                 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

#### 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

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 99,673,115.12              |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | 99,673,115.12              |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 9,534,212,788.80           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 9,238,128,368.13           |
| 减：应收利息总额                | 196,411,305.55             |

|          |               |
|----------|---------------|
| 买卖债券差价收入 | 99,673,115.12 |
|----------|---------------|

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 36,540,611.30              |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 34,626,546.50              |
| 减：应收利息总额       | 1,920,611.30               |
| 资产支持证券投资收益     | -6,546.50                  |

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -13,651,346.43             |
| ——股票投资                 | -                          |
| ——债券投资                 | -14,357,892.93             |
| ——资产支持证券投资             | 706,546.50                 |
| ——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                     | -13,651,346.43             |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 99.94                      |

|    |       |
|----|-------|
| 合计 | 99.94 |
|----|-------|

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 8,151.02                   |
| 银行间市场交易费用 | 61,525.00                  |
| 交易基金产生的费用 | -                          |
| 其中：申购费    | -                          |
| 赎回费       | -                          |
| 合计        | 69,676.02                  |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 59,507.37                  |
| 信息披露费    | 59,044.72                  |
| 其他       | 600.00                     |
| 上清所账户维护费 | 9,000.00                   |
| 中债登账户维护费 | 9,000.00                   |
| 合计       | 137,152.09                 |

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大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

本基金本报告期内不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。

#### 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           |
|------------------------|-------------------|
| 国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”） | 基金管理人、注册登记机构、直销机构 |

|                      |       |
|----------------------|-------|
| 广发银行股份有限公司（简称“广发银行”） | 基金托管人 |
|----------------------|-------|

注：以下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 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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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<br>2019年1月1日至2019<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 30,388,950.98                  | 29,690,459.03                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                              | -                               |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30%的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 10,129,650.34                  | 9,896,819.66                    |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |        |       |       |
|----------------------------|--------|-------|-------|
| 银行间市场                      | 债券交易金额 | 基金逆回购 | 基金正回购 |
|                            |        |       |       |



| 交易的各关联方名称                       | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出         |
|---------------------------------|--------|------|-------|------|------------------|--------------|
| 广发银行                            | -      | -    | -     | -    | 3,743,125,000.00 | 1,962,329.83 |
| 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |        |      |       |      |                  |              |
| 银行间市场交易的各关联方名称                  | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |              |
|                                 | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出         |
| 广发银行                            | -      | -    | -     | -    | 1,100,012,000.00 | 82,603.66    |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2019年6月30日 |                  | 上年度末<br>2018年12月31日 |                  |
|-------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额           | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 广发银行  | 19,805,009,088.92 | 100.0000%        | 19,805,009,088.92   | 100.0000%        |

##### 6.4.10.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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        |
|       | 广发银行                       | 2,313,499.28 | 126,580.90                      | 11,723,143.59 |

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

**6.4.12 期末（2019 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 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。

