

国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型  
发起式证券投资基金  
2021 年中期报告

2021 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 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 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	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
<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 报告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	32
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的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>33</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	33
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情况.....	34
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	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>34</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	34
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>37</b>
12.1 备查文件目录 .....	37
12.2 存放地点 .....	37
12.3 查阅方式 .....	38

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国寿安保泰瑞纯债一年定开债券发起式
基金主代码	008503
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 26 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,154,822,668.56 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	本基金在投资策略上兼顾投资原则以及定期开放基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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、回购套利策略等投资管理手段，对债券市场及债券收益率曲线的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	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，其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中低预期收益/风险品种。

### 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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	罗菲菲
	联系电话	010-50850744	010-58560666
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95568
传真		010-50850776	010-58560798
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100033	100031
法定代表人		王军辉	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	46,060,316.08
本期利润	61,883,040.87
加权平均基金份额本期利润	0.0287
本期加权平均净值利润率	2.73%
本期基金份额净值增长率	2.77%
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	145,991,071.59
期末可供分配基金份额利润	0.0678
期末基金资产净值	2,300,813,740.15
期末基金份额净值	1.0678
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	6.78%

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

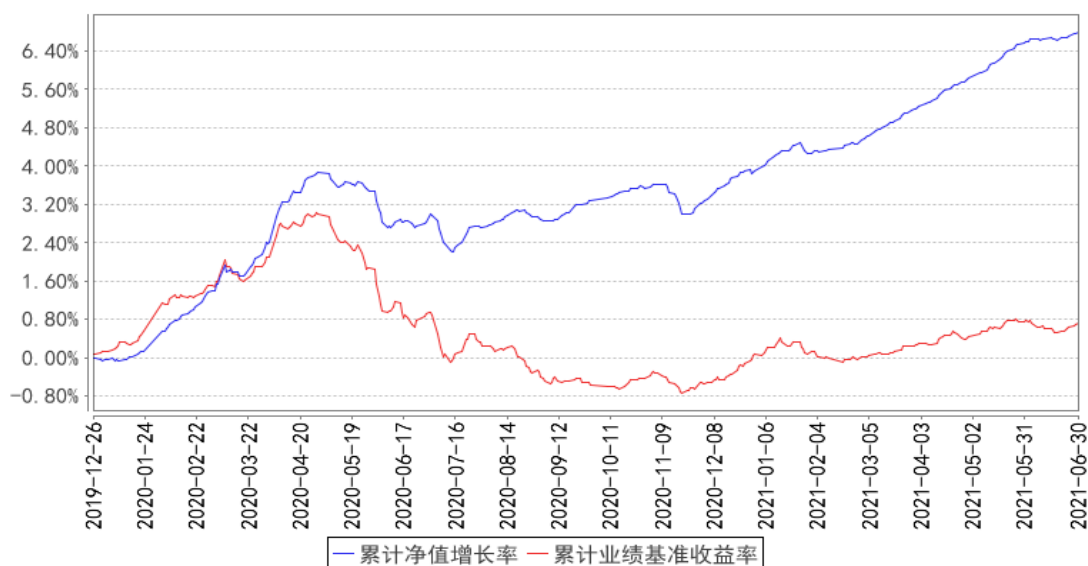
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.19%	0.02%	-0.04%	0.03%	0.23%	-0.01%

过去三个月	1.50%	0.02%	0.45%	0.03%	1.05%	-0.01%
过去六个月	2.77%	0.03%	0.65%	0.04%	2.12%	-0.01%
过去一年	3.85%	0.04%	-0.20%	0.06%	4.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.78%	0.06%	0.72%	0.08%	6.06%	-0.02%

### 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

国寿安保泰瑞纯债一年定开债券发起式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：本基金基金合同生效日为 2019 年 12 月 26 日，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 2019 年 12 月 26 日至 2021 年 06 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 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 81 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 3175.94 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2371.90 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		
陶尹斌	基金经理	2019 年 12 月 26 日	-	8 年	硕士研究生。曾任中国人寿资产管理有限公司研究员，兴全基金管理有限公司研究员、投资经理助理、投资经理，现任国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金、国寿安保中债 1-3 年国开行债券指数型证券投资基金、国寿安保泰恒纯债债券型证券投资基金、国寿安保泰弘纯债债券型证券投资基金、国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保泰祥纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金和国寿安保瑞和纯债 66 个月定期开放债券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《中华人民共和国证券投资基金法》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

