

# 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)

**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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 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.....                         | 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> .....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8  |
| 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 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 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 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 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 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 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.....       | 34 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 34 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 35 |
| 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.....      | 35 |
| 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.....   | 35 |
| 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.....   | 35 |
| 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.....      | 36 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 36 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 36 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 36 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 37 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 37        |
| 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 ..... | 37        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | <b>37</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | <b>38</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 38        |
| 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 .....  | 38        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 38        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 38        |
| 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 .....     | 38        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 39        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 40        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....          | <b>42</b> |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                  | <b>42</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 42        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 43        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 43        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 基金名称         | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF) |
| 基金简称         | 国联安双佳信用债券(LOF)        |
| 场内简称         | 国安双佳                  |
| 基金主代码        | 162511                |
| 交易代码         | 162511                |
| 基金运作方式       | 契约开放式                 |
| 基金合同生效日      | 2012年6月4日             |
| 基金管理人        | 国联安基金管理有限公司           |
| 基金托管人        | 中国光大银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额   | 302,093,220.52 份      |
| 基金合同存续期      | 不定期                   |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所               |
| 上市日期         | 2012年8月22日            |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资策略   | 本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略，在严格控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得最大化的债券收益；并通过适当参与二级市场权益类品种投资，力争获取超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数  |
| 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低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |

### 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                    | 中国光大银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李华                             | 石立平                       |
|             | 联系电话 | 021-38992888                   | 010-63639180              |
|             | 电子邮箱 | customer.service@cpicfunds.com | shiliping@cebbank.com     |
| 客户服务电话      |      | 021-38784766/4007000365        | 95595                     |
| 传真          |      | 021-50151582                   | 010-63639132              |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼      | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |

|       |                           |                      |
|-------|---------------------------|----------------------|
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼 | 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心 |
| 邮政编码  | 200121                    | 100033               |
| 法定代表人 | 于业明                       | 李晓鹏                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                           |
|---------------------|---------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                     |
| 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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 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（2021年1月1日至2021年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 1,883,960.92              |
| 本期利润          | 2,903,713.91              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0093                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.09%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.10%                     |
| 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      | 12,568,973.74             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0416                    |
| 期末基金资产净值      | 258,973,310.98            |
| 期末基金份额净值      | 0.8573                    |
| 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   | 26.28%                    |

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认购或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、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         | 0.15%    | 0.02%       | -0.04%     | 0.03%         | 0.19%  | -0.01% |
| 过去三个月         | 0.91%    | 0.02%       | 0.45%      | 0.03%         | 0.46%  | -0.01% |
| 过去六个月         | 1.10%    | 0.07%       | 0.65%      | 0.04%         | 0.45%  | 0.03%  |
| 过去一年          | 0.50%    | 0.10%       | -0.20%     | 0.06%         | 0.70%  | 0.04%  |
| 过去三年          | 9.09%    | 0.08%       | 4.53%      | 0.07%         | 4.56%  | 0.01%  |
| 自基金份额转换日次日起至今 | 26.28%   | 0.09%       | 4.31%      | 0.07%         | 21.97% | 0.02%  |

