

# 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9  |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 11 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 12 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 13 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 15 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 47 |
| 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.....       | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 48 |
| 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.....      | 48 |
| 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.....   | 49 |
| 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.....   | 49 |
| 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.....      | 49 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 49 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 49 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 49 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 51 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 51        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 51        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....               | 51        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | <b>51</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 52        |
| 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 .....  | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 52        |
| 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 .....     | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 54        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....          | <b>54</b> |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                  | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 55        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 55        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 55        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                           |
|------------|---------------------------|
| 基金名称       | 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 国联安增裕一年定开债券发起式            |
| 基金主代码      | 006508                    |
| 交易代码       | 006508                    |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                    |
| 基金合同生效日    | 2018 年 11 月 22 日          |
| 基金管理人      | 国联安基金管理有限公司               |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 8,079,776,745.12 份        |
| 基金合同存续期    | 不定期                       |

注：本基金以开放期和封闭期相结合的方式运作。封闭期指自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）一年的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延。首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。开放期指自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的，开放期时间顺延，直到满足开放期的时间要求。

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。   |
| 投资策略 | <p>封闭期内，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。本基金在封闭期内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。</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p> |

|        |   |
|--------|---|
| 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，属于较低风险较低收益的产品。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                          | 基金托管人                         |
|-------------|------|--------------------------------|-------------------------------|
| 名称          |      | 国联安基金管理有限公司                    | 中国光大银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李华                             | 石立平                           |
|             | 联系电话 | 021-38992888                   | 010-63639180                  |
|             | 电子邮箱 | customer.service@cpicfunds.com | shiliping@cebbank.com         |
| 客户服务电话      |      | 021-38784766/4007000365        | 95595                         |
| 传真          |      | 021-50151582                   | 010-63639132                  |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼  | 北京市西城区太平桥大街25<br>号、甲25号中国光大中心 |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼  | 北京市西城区太平桥大街25号<br>中国光大中心      |
| 邮政编码        |      | 200121                         | 100033                        |
| 法定代表人       |      | 于业明                            | 李晓鹏                           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.cpicfunds.com                |
| 基金中期报告备置地点          | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路<br>1318 号 9 楼 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称          | 办公地址                             |
|--------|-------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国联安基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路<br>1318 号 9 楼 |

## 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 202,476,337.27                       |

|                      |                              |
|----------------------|------------------------------|
| 本期利润                 | 132,612,362.38               |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0164                       |
| 本期加权平均净值利润率          | 1.58%                        |
| 本期基金份额净值增长率          | 1.59%                        |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |
| 期末可供分配利润             | 247,318,878.74               |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0306                       |
| 期末基金资产净值             | 8,465,544,193.77             |
| 期末基金份额净值             | 1.0477                       |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 17.40%                       |