上半年债券市场在震荡中走强，这与去年底市场普遍预期上半年将出现收益率年内高点明显不同，背后核心的预期差来自资金面的宽松。上半年除 1 月底财政投放滞后央行操作谨慎导致资金面出现阶段性紧张外，其他大部分时间都保持了资金利率绝对收益不低但平稳性极强的状态。投资者担心的地方债发行冲击迟迟落空，反而导致市场出现“资产荒”和“欠配”的局面。同时经济数据整体表现平淡，通胀数据虽冲高但主要由于供给收缩影响，基本面无法主导债券市场。在上述因素的综合作用下，债券市场走出了偏强的局面，同时受益于资金面的平稳，中短端利率债和中高等级信用债收益率下行幅度更大，期限利差位置相对高位，而信用利差显著压缩。

本基金在报告期内坚守票息策略，年初获申购后将主要仓位配置在中高等级中等久期信用债上，既享受了票息收益，又额外捕捉了信用利差压缩的结构化行情，保证净值稳步增长。

##### 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 1.0678 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.77%，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

展望下半年，考虑经过半年的超预期下行，目前债券收益率绝对水平已经相对偏低，低利率水平往往伴随较高的波动率，同时地方债的发行高峰总归要来临，可能对资金面造成阶段性冲击。中期来看基本面和通胀下行的确定性较强，货币政策保持中性宽松的概率也较大，对应债券市场仍然是易涨难跌，所以下阶段需要重点把握的是配置的节奏，在市场出现阶段性利空冲击后逢低加仓是更为占优的操作。

本基金将继续坚持票息策略，逢低置换和新增个券，中等期限品种前期涨幅较大，适当进行优化调整。

#### 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 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：国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,974,300.38	3,981,087.46
结算备付金		29,892,247.57	29,921,622.51
存出保证金		68,984.29	50,084.11
交易性金融资产	6.4.7.2	2,912,925,000.00	2,332,810,240.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,894,375,000.00	2,205,924,200.00
资产支持证券投资		18,550,000.00	126,886,040.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	47,598,419.76	32,971,886.53
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		2,992,458,952.00	2,399,734,920.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		690,162,332.84	160,000,000.00
应付证券清算款		143,986.28	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		566,744.72	279,666.10
应付托管费		188,914.94	93,222.05

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	49,592.62	53,963.87
应交税费		259,753.50	179,029.61
应付利息		184,626.80	18,339.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	180,000.00
负债合计		691,645,211.85	160,804,221.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,154,822,668.56	2,154,822,668.56
未分配利润	6.4.7.10	145,991,071.59	84,108,030.72
所有者权益合计		2,300,813,740.15	2,238,930,699.28
负债和所有者权益总计		2,992,458,952.00	2,399,734,920.61

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0678 元，基金份额总额 2,154,822,668.56 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	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
一、收入		76,276,675.24	35,669,474.17
1. 利息收入		59,723,578.23	26,979,889.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	203,932.46	199,965.53
债券利息收入		57,989,327.40	24,316,808.76
资产支持证券利息收入		1,496,695.97	1,467,847.28
买入返售金融资产收入		33,622.40	995,267.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		730,372.22	10,524,091.46
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	730,372.22	10,280,799.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	243,292.32
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	15,822,724.79	-1,834,895.64
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	-	388.89
减: 二、费用		14,393,634.37	6,875,029.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,375,845.99	1,522,786.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,125,282.05	507,595.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	33,432.68	31,061.73
5. 利息支出		9,546,923.35	4,622,429.85
其中: 卖出回购金融资产支出		9,546,923.35	4,622,429.85
6. 税金及附加		188,674.94	76,274.07
7. 其他费用	6.4.7.20	123,475.36	114,881.72
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		61,883,040.87	28,794,444.43
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		61,883,040.87	28,794,444.43

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,154,822,668.56	84,108,030.72	2,238,930,699.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	61,883,040.87	61,883,040.87
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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	2,154,822,668.56	145,991,071.59	2,300,813,740.15

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,000,018,000.02	-590,054.68	999,427,945.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,794,444.43	28,794,444.43
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	1,000,018,000.02	28,204,389.75	1,028,222,389.77

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

国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金（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[2019]2449号文《关于准予国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2019 年 12 月 20 日至 2019 年 12 月 25 日向社会公开发行募集，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(2019)验字第 61090605\_A13 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 2019 年 12 月 26 日正式生效。本基金为契约型、定期开放式，存续期限不定。本基金自基金合同生效后，每年开放一次。本基金第一个开放期为基金合同生效之日后 12 个月对日起（包括该日）不少于 2 个工

作日、不超过 20 个工作日的期间；第二个开放期为基金合同生效之日后 24 个月的对日起（包括该日）不少于 2 个工作日、不超过 20 个工作日的期间，以此类推。如该对日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。本基金第一个封闭期为自基金合同生效之日起（包括该日）至第一个开放期起始日的前一日的期间。之后的每个封闭期为上一个开放期结束之日次日起（包括该日）至下一个开放期起始日的前一日的期间，以此类推。在每个封闭期内本基金采取封闭运作模式，本基金不接受基金份额的申购与赎回，也不上市交易。首次募集规模为 1,000,018,000.02 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、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、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换公司债、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、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）、国债期货，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）。