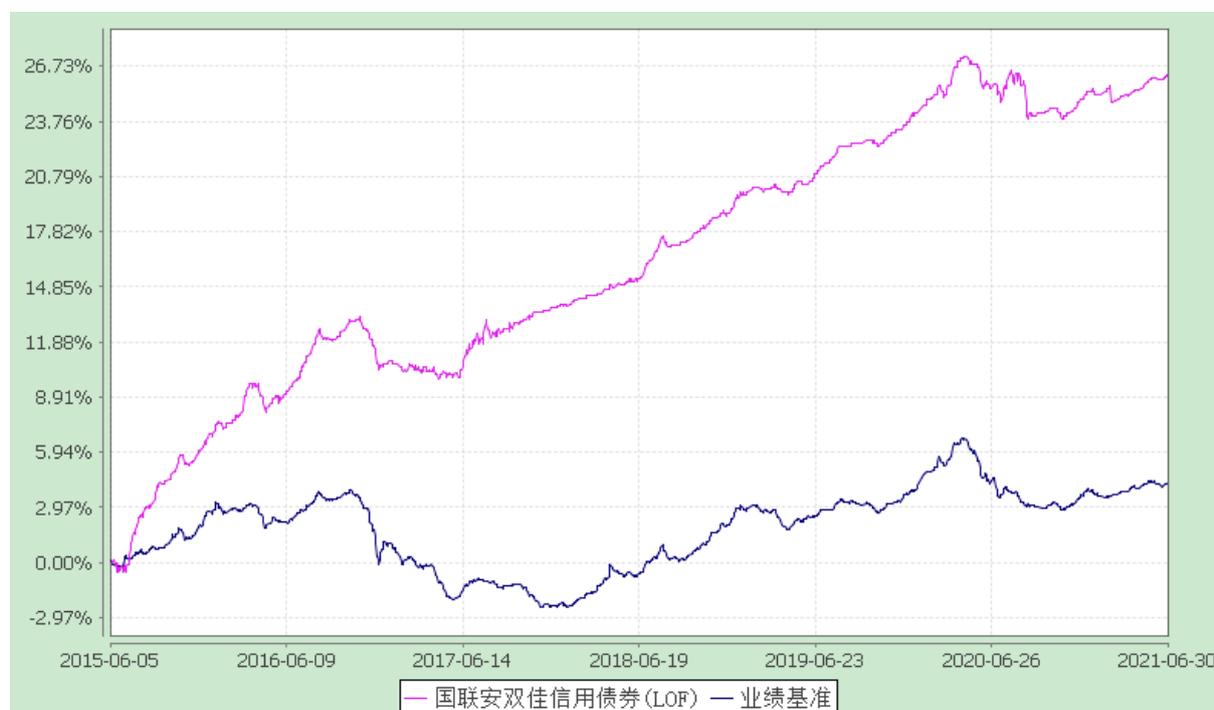
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2.2 自基金转型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

国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)

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

(2012年6月4日至2021年6月30日)



注：1、本基金份额转换日为2015年6月4日，在转换日日终，双佳A和双佳B以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值(NAV)转换为国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)

的份额；

2、本基金业绩比较基准为中债综合指数；

3、原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的基金合同于 2012 年 6 月 4 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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。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       |                 |   |
| 沈丹 | 本基金基金经理、兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安增鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、国联安增盈纯债债券型证券 | 2018-07-16      | 2021-01-27 | 11 年（自 2010 年起） | 沈丹女士，硕士研究生。2010 年 8 月至 2015 年 2 月在中国人保资产管理股份有限公司担任交易员；2015 年 3 月至 2017 年 2 月在江苏常熟农村商业银行股份有限公司任投资经理。2017 年 3 月加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2017 年 8 月至 2018 年 11 月兼任国联安鑫乾混合型证券投资基金和国联安鑫隆混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 6 月兼任国联安鑫怡混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 9 月至 2018 年 11 月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，2017 年 9 月至 2019 年 7 月兼任国联安安泰灵活配置混合型证券投资基金 |

|     |   |            |   |                |   |
|-----|---|------------|---|----------------|---|
|     | 投资基金基金经理、国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。                               |            |   |                | 的基金经理，2018 年 7 月至 2021 年 1 月兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 11 月至 2020 年 1 月兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月至 2021 年 1 月兼任国联安增鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 5 月至 2021 年 1 月兼任国联安增盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 1 月兼任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起担任国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。 |
| 张蕙显 | 本基金基金经理、兼任国联安增顺纯债债券型证券投资基金基金经理、国联安增盈纯债债券型证券投资基金基金经理、国联安增鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。 | 2021-01-19 | - | 7 年（2014 年起）   | 张蕙显女士，硕士研究生。2014 年 8 月起先后任广发银行金融市场部利率及衍生品交易员、交银金融租赁有限责任公司资金部资金交易（投资）经理、浙江泰隆商业银行资金运营中心债券投资经理，2020 年 6 月加入国联安基金管理有限公司固定收益部。2020 年 8 月起担任国联安增盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 9 月起兼任国联安增顺纯债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)、国联安增鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理。  |
| 张昊  | 本基金基金经理。  | 2021-03-25 | - | 7 年（自 2013 年起） | 张昊先生，硕士研究生。2011 年 7 月至 2015 年 5 月在北京银行股份有限公司从事同业金融、人民币信用债券交易投资等业务，2015 年 5 月起先后在嘉实基金管理有限公司担任债券交易员，新时代证券股份有限公司资产管理总部担任投资经理，平安银行股份有限公司资产管理事业部担任投资经理。2021 年 2 月加入国联安基金管理有限公司固定收益部。2021 年 3 月起担任国联安双佳信用债券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》、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)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

