

中银证券安源债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46

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	46
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	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.11 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券安源债券型证券投资基金	
基金简称	中银证券安源债券	
基金主代码	005362	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 26 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,016,567,557.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
下属分级基金的交易代码	005362	005363
报告期末下属分级基金的份额总额	1,016,427,479.69 份	140,078.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的稳健回报。
投资策略	本基金通过久期管理策略、类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券投资策略及资产支持证券投资策略，以期获得长期稳定收益。
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，其预期收益和预期风险低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

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	中银国际证券股份有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周宏
	联系电话	021-20328000
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com
客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95319
传真	021-50372474	025-58588155
注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	江苏省南京市中华路 26 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号 中银大厦 39F	江苏省南京市中华路 26 号
邮政编码	200120	210001
法定代表人	宁敏	夏平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银国际证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
本期已实现收益	14,061,866.79	2,302.92
本期利润	12,130,587.72	2,258.02
加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0134
本期加权平均净值利润率	1.12%	1.25%
本期基金份额净值增长率	1.12%	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
期末可供分配利润	73,916,810.19	10,523.82
期末可供分配基金份额利润	0.0727	0.0751
期末基金资产净值	1,090,344,289.88	150,601.91
期末基金份额净值	1.0727	1.0751
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
基金份额累计净值增长率	8.75%	8.95%

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；

2. 所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. 期末可供分配利润是指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

中银证券安源债券 A

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	0.11%	0.01%	-0.24%	0.03%	0.35%	-0.02%
过去三个月	0.56%	0.01%	0.29%	0.04%	0.27%	-0.03%
过去六个月	1.12%	0.01%	0.38%	0.05%	0.74%	-0.04%
过去一年	2.57%	0.01%	1.83%	0.05%	0.74%	-0.04%
过去三年	7.28%	0.05%	3.53%	0.06%	3.75%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.75%	0.05%	4.09%	0.06%	4.66%	-0.01%

中银证券安源债券 C

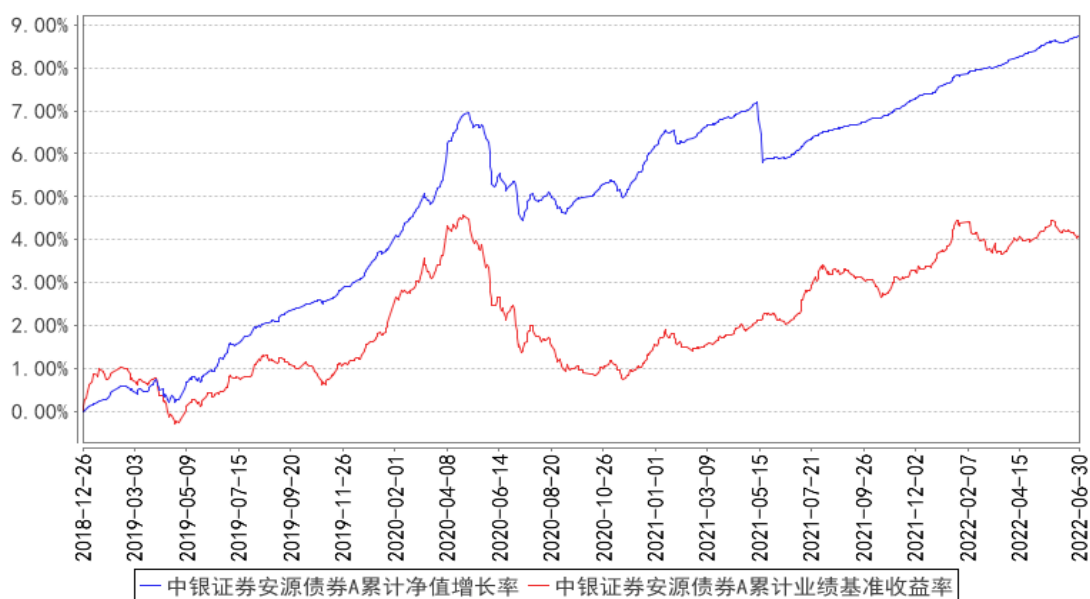
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.10%	0.01%	-0.24%	0.03%	0.34%	-0.02%
过去三个月	0.53%	0.01%	0.29%	0.04%	0.24%	-0.03%