注：1、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。

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

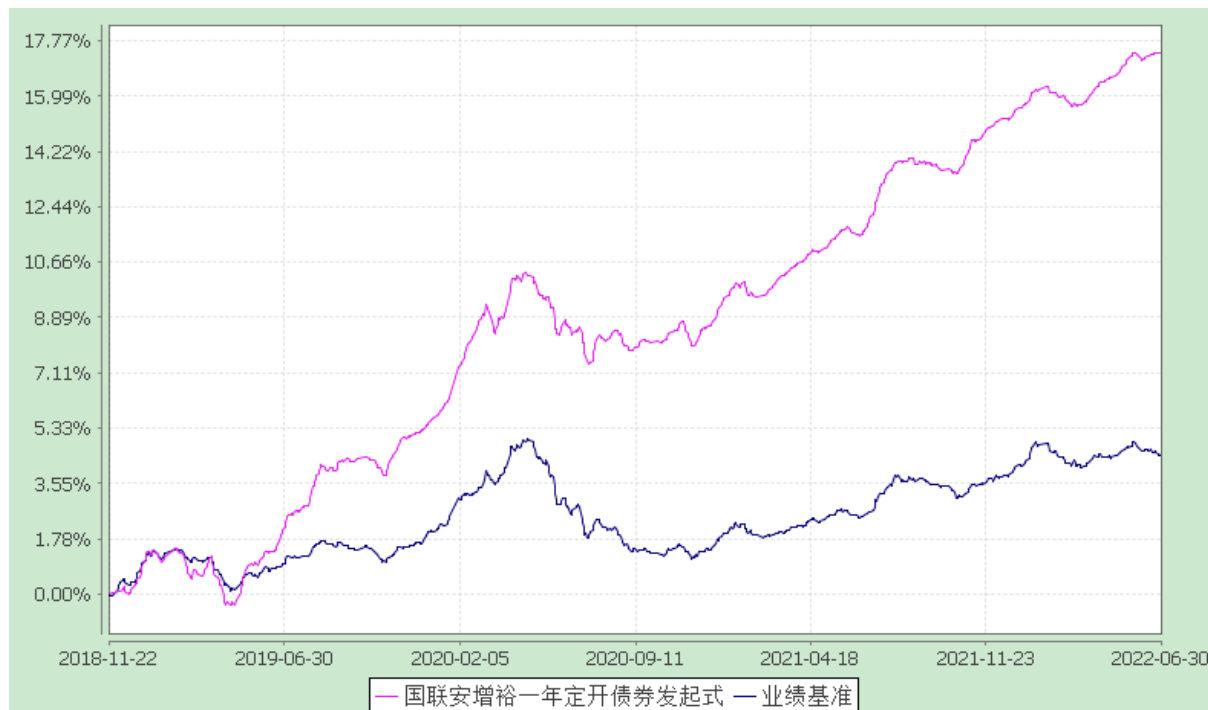
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.05%    | 0.02%       | -0.24%     | 0.03%         | 0.29%  | -0.01% |
| 过去三个月      | 1.29%    | 0.03%       | 0.29%      | 0.04%         | 1.00%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.59%    | 0.04%       | 0.38%      | 0.05%         | 1.21%  | -0.01% |
| 过去一年       | 4.89%    | 0.04%       | 1.83%      | 0.05%         | 3.06%  | -0.01% |
| 过去三年       | 15.01%   | 0.07%       | 3.53%      | 0.06%         | 11.48% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 17.40%   | 0.08%       | 4.51%      | 0.06%         | 12.89% | 0.02%  |

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

#### 3.2.2 自基金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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018 年 11 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1、本基金的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 2018 年 11 月 22 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。



#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限          | 说明   |
|-----|--|-----------------|------|-----------------|--|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |                 |  |
| 李德清 | 本基金基金经理、兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增瑞政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。 | 2020-12-30      | -    | 11 年（自 2011 年起） | 李德清先生，硕士研究生。2011 年 7 月起先后任交通银行股份有限公司投资经理、上海光大证券资产管理有限公司投资经理、太平养老保险股份有限公司投资经理，2020 年 12 月加入国联安基金管理有限公司固定收益部。2020 年 12 月起担任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国联安增瑞政策性金融债纯债债券型证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国联安信心增长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》、《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优

先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统内的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内国内宏观经济基本面延续弱现实、缓修复的趋势，其中 4-5 月份重点城市疫情对经济的修复节奏有所干扰；从主要板块看，基建投资发力托底，制造业投资改善，进出口维持韧性，但消费和地产链条尚在寻底过程中；尽管有海外风险事件发酵，国内通胀压力不显著，居民消费端 CPI 稳定，工业品 PPI 延续缓降；央行货币政策，较少受海外紧缩影响，依然以国内经济为主。在此背景下，上半年二季度增持了中短端高等级信用债、辅以利率债交易、小幅减持性价比减弱的信用债，期限结构上倾向混合哑铃，即中短信用和中长利率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 1.59%，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

展望下半年并综合货币当局的诉求看，弱现实和疫情扰动已较充分定价，此前的存量宽信用政策还在持续发酵中，海外通胀压力对国内的出口韧性形成一定支撑，短期除地产链条外基本上行确定性较强。展望下半年，将紧密跟踪基本面恢复情况和潜在的财政加码可能性，考虑中长趋势和 5 年 LPR 下调的中期背景，将维持混合哑铃操作，适当增加信用债持仓并努力把握下半年资本利得机会。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经