上半年，国内经济基本面修复延续，但增长动能出现转弱迹象。具体来看，基建地产韧性虽在但未来预期趋弱，制造业投资稳中有升，出口边际趋弱，消费复苏缓慢。通胀方面，大宗商品价格快速上涨的影响在逐步减弱，二季度之后 PPI 上涨压力或将有所减轻，PPI-CPI 剪刀差料将收敛。在宏观审慎与传统货币政策双支柱调控框架下，货币政策以稳为主的基调不变，财政后置带来的下半年地方债供给上量，对资金面整体压力有限。上半年收益率曲线先上后下行，受益于资金面平稳，3 年内收益率下行明显，期限利差走阔；信用债净供给减少加追逐确定性票息收益，带来信用利差二季度内再度压缩。上半年本组合维持中高等级中低杠杆的票息策略。

#### 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 1.10%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，基本面复苏趋势仍在，动能减弱带来的趋势性机会仍有待观察。货币政策外防冲击、内防风险，以稳健为主。中短端收益确定性较高，杠杆策略套息有效。产品将继续维持中高等级债券的投资策略，票息策略为基础，保持适度杠杆增厚收益。

#### 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

2021 年 1 月 4 日至 2021 年 3 月 30 日，本基金户数低于 200 户。

已通过持续营销活动增加基金户数。

### 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，中国光大银行股份有限公司在国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协

议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

## 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## 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：国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)

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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 826,654.15                     | 1,592,534.04                     |
| 结算备付金           |            | 222,812.60                     | 304,787.82                       |
| 存出保证金           |            | 3,748.85                       | 9,364.76                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 304,792,249.92                 | 307,753,004.00                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 304,792,249.92                 | 307,753,004.00                   |
| 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         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,994,814.85                   | 4,917,407.79                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>308,840,280.37</b>          | <b>314,577,098.41</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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       |            | 48,499,740.15                  | 46,549,730.17                    |
| 应付证券清算款         |            | 1,232.88                       | 500,218.63                       |
| 应付赎回款           |            | 99,182.82                      | 3,013.55                         |
| 应付管理人报酬         |            | 109,232.12                     | 114,082.70                       |
| 应付托管费           |            | 21,846.42                      | 22,816.56                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 12,154.98                      | 13,320.39                        |
| 应交税费            |            | 1,019,147.92                   | 1,022,534.60                     |

|                   |          |                       |                       |
|-------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 应付利息              |          | 5,871.95              | 10,370.93             |
| 应付利润              |          | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           |          | -                     | -                     |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 98,560.15             | 189,302.27            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>49,866,969.39</b>  | <b>48,425,389.80</b>  |
| <b>所有者权益：</b>     |          | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 246,404,337.24        | 256,014,963.17        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 12,568,973.74         | 10,136,745.44         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>258,973,310.98</b> | <b>266,151,708.61</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>308,840,280.37</b> | <b>314,577,098.41</b> |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8573 元，基金份额总额 302,093,220.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)

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<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>4,285,042.61</b>                      | <b>13,065,841.13</b>                          |
| 1.利息收入                |          | 5,878,802.08                             | 13,276,763.03                                 |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 7,558.81                                 | 58,467.63                                     |
| 债券利息收入                |          | 5,864,156.67                             | 13,195,836.05                                 |
| 资产支持证券利息收入            |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |          | 7,086.60                                 | 22,459.35                                     |
| 证券出借利息收入              |          | -  | -   |
| 其他利息收入                |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | -2,614,598.55                            | 3,340,269.96                                  |
| 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 | -2,614,598.55                            | 3,340,269.96                                  |
| 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 | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 1,019,752.99                             | -3,633,785.95                                 |
| 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 | 1,086.09                                 | 82,594.09                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>1,381,328.70</b>                      | <b>3,638,303.92</b>                           |
| 1. 管理人报酬              |          | 661,281.18                               | 1,357,539.78                                  |
| 2. 托管费                |          | 132,256.17                               | 271,507.95                                    |