过去六个月	1.33%	0.03%	0.38%	0.05%	0.95%	-0.02%
过去一年	2.73%	0.02%	1.83%	0.05%	0.90%	-0.03%
过去三年	7.52%	0.05%	3.53%	0.06%	3.99%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.95%	0.05%	4.09%	0.06%	4.86%	-0.01%

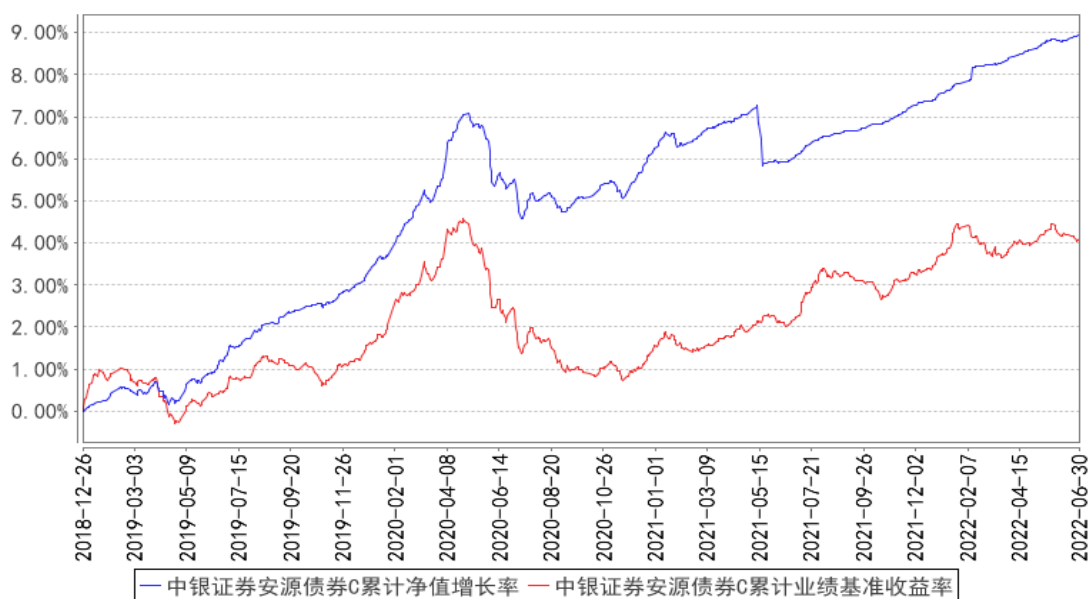
注：业绩比较基准：中债综合全价指数收益率

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

中银证券安源债券A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



中银证券安源债券C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：本基金合同于 2018 年 12 月 26 日生效。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

中银国际证券股份有限公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立,注册资本 27.78 亿元人民币。前十名股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、江西铜业股份有限公司、江苏洋河酒厂股份有限公司、云南省投资控股集团有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、香港中央结算有限公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、华润深国投信托有限公司—华润信托·恒嘉 1 号集合资金信托计划。中银国际证券的经营经营范围包括:证券经纪;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券承销与保荐;证券自营;证券资产管理;证券投资基金代销;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务;为期货公司提供中间介绍业务。截至 2022 年 6 月 30 日,本管理人共管理 40 只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金)、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证

券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安泰债券型证券投资基金、中银证券优选行业龙头混合型证券投资基金、中银证券安汇三年定期开放债券型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券鑫瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券精选行业股票型证券投资基金、中银证券汇福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券均衡成长混合型证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、中银证券盈瑞混合型证券投资基金、中银证券优势制造股票型证券投资基金、中银证券安灏债券型证券投资基金、中银证券安业债券型证券投资基金、中银证券内需增长混合型证券投资基金、中银证券恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金、中银证券远见价值混合型证券投资基金、中银证券成长领航混合型证券投资基金、中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金。

