

国寿安保安享纯债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：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 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..... | 6 |
| 3.3 其他指标..... | 7 |
| § 4 管理人报告 | 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合规守信情况的说明..... | 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..... | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 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..... | 10 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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..... | 11 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 14 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 39 |
| 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..... | 40 |

| | |
|--|-----------|
| 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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 40 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 40 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 41 |
| § 10 重大事件揭示..... | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 42 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 42 |
| 10.8 其他重大事件..... | 43 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |
| § 12 备查文件目录..... | 45 |
| 12.1 备查文件目录..... | 45 |
| 12.2 存放地点..... | 45 |
| 12.3 查阅方式..... | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 国寿安保安享纯债债券 |
| 基金主代码 | 003514 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 10 月 19 日 |
| 基金管理人 | 国寿安保基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 南京银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 500,477,224.76 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略、回购套利策略投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中债综合（全价）指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于证券投资基金中的中低预期收益/风险品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|----------------------------------|-----------------------|
| 名称 | 国寿安保基金管理有限公司 | 南京银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 申梦玉 |
| | 联系电话 | 010-50850744 |
| | 电子邮箱 | public@gsfunds.com.cn |
| 客户服务电话 | 4009-258-258 | 95302 |
| 传真 | 010-50850776 | 025-86776189 |
| 注册地址 | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号 | 江苏省南京市玄武区中山路 288 号 |
| 办公地址 | 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层 | 江苏省南京市玄武区中山路 288 号 |
| 邮政编码 | 100033 | 210008 |
| 法定代表人 | 王军辉 | 胡升荣 |

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 | http://www.gsfunds.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国寿安保基金管理有限公司 | 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 8,754,984.42 |
| 本期利润 | 11,354,131.75 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0227 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.15% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.17% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 22,603,684.03 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0452 |
| 期末基金资产净值 | 533,879,860.34 |
| 期末基金份额净值 | 1.0667 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 21.26% |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

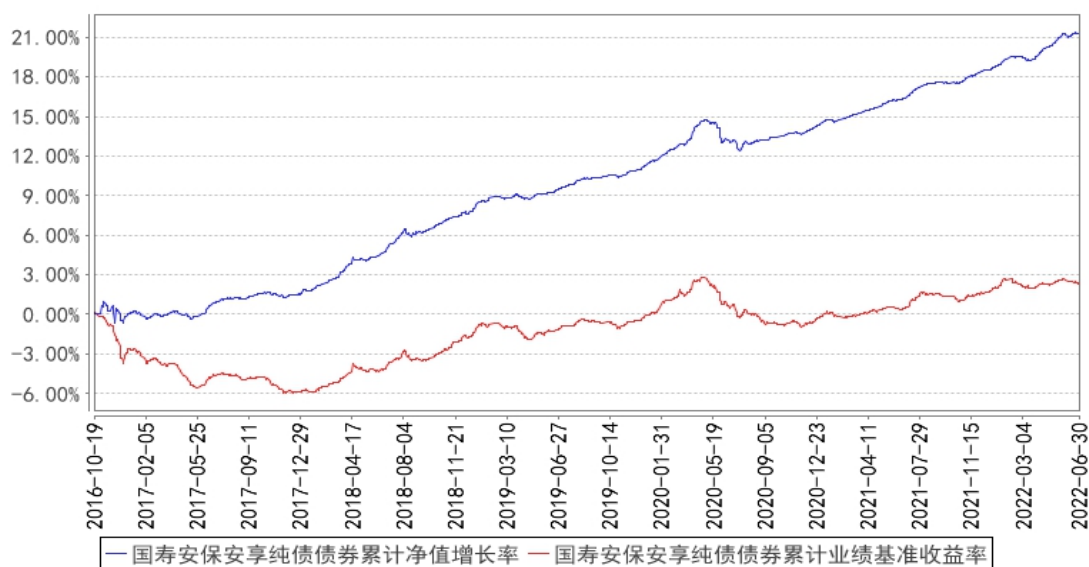
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 0.02% | 0.04% | -0.24% | 0.03% | 0.26% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.47% | 0.03% | 0.29% | 0.04% | 1.18% | -0.01% |
| 过去六个月 | 2.17% | 0.04% | 0.38% | 0.05% | 1.79% | -0.01% |
| 过去一年 | 4.15% | 0.03% | 1.83% | 0.05% | 2.32% | -0.02% |
| 过去三年 | 10.70% | 0.04% | 3.53% | 0.06% | 7.17% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.26% | 0.06% | 2.37% | 0.07% | 18.89% | -0.01% |