|                            |          |                     |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|---------------------|
| 3. 销售服务费                   |          | -                   | -                   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 7,287.11            | 12,938.10           |
| 5. 利息支出                    |          | 453,195.31          | 1,839,916.25        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 453,195.31          | 1,839,916.25        |
| 6.税金及附加                    |          | 19,898.78           | 43,320.18           |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 107,410.15          | 113,081.66          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>2,903,713.91</b> | <b>9,427,537.21</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>2,903,713.91</b> | <b>9,427,537.21</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)

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<br>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）                        | 256,014,963.17                             | 10,136,745.44  | 266,151,708.61  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 2,903,713.91   | 2,903,713.91    |
| 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）      | -9,610,625.93                              | -471,485.61    | -10,082,111.54  |
| 其中：1.基金申购款                             | 372,257.19                                 | 17,626.86      | 389,884.05      |
| 2.基金赎回款                                | -9,982,883.12                              | -489,112.47    | -10,471,995.59  |
| 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）                        | 246,404,337.24                             | 12,568,973.74  | 258,973,310.98  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 588,280,300.10                             | 17,263,929.57  | 605,544,229.67  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 9,427,537.21   | 9,427,537.21    |
| 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）      | -159,505,473.27                            | -6,883,113.89  | -166,388,587.16 |
| 其中：1.基金申购款                             | 158,030,345.49                             | 6,526,058.80   | 164,556,404.29  |
| 2.基金赎回款                                | -317,535,818.76                            | -13,409,172.69 | -330,944,991.45 |
| 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）                        | 428,774,826.83                             | 19,808,352.89  | 448,583,179.72  |

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

国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）由国联安双佳信用分级债券型证券投资基金转型而成。国联安双佳信用分级债券型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”）《关于核准国联安双佳信用分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]101 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》等相关法律法规和《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2012 年 6 月 4 日生效。

根据《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金合同》及《国联安双佳信用分级债券型证券投资基金封闭期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》，国联安双佳信用分级债券型证券投资基金于 2015 年 6 月 4 日三年分级运作期届满，自 2015 年 6 月 5 日起转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称变更为“国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)”。于基金分级运作期届满日 2015 年 6 月 4 日日终，国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳 A 份额、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金之双佳 B 份额的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金份额。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，基金转型后首日规模为 621,251,633.71 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金合同》和《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）和债券回购等金融工具等。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中信用债券类资产的投资比例不低于固定收益类资产的 80%；股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%；现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准为中债综合指数。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国

证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 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[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费附加。

## 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|      |            |
|------|------------|
| 活期存款 | 826,654.15 |
| 定期存款 | -          |
| 其他存款 | -          |
| 合计   | 826,654.15 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021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             | 76,179,416.29  | -110,666.37 |
|               | 银行间市场             | 227,746,727.95 | 976,772.05  |
|               | 合计                | 303,926,144.24 | 866,105.68  |
| 资产支持证券        | -                 | -              | -           |
| 基金            | -                 | -              | -           |
| 其他            | -                 | -              | -           |
| 合计            | 303,926,144.24    | 304,792,249.92 | 866,105.68  |

### 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<br>2021年6月30日 |
|-----------|-------------------|
| 应收活期存款利息  | 335.67            |
| 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 | 100.30            |
| 应收债券利息    | 2,994,377.18      |

|            |              |
|------------|--------------|
| 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         | 1.70         |
| 合计         | 2,994,814.85 |

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息。

#### 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<br>2021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 | 12,154.98         |
| 合计          | 12,154.98         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提审计费       | 29,752.78         |
| 预提信息披露费     | 59,507.37         |
| 预提上清所账户查询费  | 300.00            |
| 预提账户维护费     | 9,000.00          |
| 合计          | 98,560.15         |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>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 | 313,875,846.14             | 256,014,963.17 |
| 本期申购 | 456,371.99                 | 372,257.19     |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,238,997.61 | -9,982,883.12  |
| 本期末           | 302,093,220.52 | 246,404,337.24 |