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%，但在每个开放期的前 1 个月和后 1 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。封闭期内，本基金在每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，在每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 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》《公开募集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〈年度和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日的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**

##### **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**

根据中国财政部、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，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；

根据中国财政部、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；

根据中国财政部、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；



根据中国财政部、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；

根据中国财政部、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；

根据中国财政部、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据中国财政部、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

根据中国财政部、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
	2021年6月30日
活期存款	1,974,300.38
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	1,974,300.38

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	510,940,780.89	509,091,000.00	-1,849,780.89
	银行间市场	2,376,827,760.25	2,385,284,000.00	8,456,239.75
	合计	2,887,768,541.14	2,894,375,000.00	6,606,458.86
资产支持证券	18,548,000.00	18,550,000.00	2,000.00	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,906,316,541.14	2,912,925,000.00	6,608,458.86	

##### 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	653.36
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	13,451.50
应收债券利息	47,489,301.88
应收资产支持证券利息	94,982.02
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	31.00
合计	47,598,419.76

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告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 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	49,592.62
合计	49,592.62

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.15

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,154,822,668.56	2,154,822,668.56
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,154,822,668.56	2,154,822,668.56

注：本期申购包含基金红利再投资、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	103,263,556.15	-19,155,525.43	84,108,030.72
本期利润	46,060,316.08	15,822,724.79	61,883,040.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	149,323,872.23	-3,332,800.64	145,991,071.59

#### 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	12,755.36
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	190,504.07
其他	673.03
合计	203,932.46

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金于本报告期无股票投资收益。

#### 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	730,372.22
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	730,372.22
----	------------

#### 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	2,852,557,508.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,810,753,269.21
减：应收利息总额	41,073,866.97
买卖债券差价收入	730,372.22

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	109,990,310.82
减：卖出资产支持证券成本总额	108,279,000.00
减：应收利息总额	1,711,310.82
资产支持证券投资收益	-

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具投资收益。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	15,822,724.79
股票投资	-
债券投资	15,879,764.79
资产支持证券投资	-57,040.00
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	15,822,724.79

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,157.68
银行间市场交易费用	32,275.00
合计	33,432.68

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	15,615.21
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	123,475.36

#### 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	基金管理人、注册登记机构、直销机构
民生银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东

中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）	基金管理人股东之股东的联营企业

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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,375,845.99	1,522,786.76
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基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,125,282.05	507,595.61

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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						
2021 年 1 月 1 日至 2021 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
民生银行	50,005,452.05	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2020 年 1 月 1 日至 2020 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
民生银行	50,357,650.00	-	-	-	107,545,000.00	25,949.45

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期内未进行转融通证券出借业务。



#### 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	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
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.46%	1.00%

##### 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		上年度末	
	2021 年 6 月 30 日		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 (%)
中国人寿	1,952,293,589.06	90.60	1,952,293,589.06	90.60

##### 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
民生银行	1,974,300.38	12,755.36	3,618,851.61	27,871.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均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(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

本基金于本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于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 2021 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 400,162,332.84 元，是以如下债券作为抵押：

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
101764035	17 西宁城投 MTN001	2021 年 7 月 1 日	100.36	27,000	2,709,720.00
101900813	19 四川路桥 MTN001	2021 年 7 月 1 日	101.02	242,000	24,446,840.00
102002309	20 红谷滩 MTN001	2021 年 7 月 1 日	102.33	500,000	51,165,000.00
102100866	21 晋交投 MTN002	2021 年 7 月 1 日	100.67	594,000	59,797,980.00
132000007	20 天成租赁 GN001	2021 年 7 月 1 日	100.03	500,000	50,015,000.00
180406	18 农发 06	2021 年 7 月 1 日	107.10	400,000	42,840,000.00
200006	20 付息国债 06	2021 年 7 月 1 日	96.30	194,000	18,682,200.00
200016	20 付息国债 16	2021 年 7 月 1 日	101.36	200,000	20,272,000.00
102000191	20 成华棚改 MTN001	2021 年 7 月 2 日	100.23	532,000	53,322,360.00
101764035	17 西宁城投 MTN001	2021 年 7 月 5 日	100.36	532,000	53,391,520.00
102100918	21 首创置业 MTN001	2021 年 7 月 5 日	100.87	495,000	49,930,650.00
合计				4,216,000	426,573,270.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 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 270,000,000.00 元，其中 50,000,000.00 元于 2021 年 7 月 2 日到期，20,000,000.00 元于 2021 年 7 月 5 日到期，220,000,000.00 元于 2021 年 7 月 7 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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末参与转融通业务。

## 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管理人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在开放期内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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的

