

# 国联安增鑫纯债债券型证券投资基金

## 2022 年第 2 季度报告

2022 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十一日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 国联安增鑫纯债债券   |
| 基金主代码      | 006152  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019 年 1 月 3 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,050,308,812.82 份  |
| 投资目标       | 在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资策略       | 本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券 |

|                 |  |                |
|-----------------|--|----------------|
|                 | 挖掘策略等。   |                |
| 业绩比较基准          | 中债综合指数收益率  |                |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。 |                |
| 基金管理人           | 国联安基金管理有限公司  |                |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司   |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 国联安增鑫纯债债券 A  | 国联安增鑫纯债债券 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 006152   | 006153         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,048,053,460.60 份                                       | 2,255,352.22 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |              |
|----------------|---|--------------|
|                | 国联安增鑫纯债债券 A                             | 国联安增鑫纯债债券 C  |
| 1.本期已实现收益      | 8,620,261.56                            | 18,482.08    |
| 2.本期利润         | 9,880,783.68                            | 21,244.75    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0094                                  | 0.0093       |
| 4.期末基金资产净值     | 1,085,040,823.00                        | 2,334,254.74 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0353                                  | 1.0350       |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

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

##### 1、国联安增鑫纯债债券 A:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 0.92%      | 0.02%         | 0.29%          | 0.04%                 | 0.63% | -0.02% |
| 过去六个月          | 1.47%      | 0.03%         | 0.38%          | 0.05%                 | 1.09% | -0.02% |
| 过去一年           | 3.17%      | 0.02%         | 1.83%          | 0.05%                 | 1.34% | -0.03% |
| 过去三年           | 9.59%      | 0.03%         | 3.53%          | 0.06%                 | 6.06% | -0.03% |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -     | -      |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 10.93%     | 0.03%         | 3.60%          | 0.06%                 | 7.33% | -0.03% |

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。

##### 2、国联安增鑫纯债债券 C:

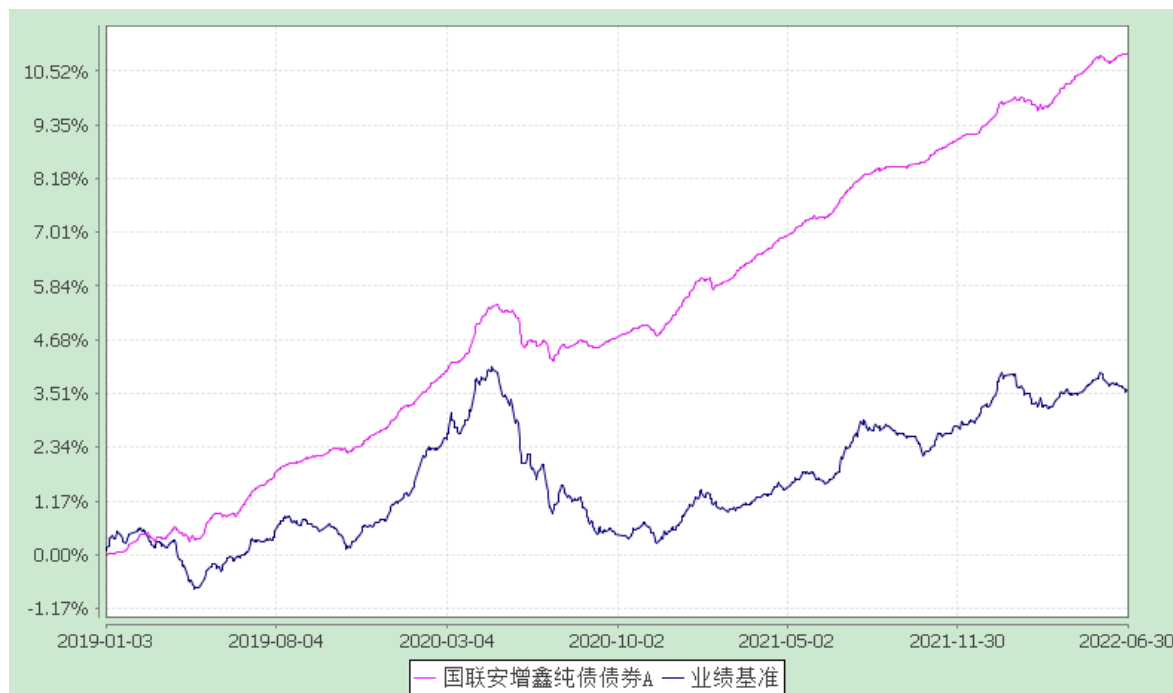
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 0.91%      | 0.02%         | 0.29%          | 0.04%                 | 0.62% | -0.02% |
| 过去六个月          | 1.43%      | 0.03%         | 0.38%          | 0.05%                 | 1.05% | -0.02% |
| 过去一年           | 3.10%      | 0.02%         | 1.83%          | 0.05%                 | 1.27% | -0.03% |
| 过去三年           | 9.18%      | 0.03%         | 3.53%          | 0.06%                 | 5.65% | -0.03% |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -     | -      |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 10.46%     | 0.03%         | 3.60%          | 0.06%                 | 6.86% | -0.03% |