注：此处申购含转入份额，赎回含转换转出份额。

#### 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           | 28,689,480.93 | -18,552,735.49 | 10,136,745.44 |
| 本期利润           | 1,883,960.92  | 1,019,752.99   | 2,903,713.91  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,135,619.71 | 664,134.10     | -471,485.61   |
| 其中：基金申购款       | 43,075.24     | -25,448.38     | 17,626.86     |
| 基金赎回款          | -1,178,694.95 | 689,582.48     | -489,112.47   |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -             |
| 本期末            | 29,437,822.14 | -16,868,848.40 | 12,568,973.74 |

#### 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  | 6,622.63             |
| 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 | 907.35               |
| 其他        | 28.83                |
| 合计        | 7,558.81             |

注：此处其他列示的是交易保证金和直销申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本报告期内本基金无股票投资收益。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期内本基金无股票投资收益。

#### 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                   |
|----|----------------------|
|    | 2021年1月1日至2021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 | -2,614,598.55 |
| 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                           | -2,614,598.55 |

#### 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                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 302,480,010.56       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 298,583,308.98       |
| 减：应收利息总额               | 6,511,300.13         |
| 买卖债券差价收入               | -2,614,598.55        |

#### 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

本报告期内本基金无股利收益。

#### 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              | 1,019,752.99         |
| ——股票投资                 | -                    |
| ——债券投资                 | 1,019,752.99         |
| ——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                     | 1,019,752.99         |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,086.09                   |
| 合计      | 1,086.09                   |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 74.61                      |
| 银行间市场交易费用 | 7,212.50                   |
| 交易基金产生的费用 | -                          |
| 其中：申购费    | -                          |
| 赎回费       | -                          |
| 合计        | 7,287.11                   |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 账户维护费   | 18,150.00                  |
| 合计      | 107,410.15                 |

**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      |
|------------------------|--------------|
| 安联集团                   | 基金管理人的股东     |
| 国联安基金管理有限公司            | 基金管理人、基金销售机构 |
| 光大银行股份有限公司（“光大银行”）     | 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     |

**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**

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

**6.4.10.1.1 股票交易**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未通过关联方的交易单元进行过股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未通过关联方的交易单元进行过权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未通过关联方的交易单元进行过债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

**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内，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<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 661,281.18                     | 1,357,539.78                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,369.00                       | 5,014.00                            |

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 0.5% 年费率计提，基金管理费每日计提，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×0.5%÷当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 132,256.17                     | 271,507.95                          |

注：支付基金托管人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提，基金托管费每日计提，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×0.1%÷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内，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****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

**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自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目                    | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 期初持有的基金份额             | -                          | 8,961,492.00                    |
| 期间申购/买入总份额            | -                          | -                               |
| 期间因拆分变动份额             | -                          | -                               |
| 减：期间赎回/卖出总份额          | -                          | -                               |
| 期末持有的基金份额             | -                          | 8,961,492.00                    |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | -                          | 1.70%                           |

注：本基金管理人运用自有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

**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**

份额单位：份

| 关联方名称           | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2020 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 |
| 太保产险            | 285,574,056.14      | 94.53%           | 285,574,056.14        | 90.98%           |
| 太平洋安信农业保险股份有限公司 | -                   | -                | 40,658.28             | 0.01%            |

#### 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    |
| 光大银行股份有限公司 | 826,654.15           | 6,622.63 | 4,011,271.63         | 49,227.42 |

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“光大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 日的相关余额为人民币 222,812.60 元（2020 年 6 月 30 日：383,534.33 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内，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内，本基金均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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：债券 |      |            |            |        |        |        |          |          |          |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|----------|----------|----|
| 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：张) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 113050               | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债待上市  | 100.00 | 100.00 | 60       | 5,999.92 | 5,999.92 | -  |

#### 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 06 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 19,699,740.15 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<br>单价 | 数量(张)      | 期末估值总额        |
|-----------|------------------|------------|------------|------------|---------------|
| 150209    | 15 国开 09         | 2021-07-01 | 101.36     | 100,000.00 | 10,136,000.00 |
| 101800397 | 18 浙能源<br>MTN002 | 2021-07-07 | 103.28     | 106,000.00 | 10,947,680.00 |
| 合计        |                  |            |            | 206,000.00 | 21,083,680.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 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 28,800,000.00 元。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》及《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 30,038,000.00     | 59,930,000.00      |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 30,029,000.00     | 39,952,000.00      |
| 合计     | 60,067,000.00     | 99,882,000.00      |