**6.4.12.3 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 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 6,014,475,142.14 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 130240    | 13 国开 40      | 2019 年 7 月 3 日 | 105.24 | 1,700,000 | 178,908,000.00 |
| 160218    | 16 国开 18      | 2019 年 7 月 1 日 | 100.43 | 4,000,000 | 401,720,000.00 |
| 170215    | 17 国开 15      | 2019 年 7 月 2 日 | 102.76 | 8,400,000 | 863,184,000.00 |
| 190201    | 19 国开 01      | 2019 年 7 月 4 日 | 99.96  | 500,000   | 49,980,000.00  |
| 170407    | 17 农发 07      | 2019 年 7 月 1 日 | 100.92 | 3,500,000 | 353,220,000.00 |
| 111915181 | 19 民生银行 CD181 | 2019 年 7 月 4 日 | 96.98  | 1,000,000 | 96,980,000.00  |
| 050217    | 05 国开 17      | 2019 年 7 月 4 日 | 102.14 | 300,000   | 30,642,000.00  |
| 160213    | 16 国开 13      | 2019 年 7 月 3 日 | 95.47  | 2,400,000 | 229,128,000.00 |
| 111917027 | 19 光大银行 CD027 | 2019 年 7 月 4 日 | 96.98  | 1,000,000 | 96,980,000.00  |
| 150218    | 15 国开 18      | 2019 年 7 月 4 日 | 100.14 | 2,700,000 | 270,378,000.00 |
| 160210    | 16 国开 10      | 2019 年 7 月 1 日 | 96.58  | 3,800,000 | 367,004,000.00 |
| 170210    | 17 国开 10      | 2019 年 7 月 3 日 | 101.40 | 1,600,000 | 162,240,000.00 |
| 170212    | 17 国开 12      | 2019 年 7 月 4 日 | 103.45 | 500,000   | 51,725,000.00  |
| 180204    | 18 国开 04      | 2019 年 7 月 3 日 | 104.49 | 527,000   | 55,066,230.00  |
| 150304    | 15 进出 04      | 2019 年 7 月 3 日 | 101.62 | 2,000,000 | 203,240,000.00 |
| 160303    | 16 进出 03      | 2019 年 7 月 3 日 | 97.51  | 743,000   | 72,449,930.00  |
| 180024    | 18 附息国债 24    | 2019 年 7 月 3 日 | 103.97 | 700,000   | 72,779,000.00  |
| 111917026 | 19 光大银行 CD026 | 2019 年 7 月 4 日 | 96.98  | 1,000,000 | 96,980,000.00  |
| 170206    | 17 国开 06      | 2019 年 7 月 1 日 | 101.99 | 3,800,000 | 387,562,000.00 |
| 1628005   | 16 华夏银行 02    | 2019 年 7 月 1 日 | 100.04 | 678,000   | 67,827,120.00  |
| 170208    | 17 国开 08      | 2019 年 7 月 4 日 | 103.46 | 500,000   | 51,730,000.00  |
| 170405    | 17 农发 05      | 2019 年 7 月 3 日 | 100.35 | 800,000   | 80,280,000.00  |
| 170415    | 17 农发 15      | 2019 年 7 月 3 日 | 103.71 | 1,500,000 | 155,565,000.00 |
| 180401    | 18 农发 01      | 2019 年 7 月 4 日 | 106.59 | 500,000   | 53,295,000.00  |
| 111915186 | 19 民生银行 CD186 | 2019 年 7 月 4 日 | 96.98  | 1,000,000 | 96,980,000.00  |

|           |               |                |        |            |                  |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 180206    | 18 国开 06      | 2019 年 7 月 1 日 | 105.53 | 3,000,000  | 316,590,000.00   |
| 170402    | 17 农发 02      | 2019 年 7 月 2 日 | 100.45 | 5,315,000  | 533,891,750.00   |
| 111910100 | 19 兴业银行 CD100 | 2019 年 7 月 4 日 | 97.06  | 207,000    | 20,091,420.00    |
| 150203    | 15 国开 03      | 2019 年 7 月 3 日 | 100.65 | 1,200,000  | 120,780,000.00   |
| 190204    | 19 国开 04      | 2019 年 7 月 4 日 | 99.64  | 427,000    | 42,546,280.00    |
| 170309    | 17 进出 09      | 2019 年 7 月 4 日 | 102.27 | 300,000    | 30,681,000.00    |
| 190401    | 19 农发 01      | 2019 年 7 月 3 日 | 99.29  | 2,600,000  | 258,154,000.00   |
| 111910198 | 19 兴业银行 CD198 | 2019 年 7 月 4 日 | 96.98  | 1,000,000  | 96,980,000.00    |
| 140205    | 14 国开 05      | 2019 年 7 月 4 日 | 110.19 | 300,000    | 33,057,000.00    |
| 150205    | 15 国开 05      | 2019 年 7 月 3 日 | 100.92 | 1,000,000  | 100,920,000.00   |
| 190203    | 19 国开 03      | 2019 年 7 月 4 日 | 99.36  | 500,000    | 49,680,000.00    |
| 合计        |               |                |        | 60,997,000 | 6,149,214,730.00 |

#### 6.4.12.3.2 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 40,000,000.00 元，于 2019 年 7 月 4 日到期。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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