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		
吕文晔	本基金基金经理	2019 年 4 月 25 日	-	6 年	吕文晔，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。2006 年 4 月至 2006 年 12 月任职于汇丰银行，担任个人理财顾问；2007 年 1 月至 2010 年 4 月任职于德勤华永会计师事务所，担任高级审计员；2010 年 5 月至 2012 年 2 月任职于德勤咨询（上海），担任高级顾问；2012 年 3 月至 2015 年 9 月任职于平安资产管理有限公司，担任债券交易员；2015 年 10 月至 2017 年 10 月任职于浙商基金管理有限公司，担任基金经理；2017 年 11 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券安瑞 6 个月

					持有期债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
-	公募基金	0	-	-
	私募资产管理计划	0	-	-
	其他组合	0	-	-
	合计	0	-	-

注：无

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》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定，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，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组

合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2022 年一季度国内生产总值同比增长 4.8%，季调环比增长 1.3%。3 月开始随着疫情冲击不断扩大，经济下行压力显著增加，制造业及非制造业 PMI 指数一度双双回落至 2020 年 3 月以来的最低值。7 月制造业 PMI 超季节性回落至 49，为年内次低仅强于 4 月疫情期间。13 个分项指标全面回落，新订单指数和生产指数分别下降 1.9 和 3.0，均下滑至收缩区域。货币政策方面依然是“稳字当头”，货币市场 DR007 大部分时间运行在央行公开市场 7 天逆回购操作利率之下。总体来看，上半年债券市场收益率呈现探底回升后区间震荡的态势。

本基金报告期内配置上以中短久期利率债、高等级信用债为主，在保证安全应对特殊时点流动性需求的基础上，为投资人实现合理的收益回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券安源债券 A 基金份额净值为 1.0727 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.12%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。截至本报告期末中银证券安源债券 C 基金份额净值为 1.0751 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.33%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

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，国内疫情防控政策或将更为精细化，进一步平衡防疫和经济社会发展的关系。从整个宏观经济周期来看，当前的经济仍处于较为弱势的区间。货币政策总体将维持宽松，经济基本面及货币政策对债券市场将继续形成一定支撑。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任主席，成员由资产管理板块负责人、基金管理部、信评与投资监督部、运营管理总部、内控与法律合规部、风险管理部等部门负责人组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的

估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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，在托管中银证券安源债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人一江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《中银证券安源债券型证券投资基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金托管人一江苏银行股份有限公司未发现中银国际证券股份有限公司在中银证券安源债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的中银证券安源债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中银证券安源债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,644,947.66	3,336,503.70
结算备付金		-	-
存出保证金		-	8,021.67
交易性金融资产	6.4.7.2	1,449,610,240.99	1,437,101,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,449,610,240.99	1,437,101,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	23,770,293.56
资产总计		1,456,255,188.65	1,464,215,818.93
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
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		365,078,200.40	384,998,902.50
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		268,636.54	274,357.36
应付托管费		89,545.51	91,452.48
应付销售服务费		12.54	29.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		106,746.51	90,493.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	217,155.36	348,264.45
负债合计		365,760,296.86	385,803,500.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,016,567,557.78	1,016,615,732.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	73,927,334.01	61,796,585.60
净资产合计		1,090,494,891.79	1,078,412,318.52
负债和净资产总计		1,456,255,188.65	1,464,215,818.93

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额-份，其中中银证券安源债券 A 基金份额总额 1,016,427,479.69 份，基金份额净值 1.0727 元。中银证券安源债券 C 基金份额总额 140,078.09 份，基金份额净值 1.0751 元；

6.2 利润表

会计主体：中银证券安源债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		17,647,380.95	2,612,694.92
1. 利息收入		32,766.49	20,095,098.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,766.49	134,145.26
债券利息收入		-	19,914,859.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	46,093.70
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,545,917.61	-21,292,141.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	19,545,917.61	-21,292,141.45
资产支持证券投资收	6.4.7.16	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,931,323.97	3,809,735.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	20.82	2.49
减：二、营业总支出		5,514,535.21	4,080,342.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,613,660.61	1,588,821.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	537,886.88	529,607.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	93.51	354.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,165,752.26	1,780,760.35
其中：卖出回购金融资产支出		3,165,752.26	1,780,760.35
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		74,403.60	51,367.32
8. 其他费用	6.4.7.23	122,738.35	129,432.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,132,845.74	-1,467,647.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,132,845.74	-1,467,647.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,132,845.74	-1,467,647.66