注：本报告期末及上年度末，未评级的短期信用债券均为超短期融资债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 104,427,609.92    | 131,163,000.00     |
| AAA 以下 | 113,963,940.00    | 50,957,000.00      |
| 未评级    | -                 | -                  |
| 合计     | 218,391,549.92    | 182,120,000.00     |

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单。

#### 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期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发行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 0.00%。

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<br>2021年6月30日   | 1个月以<br>内      | 1-3个<br>月 | 3个月<br>-1年     | 1-5年           | 5年以<br>上     | 不计息          | 合计             |
|---------------------|----------------|-----------|----------------|----------------|--------------|--------------|----------------|
| 资产                  |                |           |                |                |              |              |                |
| 银行存款                | 826,654.15     | -         | -              | -              | -            | -            | 826,654.15     |
| 结算备付金               | 222,812.60     | -         | -              | -              | -            | -            | 222,812.60     |
| 存出保证金               | 3,748.85       | -         | -              | -              | -            | -            | 3,748.85       |
| 交易性金融资产             | 5,000,000.00   | -         | 106,263,049.92 | 187,377,000.00 | 6,152,200.00 | -            | 304,792,249.92 |
| 买入返售金融资产            | -              | -         | -              | -              | -            | -            | -              |
| 应收证券清算款             | -              | -         | -              | -              | -            | -            | -              |
| 应收利息                | -              | -         | -              | -              | -            | 2,994,814.85 | 2,994,814.85   |
| 应收股利                | -              | -         | -              | -              | -            | -            | -              |
| 应收申购款               | -              | -         | -              | -              | -            | -            | -              |
| 其他资产                | -              | -         | -              | -              | -            | -            | -              |
| 资产总计                | 6,053,215.60   | -         | 106,263,049.92 | 187,377,000.00 | 6,152,200.00 | 2,994,814.85 | 308,840,280.37 |
| 负债                  |                |           |                |                |              |              |                |
| 卖出回购金融资产款           | 48,499,740.15  | -         | -              | -              | -            | -            | 48,499,740.15  |
| 应付证券清算款             | -              | -         | -              | -              | -            | 1,232.88     | 1,232.88       |
| 应付赎回款               | -              | -         | -              | -              | -            | 99,182.82    | 99,182.82      |
| 应付管理人报酬             | -              | -         | -              | -              | -            | 109,232.12   | 109,232.12     |
| 应付托管费               | -              | -         | -              | -              | -            | 21,846.42    | 21,846.42      |
| 应付销售服务费             | -              | -         | -              | -              | -            | -            | -              |
| 应付交易费用              | -              | -         | -              | -              | -            | 12,154.98    | 12,154.98      |
| 应交税费                | -              | -         | -              | -              | -            | 1,019,147.92 | 1,019,147.92   |
| 应付利息                | -              | -         | -              | -              | -            | 5,871.95     | 5,871.95       |
| 其他负债                | -              | -         | -              | -              | -            | 98,560.15    | 98,560.15      |
| 负债总计                | 48,499,740.15  | -         | -              | -              | -            | 1,367,229.24 | 49,866,969.39  |
| 利率敏感度缺口             | -42,446,524.55 | -         | 106,263,049.92 | 187,377,000.00 | 6,152,200.00 | 1,627,585.61 | 258,973,310.98 |
| 上年度末<br>2020年12月31日 | 1个月以<br>内      | 1-3个<br>月 | 3个月<br>-1年     | 1-5年           | 5年以<br>上     | 不计息          | 合计             |
| 资产                  |                |           |                |                |              |              |                |