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

国寿安保安享纯债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2016 年 10 月 19 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2016 年 10 月 19 日至 2022 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 93 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 3219.57 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2387.69 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|------------------|-----------------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 葛佳 | 本基金的基金经理 | 2022 年 6 月 29 日 | - | 8 年 | 曾任泰康资产管理有限责任公司国际投资部投资助理，2015 年 6 月加入国寿安保基金管理有限公司先后任研究员、基金经理助理、基金经理。2022 年 6 月起任国寿安保安享纯债债券型证券投资基金、国寿安保安康纯债债券型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保稳隆混合型证券投资基金基金经理。 |
| 李一鸣 | 基金经理 | 2016 年 10 月 19 日 | 2022 年 6 月 29 日 | 14 年 | 曾任中银国际定息收益部研究员、中信证券固定收益部研究员，2013 年 11 月加入国寿安保基金，历任基金经理助理、基金经理。现任国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保安康纯债债券型证券投资基金、国寿安保稳嘉混合型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、国寿安保稳寿混合型证券投资基金、国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金、国寿安保稳隆混合型证券投资基金和国寿安保安诚纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从

行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年随着海外疫苗接种速度加快以及新冠死亡率的下降，全球经济加速向常态化回归；与此同时，地缘冲突带动全球商品价格上涨，美欧通胀水平快速上升至历史高位，美联储和欧央行均加快货币紧缩以对抗通胀，这一举措也加深了市场对后续可能出现衰退风险的担忧，美债收益率大幅波动。年初国内经济动能有短暂恢复，金融支持力度加强，地产需求端政策有一定松动，地方政府债发行进度较快，稳增长预期增强；但受疫情负面扰动的影 响，二季度初基本面整体承压，生产、消费受冲击较为明显。5 月份之后，随着疫情逐步得到控制、管控措施渐进放开，复工复产带动经济进入修复阶段，稳增长方面专项债加速发行推动基建发力，留抵退税政策支持制造业投资企稳，复工消化积压订单带动出口增速回升，消费端出台减免汽车购置税等政策。整体来看，二季度中后期经济开始呈现边际修复态势，不过地产各项微观指标仍然偏弱、预期尚不稳定，失业率偏高，社融结构不佳，信用内生动能不足，经济需

求仍面临压力。

货币政策方面，在经济仍需稳增长的背景下，央行延续中性偏宽松的政策基调，回购利率中枢较一季度有明显下降，流动性水平宽松。

2022 年上半年债券市场整体呈震荡行情，期间三次阶段性上涨行情分别由年初超预期降息、4 月初疫情超预期爆发以及 5 月底疫后经济修复力度不及预期所带动。由于资金面持续超预期宽松，机构配置需求旺盛，短端收益率下行幅度较大。配置压力下信用利差再度被压缩至历史低位。