理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国光大银行股份有限公司在国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 4,779,529.89                   | 473,521,540.46                   |
| 结算备付金         |            | 36,038,723.52                  | 3,360,909.09                     |
| 存出保证金         |            | 105,626.64                     | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 8,340,242,781.58               | 6,111,935,200.00                 |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 8,340,242,781.58               | 6,111,935,200.00                 |
| 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    | 91,008,741.21                  | 2,319,818,319.72                 |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | -                              | 8.00                             |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | 77,503,139.59                    |
| 资产总计          |            | 8,472,175,402.84               | 8,986,139,116.86                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 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     |            | -                              | 620,000,000.00                   |
| 应付清算款         |            | 2,976,802.21                   | 30,387,670.77                    |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 2,085,652.30                   | 1,673,341.57                     |
| 应付托管费         |            | 695,217.44                     | 557,780.54                       |
| 应付销售服务费       |            | -                              | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 624,377.06                     | 664,629.95                       |

|             |         |                  |                  |
|-------------|---------|------------------|------------------|
| 应付利润        |         | -                | -                |
| 递延所得税负债     |         | -                | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 249,160.06       | -76,133.36       |
| 负债合计        |         | 6,631,209.07     | 653,207,289.47   |
| <b>净资产：</b> |         |                  |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 8,079,776,745.12 | 8,079,776,741.24 |
| 其他综合收益      |         | -                | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 385,767,448.65   | 253,155,086.15   |
| 净资产合计       |         | 8,465,544,193.77 | 8,332,931,827.39 |
| 负债和净资产总计    |         | 8,472,175,402.84 | 8,986,139,116.86 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0477 元，基金份额总额 8,079,776,745.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>                |          | <b>155,832,981.39</b>                    | <b>147,333,571.74</b>                         |
| 1.利息收入                        |          | 3,887,458.85                             | 117,661,562.62                                |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.9  | 638,245.79                               | 46,808.84                                     |
| 债券利息收入                        |          | -  | 116,042,294.39                                |
| 资产支持证券利息收入                    |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                    |          | 3,249,213.06                             | 1,572,459.39                                  |
| 证券出借利息收入                      |          | -  | -   |
| 其他利息收入                        |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）              |          | 221,809,497.43                           | -   |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.10 | -  | -   |
| 基金投资收益                        |          | -  | -   |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.11 | 221,809,497.43                           | -   |
| 资产支持证券投资收益                    |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益                       |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.12 | -  | -   |
| 股利收益                          | 6.4.7.13 | -  | -   |
| 以摊余成本计量的金融资产<br>终止确认产生的收益（若有） |          | -  | -   |
| 其他投资收益                        |          | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号            | 6.4.7.14 | -69,863,974.89                           | 29,672,009.12                                 |

|                            |          |                       |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 填列)                        |          |                       |                       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                     | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.15 | -                     | -                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 23,220,619.01         | 12,646,358.10         |
| 1. 管理人报酬                   |          | <b>12,486,813.13</b>  | <b>9,155,458.67</b>   |
| 2. 托管费                     |          | 4,162,271.06          | 3,051,819.54          |
| 3. 销售服务费                   |          | -                     | -                     |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                     | -                     |
| 5. 利息支出                    |          | 6,082,651.18          | 8,724.78              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 6,082,651.18          | 8,724.78              |
| 6. 信用减值损失                  |          | -                     | -                     |
| 7. 税金及附加                   |          | 371,104.69            | 308,251.16            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.16 | 117,778.95            | 122,103.95            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>132,612,362.38</b> | <b>134,687,213.64</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>132,612,362.38</b> | <b>134,687,213.64</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                     | -                     |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>132,612,362.38</b> | <b>134,687,213.64</b> |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |                |                  |
|----------------------|---------------------------------------|----------------|----------------|------------------|
|                      | 实收基金                                  | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产（基金净值）      | 8,079,776,741.24                      | -              | 253,155,086.15 | 8,332,931,827.39 |
| 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）      | 8,079,776,741.24                      | -              | 253,155,086.15 | 8,332,931,827.39 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 3.88                                  | -              | 132,612,362.50 | 132,612,366.38   |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -              | 132,612,362.38 | 132,612,362.38   |