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

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安增鑫纯债债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2019 年 1 月 3 日至 2022 年 6 月 30 日)

##### 1. 国联安增鑫纯债债券 A:



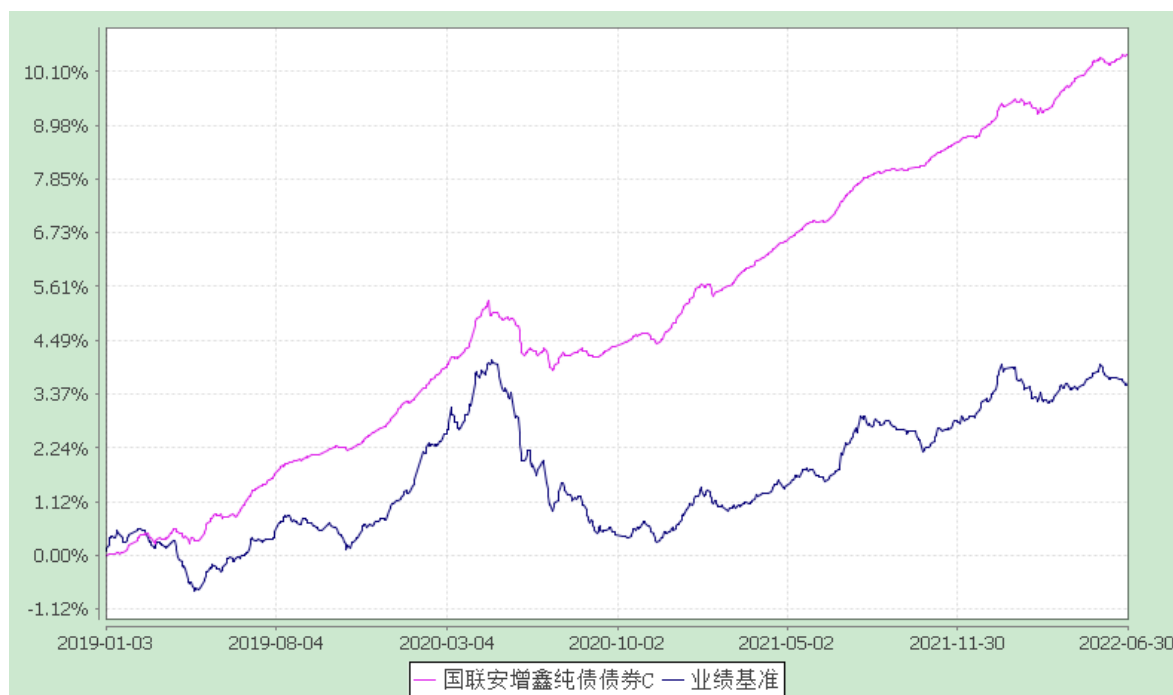
注：1、本基金业绩比较基准为中债综合指数收益率；

2、本基金基金合同于 2019 年 1 月 3 日生效；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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