投资运作方面，本基金在报告期内调整持仓结构，保持组合杠杆及久期水平，以中短久期、中等评级信用债为主要持仓品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0667 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.17%，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 2022 年下半年，中国经济预计将延续边际弱修复的势头，但内生增长动能或仍偏弱。欧美央行货币政策持续紧缩导致欧美经济放缓，外需回落对中国出口的负面影响可能会逐渐显现。内需层面，房地产信心短期难以显著修复，且考虑到地产销售状况仍然不佳，下半年地产投资仍将承压。在疫情局部反复、实体需求偏弱的背景下，基建仍然是稳定经济的中坚力量。今年以来基建投资增速出现反弹，但微观层面尚未形成实物工作量。后续随着专项债资金的下放以及项目推进，预计基建投资增速将维持在高位。总体而言，当前私人部门的经济活力仍显不足，经济主体的预期有所转弱，宏观经济继续复苏的弹性和持续性存疑。

债券市场方面，资金利率在目前的水平下难以进一步下行，未来大概率逐渐回归常态，限制了收益率下行的空间。但考虑到房地产市场疲弱及外需缓慢回落，债券市场显著走熊的概率也相对有限，大概率维持区间震荡行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人以及各相关投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程

序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，南京银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国寿安保安享纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、利润分配以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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，由国寿安保基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保安享纯债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 | 1,862,826.62 | 2,128,187.05 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 574,509,024.69 | 545,080,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 574,509,024.69 | 545,080,000.00 |
| 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 | - | 8,329,634.40 |
| 资产总计 | | 576,371,851.31 | 555,537,821.45 |
| 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 | | 42,094,016.11 | 33,051,710.42 |
| 应付清算款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 131,644.34 | 132,779.47 |
| 应付托管费 | | 43,881.46 | 44,259.82 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 49,657.17 | 42,196.63 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 172,791.89 | 218,561.99 |
| 负债合计 | | 42,491,990.97 | 33,489,508.33 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 500,477,224.76 | 500,027,904.88 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 33,402,635.58 | 22,020,408.24 |
| 净资产合计 | | 533,879,860.34 | 522,048,313.12 |
| 负债和净资产总计 | | 576,371,851.31 | 555,537,821.45 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0667 元，基金份额总额 500,477,224.76 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保安享纯债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 | | 13,037,548.16 | 15,818,904.53 |
| 1. 利息收入 | | 2,817.92 | 14,705,271.51 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 2,817.92 | 4,684.62 |
| 债券利息收入 | | - | 14,700,586.89 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 10,435,023.26 | 2,036,111.35 |
| 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 | 10,435,023.26 | 2,036,111.35 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |

| | | | |
|-------------------------------|------------|----------------------|----------------------|
| 收益 | | | |
| 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 | 2,599,147.33 | -922,478.33 |
| 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 | 559.65 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 1,683,416.41 | 2,935,381.49 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 785,370.70 | 1,163,649.68 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 261,790.26 | 387,883.24 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 489,558.67 | 1,228,047.83 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 489,558.67 | 1,228,047.83 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 33,877.23 | 36,056.19 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 112,819.55 | 119,744.55 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 11,354,131.75 | 12,883,523.04 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 11,354,131.75 | 12,883,523.04 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 11,354,131.75 | 12,883,523.04 |

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：国寿安保安享纯债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 | 500,027,904.88 | - | 22,020,408.24 | 522,048,313.12 |

| | | | | |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 产（基金净值） | | | | |
| 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） | 500,027,904.88 | - | 22,020,408.24 | 522,048,313.12 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 449,319.88 | - | 11,382,227.34 | 11,831,547.22 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 11,354,131.75 | 11,354,131.75 |
| （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） | 449,319.88 | - | 28,095.59 | 477,415.47 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,179,268.45 | - | 75,535.17 | 1,254,803.62 |
| 2. 基金赎回款 | -729,948.57 | - | -47,439.58 | -777,388.15 |
| （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） | 500,477,224.76 | - | 33,402,635.58 | 533,879,860.34 |
| 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） | 997,341,014.10 | - | 13,818,842.28 | 1,011,159,856.38 |
| 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） | 997,341,014.10 | - | 13,818,842.28 | 1,011,159,856.38 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -497,313,486.59 | - | -1,706,746.41 | -499,020,233.00 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 12,883,523.04 | 12,883,523.04 |
| （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） | -497,313,486.59 | - | -7,608,917.33 | -504,922,403.92 |
| 其中：1. 基金申购款 | 0.94 | - | 0.01 | 0.95 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|---------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款 | -497,313,487.53 | - | -7,608,917.34 | -504,922,404.87 |
| (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) | - | - | -6,981,352.12 | -6,981,352.12 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 500,027,527.51 | - | 12,112,095.87 | 512,139,623.38 |