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银证券安源债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	1,016,615,732.92	-	61,796,585.60	1,078,412,318.52

金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,016,615,732.92	-	61,796,585.60	1,078,412,318.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-48,175.14	-	12,130,748.41	12,082,573.27
(一)、综合收益总额	-	-	12,132,845.74	12,132,845.74
(二)、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)	-48,175.14	-	-2,097.33	-50,272.47
其中:1.基金申购款	329,184.81	-	22,598.81	351,783.62
2.基金赎回款	-377,359.95	-	-24,696.14	-402,056.09
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,016,567,557.78	-	73,927,334.01	1,090,494,891.79
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,017,172,854.52	-	48,078,435.44	1,065,251,289.96
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,017,172,854.52	-	48,078,435.44	1,065,251,289.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-512,724.68	-	-1,495,840.27	-2,008,564.95
(一)、综合收益总额	-	-	-1,467,647.66	-1,467,647.66
(二)、本期基金份额	-512,724.68	-	-28,192.61	-540,917.29

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	8,616.63	-	460.67	9,077.30
2. 基金赎回款	-521,341.31	-	-28,653.28	-549,994.59
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,016,660,129.84	-	46,582,595.17	1,063,242,725.01

注：本基金合同于 2018 年 12 月 26 日生效。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

宁敏

基金管理人负责人

沈锋

主管会计工作负责人

戴景义

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银证券安源债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1703号《关于准予中银证券安源债券型证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安源债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 220,021,593.77 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0213 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券安源债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 220,021,593.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 23,389.87 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)。

根据《中银证券安源债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安源债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;保持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%。业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券安源债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本报告期所采用的其他会计政策、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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

1 会计政策变更的性质、内容和原因

(a) 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

(c) 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

2 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金和应收利息,金额分别为 3,336,503.70 元、8,021.67 元和 23,770,293.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金和其他资产-应收利息,金额分别为 3,337,188.12 元、8,025.27 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,

金额为 1,437,101,000.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,460,870,605.54 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为 384,998,902.50 元、274,357.36 元、91,452.48 元、29.76 元、32,471.43 元和 105,793.02 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 385,104,695.52 元、274,357.36 元、91,452.48 元、29.76 元、32,471.43 元和 0.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《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《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《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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2022年6月30日
活期存款	6,644,947.66
等于：本金	6,640,634.82
加：应计利息	4,312.84
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,644,947.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	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	-	-	-	
	银行间市场	1,437,868,514.16	13,984,240.99	1,449,610,240.99	-2,242,514.16
	合计	1,437,868,514.16	13,984,240.99	1,449,610,240.99	-2,242,514.16
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	1,437,868,514.16	13,984,240.99	1,449,610,240.99	-2,242,514.16
----	------------------	---------------	------------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期内对以摊余成本计量的金融资产按预期信用损失一般模型计算的减值准备很小，故未对其账面价值进行调整。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	23,017.01
其中：交易所市场	-
银行间市场	23,017.01
应付利息	-
预提费用	194,138.35
合计	217,155.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中银证券安源债券 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,016,286,211.66	1,016,286,211.66
本期申购	142,536.54	142,536.54
本期赎回（以“-”号填列）	-1,268.51	-1,268.51
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	1,016,427,479.69	1,016,427,479.69

中银证券安源债券 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	329,521.26	329,521.26
本期申购	186,648.27	186,648.27
本期赎回（以“-”号填列）	-376,091.44	-376,091.44
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	140,078.09	140,078.09