|  |                                 |            |                |                  |
|--|---------------------------------|------------|----------------|------------------|
| (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)      | 3.88                            | -          | 0.12           | 4.00             |
| 其中: 1.基金申购款                              | 3.88                            | -          | 0.12           | 4.00             |
| 2.基金赎回款                                  | -                               | -          | -              | -                |
| (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)                          | 8,079,776,745.12                | -          | 385,767,448.65 | 8,465,544,193.77 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |            |                |                  |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益(若有) | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 5,996,580,491.71                | -          | 97,402,582.37  | 6,093,983,074.08 |
| 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)                          | 5,996,580,491.71                | -          | 97,402,582.37  | 6,093,983,074.08 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                               | -          | 134,687,213.64 | 134,687,213.64   |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -          | 134,687,213.64 | 134,687,213.64   |
| (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)      | -                               | -          | -              | -                |
| 其中: 1.基金申购款                              | -                               | -          | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                               | -          | -              | -                |



|  |                  |   |                |                  |
|--|------------------|---|----------------|------------------|
| (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)                          | 5,996,580,491.71 | - | 232,089,796.01 | 6,228,670,287.72 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王琤，主管会计工作负责人：叶培智，会计机构负责人：仲晓峰

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(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]1534 号《关于准予国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 5,009,999,000.00 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1800310 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,009,999,000.00 份，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分不少于 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即本基金以封闭运作和开放运作交替循环的方式运作。本基金以 1 年为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。在每个运作周期结束后进入自由开放期。在开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于 5 个工

作日且不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》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，包括国债、政府机构债券、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款)、同业存单、货币市场工具、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相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；为保护基金份额持有人利益，开放期开始前 1 个月、开放期以及开放期结束后 1 个月，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制；开放期内，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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但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；现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日的财务状况及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间：

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：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、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资和债券投资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。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。

自 2022 年 1 月 1 日起：

##### (a) 金融资产的分类

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、基金投资及债券投资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。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。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。商业模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现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。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间：

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融

负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-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以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

自 2022 年 1 月 1 日起：

#### (a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

#### (b)金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任

何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不

同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差



额确认。本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **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**

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。(a) 新金融工具准则 根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 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 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具

准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响 以摊余成本计量的金融资产 于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 473,521,540.46 元、3,360,909.09 元、2,319,818,319.72 元、77,503,139.59 元和 8.00 元。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 473,573,436.84 元、3,362,572.73 元、2,320,981,093.93 元和 8.00 元。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 6,111,935,200.00 元。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 6,188,222,005.36 元。以摊余成本计量的金融负债 于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用、应交税费、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 620,000,000.00 元、30,387,670.77 元、1,673,341.57 元、557,780.54 元、5,319.72 元、664,629.95 元、-290,753.08 元和 209,300.00 元。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应交税费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 619,709,246.92 元、30,387,670.77 元、1,673,341.57 元、557,780.54 元、664,629.95 元和 214,619.72 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。(b) 修订的《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>》本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）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：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；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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理

人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 6.4.7重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款           | 4,779,529.89      |
| 等于：本金          | 4,768,530.30      |
| 加：应计利息         | 10,999.59         |
| 定期存款           | -                 |
| 等于：本金          | -                 |
| 加：应计利息         | -                 |
| 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         | -                 |
| 合计             | 4,779,529.89      |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>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               |                  | 45,562,162.13  |                  |
|               | 市场                | 2,785,631,142.82 |                | 2,875,056,122.13 |
|               | 银行间               |                  | 90,718,659.45  |                  |
|               | 市场                | 5,338,253,977.16 |                | 5,465,186,659.45 |
|               | 合计                | 8,123,885,119.98 | 136,280,821.58 | 8,340,242,781.58 |
| 资产支持证券        | -                 | -                | -              | -                |
| 基金            | -                 | -                | -              | -                |

|    |                  |                |                  |               |
|----|------------------|----------------|------------------|---------------|
| 其他 | -                | -              | -                | -             |
| 合计 | 8,123,885,119.98 | 136,280,821.58 | 8,340,242,781.58 | 80,076,840.02 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 91,008,741.21          | -         |
| 银行间市场 | -                      | -         |
| 合计    | 91,008,741.21          | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>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      | 20,681.11              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 20,681.11              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提审计费       | 39,671.58              |
| 预提信息披露费     | 179,507.37             |
| 预提上清所账户查询费  | 300.00                 |
| 预提账户维护费     | 9,000.00               |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 249,160.06 |
|----|------------|