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>左季庆</u> | <u>王文英</u> | <u>韩占锋</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保安享纯债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[2016]2279号《关于准予国寿安保安享纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由国寿安保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《国寿安保安享纯债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,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200,043,485.38元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第61090605_A06号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金合同》于2016年10月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,043,485.46份基金份额,其中认购资金利息折合0.08

份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”),基金托管人为南京银行股份有限公司(以下简称“南京银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保安享纯债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,包括国家债券、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、证券公司短期公司债券、同业存单、债券回购、可分离交易可转债的纯债部分、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),以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: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国寿安保于 2022 年 8 月 30 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》、《国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中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本报告期末的财务状况以及本报告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

除金融资产和金融负债的分类、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终

止确认、收入/（损失）的确认和计量外，本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

6.4.5.1.1 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商业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商业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。

(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债券投资和资产支持证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。

6.4.5.1.2 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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

6.4.5.1.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

债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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下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。

债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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下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。

6.4.5.1.4 会计政策变更对财务报表的影响

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财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有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。

(i) 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和应收利息，金额分别为 2,128,187.05 元和 8,329,634.40 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和其他资产-应收利息，金额分别为 2,128,361.16 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 545,080,000.00 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 553,409,460.29 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、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 33,051,710.42 元、132,779.47 元、44,259.82 元、16,354.42 元、12,207.57 元和 190,000.00 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、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 33,063,917.99 元、132,779.47 元、44,259.82 元、16,354.42 元、0.00 元和 190,000.00 元。

i) 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”、“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，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，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”、“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。

(b) 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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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，包括买卖债券的差价收入，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 | 1,862,826.62 |
| 等于：本金 | 1,862,744.86 |
| 加：应计利息 | 81.76 |
| 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 | 1,862,826.62 |

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 | 20,000,000.00 | 302,991.78 | 20,486,991.78 | 184,000.00 |
| | 银行间市场 | 541,384,462.68 | 6,250,032.91 | 554,022,032.91 | 6,387,537.32 |
| | 合计 | 561,384,462.68 | 6,553,024.69 | 574,509,024.69 | 6,571,537.32 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 561,384,462.68 | 6,553,024.69 | 574,509,024.69 | 6,571,537.32 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金于本报告期内未进行债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期内未进行其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期内未进行其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金于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 | 8,572.34 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 8,572.34 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 164,219.55 |
| 合计 | 172,791.89 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 500,027,904.88 | 500,027,904.88 |
| 本期申购 | 1,179,268.45 | 1,179,268.45 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -729,948.57 | -729,948.57 |
| 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 | 500,477,224.76 | 500,477,224.76 |

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期间无其他综合收益。

6.4.7.12 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 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期期初 | 13,831,726.60 | 8,188,681.64 | 22,020,408.24 |
| 本期利润 | 8,754,984.42 | 2,599,147.33 | 11,354,131.75 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 16,973.01 | 11,122.58 | 28,095.59 |
| 其中：基金申购款 | 48,666.63 | 26,868.54 | 75,535.17 |
| 基金赎回款 | -31,693.62 | -15,745.96 | -47,439.58 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|---------------|---------------|---------------|
| 本期末 | 22,603,684.03 | 10,798,951.55 | 33,402,635.58 |
|-----|---------------|---------------|---------------|

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 | 2,817.92 |
| 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 | - |
| 合计 | 2,817.92 |