|           |                |               |                |                |               |              |                |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 银行存款      | 1,592,534.04   | -             | -              | -              | -             | -            | 1,592,534.04   |
| 结算备付金     | 304,787.82     | -             | -              | -              | -             | -            | 304,787.82     |
| 存出保证金     | 9,364.76       | -             | -              | -              | -             | -            | 9,364.76       |
| 交易性金融资产   | 15,000,500.00  | 30,085,000.00 | 140,538,000.00 | 111,379,000.00 | 10,750,504.00 | -            | 307,753,004.00 |
| 买入返售金融资产  | -              | -             | -              | -              | -             | -            | -              |
| 应收证券清算款   | -              | -             | -              | -              | -             | -            | -              |
| 应收利息      | -              | -             | -              | -              | -             | 4,917,407.79 | 4,917,407.79   |
| 应收股利      | -              | -             | -              | -              | -             | -            | -              |
| 应收申购款     | -              | -             | -              | -              | -             | -            | -              |
| 其他资产      | -              | -             | -              | -              | -             | -            | -              |
| 资产总计      | 16,907,186.62  | 30,085,000.00 | 140,538,000.00 | 111,379,000.00 | 10,750,504.00 | 4,917,407.79 | 314,577,098.41 |
| 负债        |                |               |                |                |               |              |                |
| 其他负债      | -              | -             | -              | -              | -             | 189,302.27   | 189,302.27     |
| 卖出回购金融资产款 | 46,549,730.17  | -             | -              | -              | -             | -            | 46,549,730.17  |
| 应付证券清算款   | -              | -             | -              | -              | -             | 500,218.63   | 500,218.63     |
| 应付赎回款     | -              | -             | -              | -              | -             | 3,013.55     | 3,013.55       |
| 应付管理人报酬   | -              | -             | -              | -              | -             | 114,082.70   | 114,082.70     |
| 应付托管费     | -              | -             | -              | -              | -             | 22,816.56    | 22,816.56      |
| 应付销售服务费   | -              | -             | -              | -              | -             | -            | -              |
| 应付交易费用    | -              | -             | -              | -              | -             | 13,320.39    | 13,320.39      |
| 应交税费      | -              | -             | -              | -              | -             | 1,022,534.60 | 1,022,534.60   |
| 应付利息      | -              | -             | -              | -              | -             | 10,370.93    | 10,370.93      |
| 负债总计      | 46,549,730.17  | -             | -              | -              | -             | 1,875,659.63 | 48,425,389.80  |
| 利率敏感度缺口   | -29,642,543.55 | 30,085,000.00 | 140,538,000.00 | 111,379,000.00 | 10,750,504.00 | 3,041,748.16 | 266,151,708.61 |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率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<br>2021年6月30日           | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 增加 1,377,670.66             | 增加 1,182,093.82     |
|    | 市场利率上升25个基点        | 减少 1,377,670.66             | 减少 1,182,093.82     |

#### 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。本基金投资组合中固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%，现金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%。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<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 304,792,249.92         | 117.69        | 307,753,004.00           | 115.63        |
| 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            | 304,792,249.92         | 117.69        | 307,753,004.00           | 115.63        |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%(2020 年 12 月 31 日：0%)，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于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析(2020 年 12 月 31 日：同)。

## 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            | 304,792,249.92 | 98.69         |
|    | 其中：债券             | 304,792,249.92 | 98.69         |
|    | 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      | 1,049,466.75   | 0.34          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,998,563.70   | 0.97          |
| 9  | 合计                | 308,840,280.37 | 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

本报告期末本基金未持有股票。

### 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

本报告期末本基金未持有股票。

## 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

本报告期内本基金未买入股票。

### 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

本报告期内本基金未卖出股票。

### 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 | 0.00 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 0.00 |

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

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      | 6,061,700.00   | 2.34         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,272,000.00  | 7.83         |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,272,000.00  | 7.83         |
| 4  | 企业债券      | 81,688,000.00  | 31.54        |
| 5  | 企业短期融资券   | 40,063,000.00  | 15.47        |
| 6  | 中期票据      | 156,114,500.00 | 60.28        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 593,049.92     | 0.23         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 304,792,249.92 | 117.69       |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 7.6 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  | 101800397 | 18 浙能源 MTN002 | 200,000 | 20,656,000.00 | 7.98         |
| 2  | 150209    | 15 国开 09      | 200,000 | 20,272,000.00 | 7.83         |
| 3  | 163871    | 21 兵装 S1      | 200,000 | 20,004,000.00 | 7.72         |
| 4  | 102000239 | 20 南航股 MTN004 | 200,000 | 19,980,000.00 | 7.72         |
| 5  | 1780143   | 17 铁道 12      | 100,000 | 10,227,000.00 | 3.95         |