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 8,079,776,741.24                      | 8,079,776,741.24 |
| 本期申购          | 3.88                                  | 3.88             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 本期末           | 8,079,776,745.12                      | 8,079,776,745.12 |

注：1、根据《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》、《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》及《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告》的相关规定基金第三次办理申购与赎回业务的开放期为 2021 年 12 月 27 日（含该日）至 2021 年 12 月 31 日（含该日）。本基金自开放期结束之日次日（包括该日）起进入下一个封闭期。

2、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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           | 44,842,541.45  | 208,312,544.70 | 253,155,086.15 |
| 本期利润           | 202,476,337.27 | -69,863,974.89 | 132,612,362.38 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 0.02           | 0.10           | 0.12           |
| 其中：基金申购款       | 0.02           | 0.10           | 0.12           |
| 基金赎回款          | -              | -              | -              |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 247,318,878.74 | 138,448,569.91 | 385,767,448.65 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 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 | 325,178.77                            |



|    |            |
|----|------------|
| 其他 | 428.18     |
| 合计 | 638,245.79 |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本报告期内本基金无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 149,106,671.32             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 72,702,826.11              |
| 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                           | 221,809,497.43             |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>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   | 4,900,002,367.10           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,761,747,758.40           |
| 减：应计利息总额               | 65,502,513.38              |
| 减：交易费用                 | 49,269.21                  |
| 买卖债券差价收入               | 72,702,826.11              |

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -69,863,974.89             |
| ——股票投资                     | -                          |
| ——债券投资                     | -69,863,974.89             |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -69,863,974.89             |

#### 6.4.7.15 其他收入

本报告期内本基金无其他收入。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 39,671.58                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 账户维护费   | 18,600.00                  |
| 合计      | 117,778.95                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                     | 与本基金的关系             |
|---------------------------|---------------------|
| 中国太平洋人寿保险股份有限公司（“太保人寿”）   | 基金管理人的最终控制人控制的机构    |
| 国联安基金管理有限公司               | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）    | 基金托管人               |
| 太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）    | 基金管理人的股东            |
| 安联集团                      | 基金管理人的股东            |
| 中国太平洋保险（集团）股份有限公司（“太保集团”） | 基金管理人的最终控制人         |

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

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

#### 6.4.10.1.2 权证交易

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

#### 6.4.10.1.3 债券交易

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

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均没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<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 12,486,813.13                  | 9,155,458.67                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 354,512.35                     | -                                   |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,162,271.06                   | 3,051,819.54                        |

注：支付基金托管人光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提，基金托管费每日计提，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%÷当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未与关联方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**

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|---------------------------------|
| 期初持有的基金份额  | 0.00                       | 10,000,000.00                   |
| 期间申购/买入总份额 | -                          | -                               |
| 期间因拆分变动份额  | -                          | -                               |
| 减：期间赎回/卖出总 | -                          | -                               |

|                   |       |               |
|-------------------|-------|---------------|
| 份额                |       |               |
| 期末持有的基金份额         | 0.00  | 10,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 0.17%         |

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

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称           | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2021 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 |
| 中国太平洋人寿保险股份有限公司 | 6,225,275,230.76    | 77.05%           | 6,225,275,230.76      | 77.05%           |
| 中国光大银行股份有限公司    | 1,456,592,542.24    | 18.03%           | 1,456,592,542.24      | 18.03%           |

#### 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              |           |
|--------------|----------------------|------------|----------------------|-----------|
|              | 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 |           |
|              | 期末余额                 | 当期利息收入     | 期末余额                 | 当期利息收入    |
| 中国光大银行股份有限公司 | 4,779,529.89         | 312,638.84 | 524,610.65           | 11,841.60 |