##### 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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；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，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余在证券交易所上市，因此均能及时变现。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资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月30日 | 1年以内             | 1-5年              | 5年以上             | 不计息            | 合计                |
|-------------------|------------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 资产                |                  |                   |                  |                |                   |
| 银行存款              | 2,313,499.28     | -                 | -                | -              | 2,313,499.28      |
| 结算备付金             | 16,002,907.56    | -                 | -                | -              | 16,002,907.56     |
| 存出保证金             | 416,118.42       | -                 | -                | -              | 416,118.42        |
| 交易性金融资产           | 8,533,119,900.00 | 14,149,421,690.00 | 3,544,197,000.00 | -              | 26,226,738,590.00 |
| 应收利息              | -                | -                 | -                | 453,221,427.34 | 453,221,427.34    |
| 资产总计              | 8,551,852,425.26 | 14,149,421,690.00 | 3,544,197,000.00 | 453,221,427.34 | 26,698,692,542.60 |

|                          |                  |                   |                  |                |                   |
|--------------------------|------------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 负债                       |                  |                   |                  |                |                   |
| 卖出回购金融资产款                | 6,054,475,142.14 | -                 | -                | -              | 6,054,475,142.14  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                 | -                | 5,070,414.51   | 5,070,414.51      |
| 应付托管费                    | -                | -                 | -                | 1,690,138.19   | 1,690,138.19      |
| 应付交易费用                   | -                | -                 | -                | 233,286.44     | 233,286.44        |
| 应付利息                     | -                | -                 | -                | 2,434,336.68   | 2,434,336.68      |
| 应交税费                     | -                | -                 | -                | 436,235.52     | 436,235.52        |
| 其他负债                     | -                | -                 | -                | 118,552.09     | 118,552.09        |
| 负债总计                     | 6,054,475,142.14 | -                 | -                | 9,982,963.43   | 6,064,458,105.57  |
| 利率敏感度缺口                  | 2,497,377,283.12 | 14,149,421,690.00 | 3,544,197,000.00 | 443,238,463.91 | 20,634,234,437.03 |
| 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 | 1 年以内            | 1-5 年             | 5 年以上            | 不计息            | 合计                |
| 资产                       |                  |                   |                  |                |                   |
| 银行存款                     | 5,908,067.85     | -                 | -                | -              | 5,908,067.85      |
| 存出保证金                    | 316,808.22       | -                 | -                | -              | 316,808.22        |
| 交易性金融资产                  | 8,592,319,700.00 | 15,724,082,700.00 | 2,430,128,000.00 | -              | 26,746,530,400.00 |
| 买入返售金融资产                 | 665,001,400.00   | -                 | -                | -              | 665,001,400.00    |
| 应收利息                     | -                | -                 | -                | 412,886,816.06 | 412,886,816.06    |
| 资产总计                     | 9,263,545,976.07 | 15,724,082,700.00 | 2,430,128,000.00 | 412,886,816.06 | 27,830,643,492.13 |
| 负债                       |                  |                   |                  |                |                   |
| 卖出回购金融资产款                | 7,258,737,080.03 | -                 | -                | -              | 7,258,737,080.03  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                 | -                | 5,212,912.49   | 5,212,912.49      |
| 应付托管费                    | -                | -                 | -                | 1,737,637.53   | 1,737,637.53      |
| 应付交易费用                   | -                | -                 | -                | 258,298.91     | 258,298.91        |
| 应付利息                     | -                | -                 | -                | 4,863,388.15   | 4,863,388.15      |
| 应交税费                     | -                | -                 | -                | 560,960.83     | 560,960.83        |
| 应付利润                     | -                | -                 | -                | 388,179,159.13 | 388,179,159.13    |
| 其他负债                     | -                | -                 | -                | 220,000.00     | 220,000.00        |
| 负债总计                     | 7,258,737,080.03 | -                 | -                | 401,032,357.04 | 7,659,769,437.07  |
| 利率敏感度缺口                  | 2,004,808,896.04 | 15,724,082,700.00 | 2,430,128,000.00 | 11,854,459.02  | 20,170,874,055.06 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|         |                                  |                             |                        |
|---------|----------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设      | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                             |                        |
|         | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                             |                        |
|         | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                             |                        |
| 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（2019 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
|         | +25 个基点                          | -136,044,410.88             | -135,543,262.93        |
| -25 个基点 | 136,044,410.88                   | 135,543,262.93              |                        |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2019 年 6 月 30 日，本基金无重大价格风险。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币 26,226,738,590.00 元（上年度末：26,746,530,400.00 元），无属于第三层次的余额。

###### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产未发

生转入或转出第三层次公允价值的情况。

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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              | -                 | -             |
|    | 其中：股票             | -                 | -             |
| 2  | 基金投资              | -                 | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 26,226,738,590.00 | 98.23         |
|    | 其中：债券             | 26,148,178,590.00 | 97.94         |
|    | 资产支持证券            | 78,560,000.00     | 0.29          |
| 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      | 18,316,406.84     | 0.07          |
| 8  | 其他各项资产            | 453,637,545.76    | 1.70          |
| 9  | 合计                | 26,698,692,542.60 | 100.00        |

### 7.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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投资沪港通股票。

### 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

本基金本报告期末未投资股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值              | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 72,779,000.00     | 0.35         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 5,753,829,000.00  | 27.88        |
|    | 其中：政策性金融债 | 5,753,829,000.00  | 27.88        |
| 4  | 企业债券      | 15,254,886,590.00 | 73.93        |
| 5  | 企业短期融资券   | 150,810,000.00    | 0.73         |
| 6  | 中期票据      | 2,223,298,000.00  | 10.77        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | 2,692,576,000.00  | 13.05        |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 26,148,178,590.00 | 126.72       |

**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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 170215    | 17 国开 15    | 8,400,000 | 863,184,000.00 | 4.18         |
| 2  | 1628005   | 16 华夏银行 02  | 6,000,000 | 600,240,000.00 | 2.91         |
| 3  | 170402    | 17 农发 02    | 5,500,000 | 552,475,000.00 | 2.68         |
| 4  | 1520065   | 15 北京银行 02  | 5,000,000 | 507,700,000.00 | 2.46         |
| 5  | 091501002 | 15 中国信达债 02 | 5,000,000 | 505,150,000.00 | 2.45         |

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码    | 证券名称      | 数量（份）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-----------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 1789288 | 17 建元 5A2 | 2,000,000 | 78,560,000.00 | 0.38         |

**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**

本基金本报告期末未投资贵金属。

**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**

本基金本报告期末未投资权证。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。



## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 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   | 416,118.42     |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 453,221,427.34 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 453,637,545.76 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未投资股票。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 |
| 200      | 99,025,820.22 | 19,805,009,088.92 | 100.00% | 154,954.84 | 0.00%  |

### 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 | 66,283.10 | 0.0003%  |

### 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

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                   |
|----------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2016年9月2日）基金份额总额   | 200,037,697.36    |
| 本报告期期初基金份额总额               | 19,805,059,167.43 |
| 本报告期期间基金总申购份额              | 241,780.01        |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额            | 136,903.68        |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                 |
| 本报告期末基金份额总额                | 19,805,164,043.76 |

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内，基金管理人及托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 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

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 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 |    |
| 广发证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；

(4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

(5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；

(6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 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             |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|------------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券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 |
| 广发证券 | 2,275,736,978.15 | 100.00%      | 4,899,700,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 天风证券 | -                | -            | -                | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -                | -            | -                | -              | -    | -            |

### 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  | 国寿安保安康纯债债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告          | 证券时报及公司网站 | 2019 年 1 月 19 日 |
| 2  | 国寿安保安康纯债债券型证券投资基金 2018 年度报告               | 证券时报及公司网站 | 2019 年 3 月 30 日 |
| 3  | 国寿安保安康纯债债券型证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2019 年第 1 号） | 证券时报及公司网站 | 2019 年 4 月 15 日 |
| 4  | 国寿安保安康纯债债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告          | 证券时报及公司网站 | 2019 年 4 月 22 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 20190101~20190630       | 19,805,009,088.92 | -    | -    | 19,805,009,088.92 | 100.00% |
| 个人   | -              | -                       | -                 | -    | -    | -                 | -       |
| -  | -              | -                       | -                 | -    | -    | -                 | -       |
| 产品特有风险   |                |                         |                   |      |      |                   |         |
| <p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。</p> <p>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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p> |                |                         |                   |      |      |                   |         |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保安康纯债债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保国寿安保安康纯债债券型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保国寿安保安康纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保安康纯债债券型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

### 12.3 查阅方式

- 12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfc.com.cn](http://www.gsfc.com.cn)
- 12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2019 年 8 月 28 日