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中银证券安源债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	62,262,508.09	-486,011.29	61,776,496.80
本期利润	14,061,866.79	-1,931,279.07	12,130,587.72
本期基金份额交易产生的变动数	9,922.18	-196.51	9,725.67
其中：基金申购款	10,014.49	-199.12	9,815.37
基金赎回款	-92.31	2.61	-89.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,334,297.06	-2,417,486.87	73,916,810.19

中银证券安源债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	20,241.18	-152.38	20,088.80
本期利润	2,302.92	-44.90	2,258.02
本期基金份额交易产生的变动数	-11,688.35	-134.65	-11,823.00
其中：基金申购款	12,927.16	-143.72	12,783.44
基金赎回款	-24,615.51	9.07	-24,606.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,855.75	-331.93	10,523.82

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	32,731.88
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	-
其他	34.61
合计	32,766.49

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	24,712,425.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,166,508.07
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	19,545,917.61

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,041,083,561.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,020,262,758.07
减：应计利息总额	25,982,161.65
减：交易费用	5,150.00
买卖债券差价收入	-5,166,508.07

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：报告期内本基金无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：报告期内本基金无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：报告期内本基金无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：报告期内本基金无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：报告期内本基金无衍生工具投资。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：报告期内本基金无衍生工具投资。

6.4.7.19 股利收益

注：报告期内本基金未投资股票、基金，无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,931,323.97
股票投资	-
债券投资	-1,931,323.97
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	-1,931,323.97

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	20.82
合计	20.82

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
银行存款	0.00
买入返售金融资产	0.00
债权投资	0.00
其他债权投资	0.00
其他	0.00
-	0.00
合计	0.00

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	122,738.35

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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

无。

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
中银国际证券股份有限公司（“中银证券”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人

注：下述关联方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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
中银证券	-	-	50,470,678.08	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,613,660.61	1,588,821.10
其中：支付销售机构的客户维护费	14,461.41	14,372.96

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	537,886.88	529,607.03

注：支付基金托管人江苏银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C	合计
中国银行	-	92.36	92.36
合计	-	92.36	92.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C	合计
中国银行	-	208.65	208.65

中银证券	-	145.65	145.65
合计	-	354.30	354.30

注：支付基金销售机构的中银证券安源债券型证券投资基金 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银证券，再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$C \text{ 类基金份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
基金合同生效日(2018 年 12 月 26 日)持有的基金份额	29,999,000.00	-
报告期初持有的基金份额	29,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,999,000.00	-
报告期末持有的基金份额	2.9500%	-

占基金总份额比例		
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
基金合同生效日(2018 年 12 月 26 日)持有的基金份额	29,999,000.00	-
报告期初持有的基金份额	29,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,999,000.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.9500%	-

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

注: 于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
江苏银行	6,644,947.66	32,731.88	2,895,272.72	134,129.57

注: 本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注: 报告期内本基金未有利润分配。

6.4.12 期末(2022 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

注: 本基金本期末无因认购新发/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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限股票。

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 2022 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 365,078,200.40 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
101800372	18 南电 MTN001	2022 年 7 月 5 日	103.01	516,000	53,153,160.00
102000173	20 光大集团 MTN001	2022 年 7 月 5 日	101.60	600,000	60,960,000.00
102000286	20 中电投 MTN001	2022 年 7 月 5 日	101.32	1,000,000	101,320,000.00
102001052	20 宝武集团 MTN001	2022 年 7 月 5 日	100.24	1,000,000	100,240,000.00
160404	16 农发 04	2022 年 7 月 5 日	102.33	300,000	30,699,000.00
180408	18 农发 08	2022 年 7 月 5 日	102.49	211,000	21,625,390.00
210211	21 国开 11	2022 年 7 月 5 日	101.96	200,000	20,392,000.00
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 5 日	101.06	27,000	2,728,620.00
合计				3,854,000	391,118,170.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无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

本基金主要投资于债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，而低于混合型及股票型基金。本基金主要投资于债券等具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括管理风险、技术

风险及市场风险。本基金在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层次风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部、信评与投资监督部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行江苏银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的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》设定的标准统计及汇总。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	180,037,000.00	400,711,000.00
合计	180,037,000.00	400,711,000.00