## 2. 国联安增鑫纯债债券 C:



- 注：1、本基金业绩比较基准为中债综合指数收益率；
- 2、本基金基金合同于 2019 年 1 月 3 日生效；
- 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；
- 4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限       | 说明  |
|-----|--------------------------|-------------|------|--------------|---|
|     |                          | 任职日期        | 离任日期 |              |   |
| 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 | 2021-01-19  | -    | 8 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 |

|  |   |  |  |   |
|--|---|--|--|---|
|  | 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、国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理、国联安鑫元 1 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、国联安恒泰 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。 |  |  | 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，2021 年 8 月起兼任国联安鑫元 1 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 3 月起兼任国联安恒泰 3 个月定期开放纯债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》、《国联安增鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽

责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，国内经济在年初定调的三重压力下，又经历了一次预期之外的疫情扰动。4 月份社零、工增、出口等经济读数及金融数据总量断崖式下跌。外围地缘冲突推升全球能源价格快速上升，联储受累于高通胀而加速紧缩，人民币汇率走高。随着 6 月份复工复产逐步推进，市场悲观预期触底反弹，国内风险偏好修复。资金价格低位稳定，基本面强预期与弱现实的拉扯下，债券曲线进一步陡峭化。

展望三季度，疫后复苏是国内经济主基调，关注 7 月份政治局会议增量政策的出台，控制产品久期。预计货币环境短时间内仍将维持充裕的状态，但随着经济回升带来的融资需求改善，银行间资金或会有一定程度的分流，从而对当前曲线短端形成压力。操作方面维持高等级、短久期、杠杆套息策略。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现



本报告期内,国联安增鑫 A 的份额净值增长率为 0.92%,同期业绩比较基准收益率为 0.29%;  
国联安增鑫 C 的份额净值增长率为 0.91%,同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中:股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,220,339,316.02 | 99.87        |
|    | 其中:债券             | 1,220,339,316.02 | 99.87        |
|    | 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      | 1,632,231.79     | 0.13         |
| 8  | 其他各项资产            | -                | -            |
| 9  | 合计                | 1,221,971,547.81 | 100.00       |

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

**5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

本报告期末本基金未持有港股通股票。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

本报告期末本基金未持有股票。

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 427,179,478.35   | 39.29        |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,873,473.97    | 5.60         |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 81,019,638.36    | 7.45         |
| 6  | 中期票据      | 612,923,144.65   | 56.37        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 99,217,054.66    | 9.12         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,220,339,316.02 | 112.23       |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 数量（张）     | 公允价值(元)            | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|-----------|--------------------|--------------|
| 1  | 102000624 | 20 中铁股<br>MTN001B | 1,000,000 | 100,655,720.5<br>5 | 9.26         |
| 2  | 102000468 | 20 中石油<br>MTN001  | 900,000   | 90,974,465.75      | 8.37         |
| 3  | 102002206 | 20 常城建<br>MTN003  | 800,000   | 83,713,876.16      | 7.70         |
| 4  | 2022045   | 20 招银租赁债<br>01    | 800,000   | 83,264,153.42      | 7.66         |

|   |         |                  |         |               |      |
|---|---------|------------------|---------|---------------|------|
| 5 | 1928011 | 19 工商银行二<br>级 03 | 800,000 | 83,005,194.52 | 7.63 |
|---|---------|------------------|---------|---------------|------|

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，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中除工商银行、农业银行、中国银行和建设银行外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

19 工商银行二级 03（1928011）的发行主体中国工商银行股份有限公司，深圳市分行因理财非标融资投前调查不到位；贷款“三查”不到位，信贷资金被挪用，于 2021 年 11 月 8 日被深圳银保监局