匹配与平衡。本基金的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。

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，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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、资产支持证券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,974,300.38	-	-	-	1,974,300.38
结算备付金	29,892,247.57	-	-	-	29,892,247.57
存出保证金	68,984.29	-	-	-	68,984.29
交易性金融资产	1,140,538,000.00	1,690,015,000.00	82,372,000.00	-	2,912,925,000.00
应收利息	-	-	-	47,598,419.76	47,598,419.76
资产总计	1,172,473,532.24	1,690,015,000.00	82,372,000.00	47,598,419.76	2,992,458,952.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	566,744.72	566,744.72
应付托管费	-	-	-	188,914.94	188,914.94

应付证券清算款	-	-	-	143,986.28	143,986.28
卖出回购金融资产款	690,162,332.84	-	-	-	690,162,332.84
应付交易费用	-	-	-	49,592.62	49,592.62
应付利息	-	-	-	184,626.80	184,626.80
应交税费	-	-	-	259,753.50	259,753.50
其他负债	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	690,162,332.84	-	-	1,482,879.01	691,645,211.85
利率敏感度缺口	482,311,199.40	1,690,015,000.00	82,372,000.00	46,115,540.75	2,300,813,740.15
上年度末 2020 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	3,981,087.46	-	-	-	3,981,087.46
结算备付金	29,921,622.51	-	-	-	29,921,622.51
存出保证金	50,084.11	-	-	-	50,084.11
交易性金融资产	1,543,140,840.00	715,315,400.00	74,354,000.00	-	2,332,810,240.00
应收利息	-	-	-	32,971,886.53	32,971,886.53
资产总计	1,577,093,634.08	715,315,400.00	74,354,000.00	32,971,886.53	2,399,734,920.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	279,666.10	279,666.10
应付托管费	-	-	-	93,222.05	93,222.05
卖出回购金融资产款	160,000,000.00	-	-	-	160,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	53,963.87	53,963.87
应付利息	-	-	-	18,339.70	18,339.70
应交税费	-	-	-	179,029.61	179,029.61
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	160,000,000.00	-	-	804,221.33	160,804,221.33
利率敏感度缺口	1,417,093,634.08	715,315,400.00	74,354,000.00	32,167,665.20	2,238,930,699.28

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	2. 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基准点，其他变量不变；		
	3. 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。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	+25 个基准点	-9,879,815.72	-6,400,823.58
	-25 个基准点	9,879,815.72	6,400,823.58

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

#### 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股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最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%，但在每个开放期的前 1 个月和后 1 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。封闭期内，本基金在每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，在每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2021 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 2,912,925,000.00 元（上年度末：2,332,810,240.00 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 2021 年 8 月 30 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	2,912,925,000.00	97.34
	其中：债券	2,894,375,000.00	96.72
	资产支持证券	18,550,000.00	0.62
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	31,866,547.95	1.06
8	其他各项资产	47,667,404.05	1.59
9	合计	2,992,458,952.00	100.00

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未持有股票。

#### 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	39,532,000.00	1.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	331,084,000.00	14.39
	其中：政策性金融债	42,840,000.00	1.86
4	企业债券	429,176,000.00	18.65
5	企业短期融资券	582,677,000.00	25.32
6	中期票据	1,511,906,000.00	65.71
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,894,375,000.00	125.80

#### 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	1922007	19 华融租赁债 01	1,400,000	138,362,000.00	6.01
2	101769025	17 晋路桥 MTN002	1,000,000	104,050,000.00	4.52
3	042000520	20 建安投资 CP003	1,000,000	100,900,000.00	4.39
4	102100866	21 晋交投 MTN002	900,000	90,603,000.00	3.94
5	143705	18 蓝星 01	900,000	90,000,000.00	3.91

#### 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

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	168538	恒信 26A2	200,000	18,550,000.00	0.81

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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持有国债期货。



## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

报告期内本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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	68,984.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	47,598,419.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,667,404.05

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未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 (%)
5	430,964,533.71	2,154,822,668.56	100.00	-	-

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人的从业人员本报告期末未持有本基金。

## 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人和本基金经理本报告期末未持有本基金。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	0.46	10,000,200.02	0.46	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	0.46	10,000,200.02	0.46	3年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年12月26日）基金份额总额	1,000,018,000.02
本报告期期初基金份额总额	2,154,822,668.56
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,154,822,668.56

## § 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，基金管理人于 2021 年 3 月 3 日发布公告，岳海先生自 2021 年 3 月 3 日起任公司总经理助理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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	
兴业证券	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，本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
兴业证券	415,934,120.00	100.00%	26,373,000,000.00	100.00%	-	-

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	国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 22 日
2	国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
3	国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 14 日
4	国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书更新（2021 年第 1 号）	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 14 日
5	国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 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	20210101~20210630	1,962,293,789.08	-	-	1,962,293,789.08	91.07
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

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。

### 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泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式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 报告期内国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式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.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.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

2021 年 8 月 31 日