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计算。本基金通过“光大银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2022 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 36,038,723.52 元。（2021 年 6 月 30 日：人民币 788,888.89 元）

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内，本基金均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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为 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金没有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 | 上年末 |
|--------|-----|-----|
|        |     |     |

|        | 2022年6月30日     | 2021年12月31日 |
|--------|----------------|-------------|
| A-1    | -              | -           |
| A-1 以下 | -              | -           |
| 未评级    | 212,613,781.36 | -           |
| 合计     | 212,613,781.36 | -           |

注：本报告期末，本基金未评级的短期信用债券为超短期融资债券及一般短期融资券；上年度末，本基金未持有短期信用债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | -                 | -                  |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 492,008,485.76    | -                  |
| 合计     | 492,008,485.76    | -                  |

注：上年度末，本基金未持有短期同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 6,436,922,411.44  | 6,111,935,200.00   |
| AAA 以下 | 40,551,596.71     | -                  |
| 未评级    | 142,556,539.19    | -                  |
| 合计     | 6,620,030,547.34  | 6,111,935,200.00   |

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流



动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放期随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的 10%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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 6.4.12。

于开放期内，本基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私

募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年6<br>月30日 | 1个月以<br>内     | 1-3<br>个月     | 3个月<br>-1年       | 1-5年             | 5年以上             | 不计息  | 合计               |
|-----------------------|---------------|---------------|------------------|------------------|------------------|------|------------------|
| 资产                    |               |               |                  |                  |                  |      |                  |
| 其他资产                  | -             | -             | -                | -                | -                | -    | 0.00             |
| 银行存款                  | 4,779,529.89  | -             | -                | -                | -                | -    | 4,779,529.89     |
| 结算备付金                 | 36,038,723.52 | -             | -                | -                | -                | -    | 36,038,723.52    |
| 存出保证金                 | 105,626.64    | -             | -                | -                | -                | -    | 105,626.64       |
| 交易性金融资产               | 50,613,852.05 | 10,146,013.70 | 1,605,806,290.12 | 5,395,526,796.18 | 1,278,149,829.53 | -    | 8,340,242,781.58 |
| 买入返售金融资产              | 91,008,741.21 | -             | -                | -                | -                | -    | 91,008,741.21    |
| 应收证券清算款               | -             | -             | -                | -                | -                | 0.00 | 0.00             |
| 应收股利                  | -             | -             | -                | -                | -                | -    | 0.00             |
| 应收申购款                 | -             | -             | -                | -                | -                | 0.00 | 0.00             |
| 资产总计                  | 182,546,      | 10,146,0      | 1,605,806,       | 5,395,526,       | 1,278,14         | 0.00 |                  |

|                       |                |               |                  |                  |                  |               |                  |
|-----------------------|----------------|---------------|------------------|------------------|------------------|---------------|------------------|
|                       | 473.31         | 13.70         | 290.12           | 796.18           | 9,829.53         |               | 8,472,175,402.84 |
| 负债                    |                |               |                  |                  |                  |               |                  |
| 其他负债                  | -              | -             | -                | -                | -                | 249,160.06    | 249,160.06       |
| 卖出回购金融资产款             | 0.00           | -             | -                | -                | -                | -             | 0.00             |
| 应付证券清算款               | -              | -             | -                | -                | -                | 2,976,802.21  | 2,976,802.21     |
| 应付赎回款                 | -              | -             | -                | -                | -                | 0.00          | 0.00             |
| 应付管理人报酬               | -              | -             | -                | -                | -                | 2,085,652.30  | 2,085,652.30     |
| 应付托管费                 | -              | -             | -                | -                | -                | 695,217.44    | 695,217.44       |
| 应付销售服务费               | -              | -             | -                | -                | -                | 0.00          | 0.00             |
| 应交税费                  | -              | -             | -                | -                | -                | 624,377.06    | 624,377.06       |
| 应付利息                  | -              | -             | -                | -                | -                | 0.00          | 0.00             |
| 负债总计                  | 0.00           | -             | -                | -                | -                | 6,631,209.07  | 6,631,209.07     |
| 利率敏感度缺口               | 182,546,473.31 | 10,146,013.70 | 1,605,806,290.12 | 5,395,526,796.18 | 1,278,149,829.53 | -6,631,209.07 | 8,465,544,193.77 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月        | 3 个月-1 年         | 1-5 年            | 5 年以上            | 不计息           | 合计               |
| 资产                    |                |               |                  |                  |                  |               |                  |
| 银行存款                  | 473,521,540.46 | -             | -                | -                | -                | -             | 473,521,540.46   |
| 结算备付金                 | 3,360,909.09   | -             | -                | -                | -                | -             | 3,360,909.09     |
| 存出保证金                 | 0.00           | -             | -                | -                | -                | -             | 0.00             |
| 交易性金融资产               | 0.00           | -             | -                | 4,311,447,400.00 | 1,800,487,800.00 | -             | 6,111,935,200.00 |
| 买入返售                  | 2,319,81       | -             | -                | -                | -                | -             | 2,319,818,319.   |