注：未评级部分包括超期限在一年以内(含)的政策性金融债和短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以内(含)的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	196,150,000.00	195,280,000.00
合计	196,150,000.00	195,280,000.00

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	906,994,000.00	779,674,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	152,445,000.00	61,436,000.00
合计	1,059,439,000.00	841,110,000.00

注：未评级部分包括期限大于一年的政策性金融债和中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以上的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有期限在一年以上的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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，本基金的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。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 364,998,732.50 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：不适用。

6.4.13.3.2 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。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，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%。

本基金的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 2022 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的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，本基金的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。

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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	6,640,634.82	-	-	4,312.84	6,644,947.66
交易性金融资产	1,394,420,000.00	-	41,206,000.00	13,984,240.99	1,449,610,240.99
资产总计	1,401,060,634.82	-	41,206,000.00	13,988,553.83	1,456,255,188.65
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	268,636.54	268,636.54
应付托管费	-	-	-	89,545.51	89,545.51
卖出回购金融资产款	364,998,732.50	-	-	79,467.90	365,078,200.40
应付销售服务费	-	-	-	12.54	12.54
应交税费	-	-	-	106,746.51	106,746.51
其他负债	-	-	-	217,155.36	217,155.36
负债总计	364,998,732.50	-	-	761,564.36	365,760,296.86
利率敏感度缺口	1,036,061,902.32	-	41,206,000.00	13,226,989.47	1,090,494,891.79
上年度末 2021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	3,336,503.70	-	-	-	3,336,503.70
存出保证金	8,021.67	-	-	-	8,021.67
交易性金融资产	1,302,768,000.00	113,703,000.00	20,630,000.00	-	1,437,101,000.00
应收利息	-	-	-	23,770,293.56	23,770,293.56
资产总计	1,306,112,525.37	113,703,000.00	20,630,000.00	23,770,293.56	1,464,215,818.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	274,357.36	274,357.36
应付托管费	-	-	-	91,452.48	91,452.48

卖出回购金融资产款	384,998,902.50	-	-	-	384,998,902.50
应付销售服务费	-	-	-	29.76	29.76
应付交易费用	-	-	-	32,471.43	32,471.43
应付利息	-	-	-	105,793.02	105,793.02
应交税费	-	-	-	90,493.86	90,493.86
其他负债	-	-	-	210,000.00	210,000.00
负债总计	384,998,902.50	-	-	804,597.91	385,803,500.41
利率敏感度缺口	921,113,622.87	113,703,000.00	20,630,000.00	22,965,695.65	1,078,412,318.52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-2,781,441.78	-1,903,631.14
	市场利率下降 25 个基点	2,801,603.86	1,914,746.22

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：不适用。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：不适用。

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或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：不适用。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资 (2021 年 12 月 31 日：同)，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 (2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

不适用。

6.4.14 公允价值**6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1,449,610,240.99	1,437,101,000.00
第三层次	-	-
合计	1,449,610,240.99	1,437,101,000.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第

三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,449,610,240.99	99.54
	其中：债券	1,449,610,240.99	99.54
	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	6,644,947.66	0.46
8	其他各项资产	-	-
9	合计	1,456,255,188.65	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

注：报告期末本基金无股票持仓。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期无港股通股票投资。

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

注：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

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

注：本基金本报告期末未买入股票。

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

注：本基金报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未买卖股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	133,769,893.14	12.27
	其中：政策性金融债	133,769,893.14	12.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	150,760,997.26	13.83
6	中期票据	968,413,711.23	88.80
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	196,665,639.36	18.03
9	其他	-	-
10	合计	1,449,610,240.99	132.93

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	101900950	19 华润 MTN005	1,000,000	103,513,183.56	9.49
2	101800372	18 南电 MTN001	1,000,000	103,013,917.81	9.45
3	102000286	20 中电投 MTN001	1,000,000	101,318,246.58	9.29
4	042280089	22 国电 CP001	1,000,000	100,685,682.19	9.23
5	102001052	20 宝武集团 MTN001	1,000,000	100,237,780.82	9.19

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

注：本基金本报告期末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

注：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

注：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

7.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.10.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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