罚款 230.00 万元。漳州开发区支行因按揭贷款管理不审慎，于 2021 年 12 月 20 日被漳州银保监分局罚款 265.00 万元。辽宁省分行因 1、违反金融消费者权益保护制度建设、消费者金融信息保护、金融营销宣传等相关管理规定；2、未按规定报送单位银行结算账户撤销等资料；3、未按规定履行假币收缴程序；4、违反规定占压财政性资金；5、违反信用信息提供、查询及异议处理相关规定；6、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告，于 2022 年 1 月 13 日被央行沈阳分行处以罚款 326.1 万元。因中国工商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在抵押物价值 EAST 数据存在偏差、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等十项违法违规为、理财产品登记不规范以及 2018 年行政处罚问题依然存在，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 360 万元。荆门分行因信贷管理严重失职，于 2022 年 5 月 16 日被荆门银保监分局处以罚款 610 万元。重庆市分行因 1、超过期限或未向人民银行报送账户开立、撤销等资料；2、存在占压财政资金行为；3、对外支付残缺、污损的人民币；4、未准确、完整、及时报送个人信用信息；5、未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额和可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易；6、未按要求对金融消费者投诉进行正确分类；漏报投诉数据；未按要求向金融消费者披露与金融产品和服务有关的重要内容，于 2022 年 6 月 8 日被央行重庆营业管理部处以罚款 604.6 万元。安徽省分行因 1、单位银行结算账户未按时向人民币结算账户管理系统备案、个人银行结算账户未向或未在规定时间内向账户管理系统中备案、“账户管家”产品（多层账户）中的子账户实际对外发生结算业务未经人民银行核准、“账户管家”产品（多层账户）中的子账户实际对外发生结算业务未经人民银行备案、单位商户使用个人银行账户作为收单结算账户；2、现金从业人员挑剔假币专业能力不足、未按规定收缴假币、发生假币误收；3、经收预算收入未及时划缴国库存在占压行为；4、未按规定开展持续的客户身份识别、未按规定重新识别客户、未按规定对高风险客户采取强化识别措施；5、部分 ETC 预登记业务办理未经消费者明示同意、漏报投诉数据，于 2022 年 6 月 8 日被央行合肥中心支行处以罚款 618.7 万元。吉林省分行因 1、占压财政资金；2、违反账户管理规定；3、违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；4、未按规定履行客户身份识别义务；5、未按要求向金融消费者披露与金融产品和服务有关的重要内容，于 2022 年 6 月 9 日被央行长春中心支行处以罚款 506.16 万元。

19 农业银行二级 04（1928009）的发行主体中国农业银行股份有限公司，南平分行因贷后管理不到位，导致个人信贷资金流入股市等违法违规行为，于 2021 年 7 月 24 日被中国银保监会南平监管分局没收违法所得 4.8 万元，并处以合计 250 万元罚款。广州流花支行因贷款业务严重违反审慎经营规则（个人经营性贷款、流动资金贷款被挪用入房地产市场），于 2021 年 11 月 15 日被广东银保监局罚款 960.00 万元。崇左分行因 1、未落实个人银行账户实名制管理规定；2、违规使用

个人金融信息；3、未严格落实银行账户风险监测要求；4、未按规定完整保存客户身份资料，于 2022 年 1 月 12 日被央行崇左市中心支行处以罚款 1142.5 万元。福州分行因 1、未按规定将土地使用权及在建工程纳入抵押担保；2、未落实贷款受托支付管理规定；3、未按工程进度发放贷款；4、发放流动资金贷款用于固定资产投资，于 2022 年 1 月 25 日被福建银保监局处以罚款 650 万元。因中国农业银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报贷款核销业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据等十五项违法违规行为、理财产品登记不规范以及 2018 年行政处罚问题依然存在，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 480 万元。

18 中国银行二级 02（1828011）的发行主体中国银行股份有限公司，温州市分行因 1.违反有关清算管理规定；2.超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料，于 2021 年 7 月 13 日被中国人民银行温州市中心支行罚款 202 万元。上海市分行因 1、2017 年至 2020 年，该分行个人贷款业务内部控制严重违反审慎经营规则；2、2017 年至 2020 年，该分行发放部分首付款比例不符合条件的个人住房贷款；3、2017 年至 2020 年，该分行部分个人贷款资金违规用于购房或违规流入资本市场；4、2019 年 1 月至 9 月，该分行某应付账款融资业务存在以贷收费的违规行为；5、2020 年 6 月，该分行某信用证议付融资款违规流入资本市场，于 2021 年 10 月 8 日被上海银保监局罚款 540.00 万元。因中国银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等十六项违法违规行为、理财产品登记不规范以及 2018 年行政处罚问题依然存在，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 480 万元。因理财业务老产品规模在部分时点出现反弹，于 2022 年 5 月 26 日被银保监会处以罚款 200 万元。海南省分行因开立个人银行结算账户未备案、开立个人银行结算账户超期限备案，于 2022 年 5 月 27 日被央行海口中心支行警告，并处以罚款 248 万元。