6.4.7.14 股票投资收益

本基金于本报告期无股票投资产生的收益/损失。

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 | 10,185,260.74 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入 | 249,762.52 |
| 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 | 10,435,023.26 |

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 | 304,023,110.70 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 299,495,221.32 |
| 减：应计利息总额 | 4,273,626.86 |
| 减：交易费用 | 4,500.00 |
| 买卖债券差价收入 | 249,762.52 |

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资产生的收益/损失。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.19 股利收益

本基金于本报告期间无股利收益。

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 | 2,599,147.33 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 2,599,147.33 |
| 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 | 2,599,147.33 |

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 | 559.65 |
| 合计 | 559.65 |

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期间无信用减值损失。

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 | 34,712.18 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|------------|
| 上清所账户维护费 | 9,000.00 |
| 中债登账户维护费 | 9,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 112,819.55 |

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的管理人于 2022 年 8 月 5 日宣告 2022 年度第一次分红，向截至 2022 年 8 月 8 日止在本基金注册登记人国寿安保登记在册的全日持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.4700 元。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|------------------------|
| 国寿安保 | 基金管理人、注册登记机构、直销机构 |
| 南京银行 | 基金托管人 |
| 中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”） | 基金管理人的股东 |
| 安保资本投资有限公司（简称“安保资本”） | 基金管理人的股东 |
| 中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”） | 基金管理人的最终控制人 |
| 中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”） | 与基金管理人同受集团公司控制的公司、销售机构 |
| 国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”） | 基金管理人的子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生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

本基金于本报告期末发生通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期末发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 785,370.70 | 1,163,649.68 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 123.68 | - |

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金合同生效日管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提；计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金管理费年费率

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 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 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 261,790.26 | 387,883.24 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金合同生效日托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提；计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金托管费年费率

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

本基金本报告期无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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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。

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

本报告期末基金管理人未有运用自有资金投资本基金的情况。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

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 |
| 南京银行 | 1,862,826.62 | 2,817.92 | 1,557,850.99 | 4,592.59 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

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

本基金本报告期末持有因新发/增发而于期末持有的流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 42,094,016.11 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 |
|-----------|----------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 102103138 | 21 镜湖开发 MTN003 | 2022 年 7 月 5 日 | 103.03 | 43,000 | 4,430,413.93 |
| 102280502 | 22 芜湖宜居 MTN001 | 2022 年 7 月 5 日 | 102.08 | 400,000 | 40,830,689.32 |
| 合计 | | | | 443,000 | 45,261,103.25 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险管理委员会为核心的，由董事会风险管理委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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內。

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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额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 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相关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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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。

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 | 1,862,826.62 | - | - | - | 1,862,826.62 |
| 交易性金融资产 | 30,087,887.67 | 504,428,534.28 | 39,992,602.74 | - | 574,509,024.69 |
| 资产总计 | 31,950,714.29 | 504,428,534.28 | 39,992,602.74 | - | 576,371,851.31 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 131,644.34 | 131,644.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 43,881.46 | 43,881.46 |
| 卖出回购金融资产款 | 42,094,016.11 | - | - | - | 42,094,016.11 |
| 应交税费 | - | - | - | 49,657.17 | 49,657.17 |
| 其他负债 | - | - | - | 172,791.89 | 172,791.89 |
| 负债总计 | 42,094,016.11 | - | - | 397,974.86 | 42,491,990.97 |
| 利率敏感度缺口 | -10,143,301.82 | 504,428,534.28 | 39,992,602.74 | -397,974.86 | 533,879,860.34 |
| 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 | 2,128,187.05 | - | - | - | 2,128,187.05 |
| 交易性金融资产 | 168,990,000.00 | 376,090,000.00 | - | - | 545,080,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 8,329,634.40 | 8,329,634.40 |
| 资产总计 | 171,118,187.05 | 376,090,000.00 | - | 8,329,634.40 | 555,537,821.45 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 132,779.47 | 132,779.47 |
| 应付托管费 | - | - | - | 44,259.82 | 44,259.82 |
| 卖出回购金融资产款 | 33,051,710.42 | - | - | - | 33,051,710.42 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 16,354.42 | 16,354.42 |
| 应付利息 | - | - | - | 12,207.57 | 12,207.57 |
| 应交税费 | - | - | - | 42,196.63 | 42,196.63 |
| 其他负债 | - | - | - | 190,000.00 | 190,000.00 |
| 负债总计 | 33,051,710.42 | - | - | 437,797.91 | 33,489,508.33 |
| 利率敏感度缺口 | 138,066,476.63 | 376,090,000.00 | - | 7,891,836.49 | 522,048,313.12 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|-----------------------------------|----------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况： | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基准点，其他变量不变； | |
| | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | |
| | 相关风险变量的变 | 对资产负债表日基金资产净值的 |