本报告编制日前一年以内，本基金持有的“22 中信银行 CD046”的发行主体中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚（银保监罚决字〔2022〕17 号）；经查，中信银行存在监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送违法违规行为；依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款 290 万元。于 2022 年 6 月 16 日收到中国银保监会丽水监管分局公布的行政处罚信息公开表（丽银保监罚决字〔2022〕11 号）；经查，中信银行存在关联方案管控不审慎、违规发放借名贷款、员工管理缺位，员工与信贷客户发生非正常资金往来；依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，对其罚款人民币 80 万元。

本基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格遵守法律法规和基金合同基础上进行投资决策。

本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券明细。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

份额级别	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 (%)
中银证券安源债券 A	51	19,929,950.58	1,016,285,432.39	99.99	142,047.30	0.01
中银证券安源债券 C	161	870.05	-	-	140,078.09	100.00
合计	212	4,795,129.99	1,016,285,432.39	99.97	282,125.39	0.03

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中银证券安源债券 A	360.75	0.0000
	中银证券安源债券 C	106.60	0.0761
	合计	467.35	0.0000

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

注：本报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券安源债券 A	中银证券安源债券 C
基金合同生效日 (2018 年 12 月 26 日) 基金份额总额	219,998,204.32	23,389.87
本报告期期初基金份	1,016,286,211.66	329,521.26

额总额		
本报告期基金总申购份额	142,536.54	186,648.27
减：本报告期基金总赎回份额	1,268.51	376,091.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,016,427,479.69	140,078.09

§ 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

2022 年 1 月，张静董事和张丽娜监事因工作安排原因提交辞职报告。2022 年 4 月 20 日，林景臻董事长因工作安排原因提交辞职报告，同日召开的董事会选举宁敏董事为公司新董事长。2022 年 6 月，何涛监事分别由监事会提名、股东大会选举产生。6 月 29 日，徐朝莹监事会主席因工作安排原因提交辞职报告，同日召开的监事会选举何涛监事为公司新监事会主席。2022 年 4 月，沈奕先生不再担任中银国际证券股份有限公司投资银行板块管理委员会主席，公司执行委员会委员；2022 年 5 月，中银国际证券股份有限公司聘任葛浩为公司业务总监；聘任赵向雷为公司业务总监，解聘其公司风险总监职务；刘国强兼任公司董事会秘书。

本报告期，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

一、本报告期内，本基金管理人无涉及基金管理业务的诉讼，公司其他主要诉讼、仲裁事项请参见《中银国际证券股份有限公司 2022 年半年度报告》；

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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普华永道中天会计师事务所（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

未有管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中银证券	2	-	-	-	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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 (%)
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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	中银国际证券股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 12 日
2	中银国际证券股份有限公司关于增加创金启富和玄元保险为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 12 日
3	中银国际证券股份有限公司关于增加宁波银行（易管家平台）为旗下基金销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 20 日
4	中银证券安源债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 22 日
5	中银国际证券股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所、公司官网	2022 年 1 月 22 日
6	中银国际证券股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资上交所上市股票的风险提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所、深交所、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 22 日
7	中银证券安源债券型证券投资基金 2021 年年度报告	公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 30 日
8	中银证券安源债券型证券投资基金	公司官网及中国证监会	2022 年 4 月 23 日

	2022 年第 1 季度报告	基金电子披露网站	
9	中银国际证券股份有限公司关于调整旗下基金停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 10 日
10	关于旗下基金参加上海好买基金销售有限公司和泰信财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 18 日
11	关于增加招商银行为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 26 日
12	关于增加招商银行招赢通平台为旗下部分基金销售机构及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 2 日
13	中银国际证券股份有限公司关于增加嘉实财富、利得基金、新浪仓石和同花顺基金为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司官网及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 29 日

注：全部公告均在公司网站披露，部分公告在公司网站及报纸披露。

§ 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	20220101-20220630	986,286,432.39	-	-	986,286,432.39	97.02

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。

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

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 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

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中银国际证券股份有限公司

2022 年 8 月 30 日