|                   |                      |   |   |                      |                      |                   |                      |
|-------------------|----------------------|---|---|----------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| 金融资产              | 8,319.72             |   |   |                      |                      |                   | 72                   |
| 应收证券<br>清算款       | -                    | - | - | -                    | -                    | 0.00              | 0.00                 |
| 其他资产              | -                    | - | - | -                    | -                    | 77,503,13<br>9.59 | 77,503,139.59        |
| 应收股利              | -                    | - | - | -                    | -                    | -                 | 0.00                 |
| 应收申购<br>款         | -                    | - | - | -                    | -                    | 8.00              | 8.00                 |
| 资产总计              | 2,796,70<br>0,769.27 | - | - | 4,311,447,<br>400.00 | 1,800,48<br>7,800.00 | 77,503,14<br>7.59 | 8,986,139,116.8<br>6 |
| 负债                |                      |   |   |                      |                      |                   |                      |
| 其他负债              | -                    | - | - | -                    | -                    | 214,619.7<br>2    | 214,619.72           |
| 卖出回购<br>金融资产<br>款 | 620,000,<br>000.00   | - | - | -                    | -                    | -                 | 620,000,000.00       |
| 应付证券<br>清算款       | -                    | - | - | -                    | -                    | 30,387,67<br>0.77 | 30,387,670.77        |
| 应付赎回<br>款         | -                    | - | - | -                    | -                    | 0.00              | 0.00                 |
| 应付管理<br>人报酬       | -                    | - | - | -                    | -                    | 1,673,341.<br>57  | 1,673,341.57         |
| 应付托管<br>费         | -                    | - | - | -                    | -                    | 557,780.5<br>4    | 557,780.54           |
| 应付销售<br>服务费       | -                    | - | - | -                    | -                    | 0.00              | 0.00                 |
| 应交税费              | -                    | - | - | -                    | -                    | 664,629.9<br>5    | 664,629.95           |
| 应付利息              | -                    | - | - | -                    | -                    | -290,753.0<br>8   | -290,753.08          |
| 负债总计              | 620,000,<br>000.00   | - | - | -                    | -                    | 33,207,28<br>9.47 | 653,207,289.47       |
| 利率敏感<br>度缺口       | 2,176,70<br>0,769.27 | - | - | 4,311,447,<br>400.00 | 1,800,48<br>7,800.00 | 44,295,85<br>8.12 | 8,332,931,827.<br>39 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 |                |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的 |

|  |               | 影响金额（单位：人民币元）          |                          |
|--|---------------|------------------------|--------------------------|
|  |               | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 增加 43,961,669.21       | 增加 65,543,606.57         |
|  | 市场利率上升 25 个基点 | 减少 43,595,695.41       | 减少 65,543,606.57         |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，同时本基金不参与可转换债券和可交换债券投资。于本期末无重大其他市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告期末及上年度末，本基金均无其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.00%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 8,340,242,781.58       | 6,111,935,200.00         |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 8,340,242,781.58       | 6,111,935,200.00         |

##### 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可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

##### 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 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            | 8,340,242,781.58 | 98.44  |
|   | 其中：债券             | 8,340,242,781.58 | 98.44  |
|   | 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          | 91,008,741.21    | 1.07   |
|   | 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      | 40,818,253.41    | 0.48   |
| 8 | 其他各项资产            | 105,626.64       | 0.00   |
| 9 | 合计                | 8,472,175,402.84 | 100.00 |