| | 动 | 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 | +25个基准点 | -3,622,493.80 | -2,151,316.65 |
| | -25个基准点 | 3,666,963.17 | 2,168,316.34 |

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或银行间同业市场交易的固定收益品种，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

于2022年6月30日，本基金无重大价格风险(2021年12月31日：同)。

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)。

6.4.14 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 | 574,509,024.69 | 545,080,000.00 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 574,509,024.69 | 545,080,000.00 |

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、债券和基金的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或金融负债（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、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 | 574,509,024.69 | 99.68 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：债券 | 574,509,024.69 | 99.68 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,862,826.62 | 0.32 |
| 8 | 其他各项资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 576,371,851.31 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期末未卖出股票。

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 | 70,080,490.41 | 13.13 |
| | 其中：政策性金融债 | 70,080,490.41 | 13.13 |
| 4 | 企业债券 | 20,486,991.78 | 3.84 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 483,941,542.50 | 90.65 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 574,509,024.69 | 107.61 |

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 | 102100772 | 21 盐城交投 MTN001 | 400,000 | 41,515,675.62 | 7.78 |
| 2 | 102280502 | 22 芜湖宜居 MTN001 | 400,000 | 40,830,689.32 | 7.65 |
| 3 | 102280609 | 22 武侯资本 MTN001 | 400,000 | 40,810,726.58 | 7.64 |
| 4 | 220210 | 22 国开 10 | 400,000 | 39,992,602.74 | 7.49 |
| 5 | 101900233 | 19 淮安国投 MTN001 | 300,000 | 31,677,915.62 | 5.93 |

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

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

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

| 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 (%) |
| 221 | 2,264,602.83 | 500,000,000.00 | 99.90 | 477,224.76 | 0.10 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 4,199.64 | 0.00 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2016 年 10 月 19 日) 基金份额总额 | 200,043,485.46 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 500,027,904.88 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,179,268.45 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 729,948.57 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |

| | |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 500,477,224.76 |
|-------------|----------------|

注：报告期内基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本基金本报告期内，本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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2021 年 10 月 20 日起，改聘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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对其采取责令改正的监管措施，公司高度重视，已制定并实施相关整改措施。

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 (%) | |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；

(6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|----------------------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 2 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资 | 上证报、证监会指定网 | 2022 年 3 月 31 日 |

| | | | |
|---|---------------------------------------|------------------|-----------------|
| | 基金 2021 年年度报告 | 站及公司网站 | |
| 3 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 4 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 6 月 2 日 |
| 5 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 1 号) | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 6 月 2 日 |
| 6 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 6 月 29 日 |
| 7 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 2 号) | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 6 月 29 日 |
| 8 | 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金变更基金经理的公告 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2022 年 6 月 29 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20220101~20220630 | 500,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 500,000,000.00 | 99.90 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保安享纯债债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保安享纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保安享纯债债券型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

- 12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.gsfoods.com.cn
- 12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日