### 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。

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   | 3,748.85     |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,994,814.85 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 2,998,563.70 |
|---|----|--------------|

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 127027 | 靖远转债 | 200,080.00 | 0.08         |
| 2  | 110053 | 苏银转债 | 182,040.00 | 0.07         |
| 3  | 127005 | 长证转债 | 58,570.00  | 0.02         |

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票，不存在流通受限情况的说明。

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 218          | 1,385,748.72  | 298,095,185.14 | 98.68% | 3,998,035.38 | 1.32%  |

#### 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 | 26,205.90 | 0.01%    |

#### 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<br>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                    | -                 |

注：截止本报告期末，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（2012年6月4日）基金份额总额 | 621,251,633.71 |
|--------------------------|----------------|

|               |                |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 313,875,846.14 |
| 本报告期基金总申购份额   | 456,371.99     |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 12,238,997.61  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 302,093,220.52 |

注：1.国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金份额由原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金 A 类份额和 B 类份额转换而来。转换前，原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金 A 类份额数为 14,910,940.92 份，原国联安双佳信用分级债券型证券投资基金 B 类份额数为 491,974,952.87 份；转换后，国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金起始份额数为 621,251,633.71 份。

2.总申购份额包含本报告期内发生的转换入份额；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 1 月 20 日，基金管理人发布《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》，张蕙显女士担任本基金的基金经理。
- 2、2021 年 1 月 28 日，基金管理人发布《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》，沈丹女士不再担任本基金的基金经理。
- 3、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。
- 4、2021 年 3 月 26 日，基金管理人发布《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》，张昊先生担任本基金的基金经理。
- 5、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 |    |
| 东方证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

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

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

### 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 |
| 东方证券 | 57,387,977.91 | 99.30%       | 149,000,000.00 | 100.00%      | -    | -            |
| 中信证券 | 407,202.05    | 0.70%        | -              | -            | -    | -            |

### 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  | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告                | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-01-20 |
| 3  | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)2020年第4季度报告             | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-01-22 |
| 4  | 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 |
| 5  | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中欧财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         | 2021-01-25 |
| 6  | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)               | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-01-25 |
| 7  | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要(更新)            | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-01-25 |
| 8  | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告                | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-01-28 |
| 9  | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书                   | 规定网站、深            | 2021-02-01 |

|    |  |                   |            |
|----|--|-------------------|------------|
|    | (更新)   | 圳证券交易所            |            |
| 10 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新  | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-02-01 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金提高基金份额净值精度并修改基金合同及托管协议的公告                               | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-08 |
| 15 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金基金合同   | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-08 |
| 16 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金托管协议   | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-08 |
| 17 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)   | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-03-11 |
| 18 | 国联安基金管理有限公司关于调整国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)单笔最低申购金额、追加单笔申购最低金额、单笔赎回最低份额和最低保留限额的公告 | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-24 |
| 19 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告  | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-26 |
| 20 | 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 |
| 21 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)   | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-03-31 |
| 22 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新  | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-03-31 |
| 23 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)2020 年年度报告  | 规定网站、深圳证券交易所      | 2021-03-31 |
| 24 | 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 |
| 25 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加度小满基金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         | 2021-04-08 |
| 26 | 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 |
| 27 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行相关费率优惠活动的公告                                       | 规定报刊、规定网站         | 2021-04-16 |
| 28 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)2021 年第 1   | 规定网站、深            | 2021-04-22 |

|    |   |              |            |
|----|---|--------------|------------|
|    | 季度报告                                      | 圳证券交易所       |            |
| 29 | 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 |
| 30 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书更新(2021 年第 5 号) | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-05-20 |
| 31 | 国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新           | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-05-20 |
| 32 | 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 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              | 2021 年 1 月 1 日<br>-2021 年 6 月 30 日 | 285,574,0<br>56.14 | -    | -    | 285,574,056.<br>14 | 94.53% |
| 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<br/>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<br/>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> |                |                                    |                    |      |      |                    |        |

### 11.2 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双佳信用分级债券型证券投资基金（现国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)）发行及募集的文件
- 2、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金合同》

- 3、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)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](http://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