注：1、本报告期末本基金未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票；

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本报告期末本基金未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本报告期内本基金未买入股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本报告期内本基金未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

### 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      | 1,519,423,637.80 | 17.95        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,015,589,967.12 | 12.00        |
| 4  | 企业债券      | 3,317,007,135.30 | 39.18        |
| 5  | 企业短期融资券   | 212,613,781.36   | 2.51         |
| 6  | 中期票据      | 2,799,189,741.36 | 33.07        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 492,008,485.76   | 5.81         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 8,340,242,781.58 | 98.52        |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称             | 数量(张)     | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 155009    | 18 远海 05         | 3,620,000 | 401,986,718.34 | 4.75         |
| 2  | 091800009 | 18 东方债 01BC(品种二) | 2,900,000 | 324,794,136.44 | 3.84         |
| 3  | 210202    | 21 国开 02         | 3,000,000 | 307,261,808.22 | 3.63         |
| 4  | 210303    | 21 进出 03         | 2,500,000 | 255,160,616.44 | 3.01         |
| 5  | 112204016 | 22 中国银行 CD016    | 2,000,000 | 196,844,969.32 | 2.33         |



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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除中国银行外，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。

22 中国银行 CD016（112204016）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、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。

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。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 105,626.64 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 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    | 105,626.64 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票，不存在前十名股票流通受限情况。

## 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<br>基金份额 | 持有人结构            |            |       |            |
|----------|---------------|------------------|------------|-------|------------|
|          |               | 机构投资者            |            | 个人投资者 |            |
|          |               | 持有份额             | 占总份额<br>比例 | 持有份额  | 占总份额<br>比例 |
| 222      | 36,395,390.74 | 8,079,776,745.12 | 100.00%    | 0.00  | 0.00%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 11 月 22 日）基金份额总额 | 5,009,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 8,079,776,741.24 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 3.88             |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 8,079,776,745.12 |

注：根据《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》、《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》及《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告》的相关规定，本基金第三次办理申购与赎回业务的开放期为 2021 年 12 月 27 日（含该日）至 2021 年 12 月 31 日（含该日），本基金自开放期结束之日次日（包括该日）起进入下一个封闭期。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。
- 2、本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无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 |    |
| 东方证券股份有限公司 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券股份有限公司 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易             |              | 回购交易              |              | 权证交易 |              |
|------------|------------------|--------------|-------------------|--------------|------|--------------|
|            | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券股份有限公司 | 1,832,428,951.78 | 98.39%       | 44,751,300,000.00 | 99.93%       | -    | -            |
| 中信证券股份     | 30,006,785.7     | 1.61%        | 29,559,00         | 0.07%        | -    | -            |

|      |   |      |  |  |  |
|------|---|------|--|--|--|
| 有限公司 | 6 | 0.00 |  |  |  |
|------|---|------|--|--|--|

## 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  | 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告      | 规定网站      | 2022-01-24 |
| 2  | 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告         | 规定报刊      | 2022-01-24 |
| 3  | 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年年度报告          | 规定网站      | 2022-03-31 |
| 4  | 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告             | 规定报刊      | 2022-03-31 |
| 5  | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行为代销机构的公告             | 规定报刊、规定网站 | 2022-04-12 |
| 6  | 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2022 年 1 季度报告       | 规定网站      | 2022-04-22 |
| 7  | 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告          | 规定报刊      | 2022-04-22 |
| 8  | 国联安基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 规定报刊、规定网站 | 2022-04-28 |
| 9  | 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书更新（2022 年第 1 号） | 规定网站      | 2022-05-18 |
| 10 | 国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金产品资料概要更新             | 规定网站      | 2022-05-18 |
| 11 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行费率优惠活动的公告            | 规定报刊、规定网站 | 2022-05-20 |

## 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              | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | 6,225,275,230.76 | 0.00 | 0.00 | 6,225,275,230.76 | 77.05% |

**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。

**12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

**12.2 存放地点**

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

**12.3 查阅方式**

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

国联安基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日