18 建设银行二级 01（1828010）的发行主体中国建设银行股份有限公司，其湖州分行，因固定资产贷款发放不审慎等违法违规行为，于 2021 年 7 月 5 日被中国银保监会湖州监管分局处以罚款 255 万元。其上海自贸试验区分行，因 2019 年 12 月，该分行部分流动资金贷款违规流入房地产市场，于 2021 年 7 月 16 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款 200 万元。其新度支行，因网点操作风险管理不到位、员工行为管理不到位、小微快贷业务管理不到位，于 2021 年 8 月 25 日被中国银保监会莆田监管分局处以罚款 200 万元。其云南省分行，因服务收费质价不符等一系列违法违规行为，于 2021 年 9 月 10 日被中国银保监会云南监管局处以罚款 215 万元。因中国建设银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在贸易融资业务 EAST 数据存在偏差、贷款核销业务 EAST 数据存在偏差等十六项违法违规行为以及 2018 年行政处罚问题依然存在，于 2022 年 3 月 21 日被银保监会处以罚款 470 万元。衢州分行因 1、贷款

管理不到位，个人信贷资金被违规挪用；2、对公信贷资金被违规挪用于股市；3、贷款管理不到位，对公信贷资金被违规挪用；4、员工行为管理不到位；5、服务收费质价不符，于 2022 年 4 月 8 日被衢州银保监分局处以罚款 180 万元。宁波市分行因房地产开发贷款支用审核不严、未按工程实际进度发放开发贷款、信贷资金违规流入房地产领域、贷前调查不尽职、贷款资金被挪用、保险代理业务管理不规范、监管统计数据不准确，于 2022 年 4 月 21 日被宁波银保监局处以罚款 260 万元。北京市分行因 1、超过期限或未向人民银行报送账户开立、撤销等资料；2、存在占压财政资金行为；3、对外支付残缺、污损的人民币；4、未准确、完整、及时报送个人信用信息；5、未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额和可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易；6、未按要求对金融消费者投诉进行正确分类；漏报投诉数据；未按要求向金融消费者披露与金融产品和服务有关的重要内容，于 2022 年 6 月 7 日被北京银保监局处以罚款 410 万元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元) |
|----|---------|-------|
| 1  | 存出保证金   | -     |
| 2  | 应收证券清算款 | -     |
| 3  | 应收股利    | -     |
| 4  | 应收利息    | -     |
| 5  | 应收申购款   | -     |
| 6  | 其他应收款   | -     |
| 7  | 待摊费用    | -     |
| 8  | 其他      | -     |
| 9  | 合计      | -     |

注：本报告期末本基金无其他资产。

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

| 项目             | 国联安增鑫纯债债券A       | 国联安增鑫纯债债券C   |
|----------------|------------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 1,048,054,192.50 | 2,285,516.08 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 4,158.57         | 7,482.98     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,890.47         | 37,646.84    |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                | -            |
| 本报告期期末基金份额总额   | 1,048,053,460.60 | 2,255,352.22 |

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

**§8 影响投资者决策的其他重要信息****8.1 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              | 2022年4月1日至2022年6月30日   | 1,048,050,533.01 | -    | -    | 1,048,050,533.01 | 99.78% |
| 产品特有风险  |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (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。 |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (2) 基金净值大幅波动的风险   |                |                        |                  |      |      |                  |        |

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

**(3) 基金规模较小导致的风险**

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

注：由于四舍五入的原因，份额占比可能存在尾差。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准国联安增鑫纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、 《国联安增鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、 《国联安增鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、 《国联安增鑫纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 5、 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 中国证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### 9.3 查阅方式

网址：[www.cpicfunds.com](http://www.cpicfunds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇二二年七月二十一日