

国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：恒丰银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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 | 5 |
| 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 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 8 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 8 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 9 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 10 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 10 |
| § 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） | 11 |
| 6.1 资产负债表 | 11 |
| 6.2 利润表 | 12 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 14 |
| 6.4 报表附注 | 15 |
| § 7 投资组合报告 | 32 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 32 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 32 |
| 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 | 32 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 32 |

| | |
|--|-----------|
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 33 |
| 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..... | 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..... | 33 |
| 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..... | 33 |
| 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..... | 33 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 33 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 34 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 35 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 35 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 35 |
| 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..... | 35 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 35 |
| § 10 重大事件揭示 | 35 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 35 |
| 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..... | 36 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 36 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 36 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 36 |
| 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 | 36 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 36 |
| 10.8 其他重大事件 | 37 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 38 |
| 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 | 38 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 38 |
| § 12 备查文件目录 | 38 |
| 12.1 备查文件目录 | 38 |
| 12.2 存放地点 | 38 |
| 12.3 查阅方式 | 39 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 国寿安保安恒金融债债券 |
| 基金主代码 | 012451 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 6 月 25 日 |
| 基金管理人 | 国寿安保基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 恒丰银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,079,028,844.19 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、信用债投资策略、分散投资策略、回购套利策略等投资管理手段，对债券市场及债券收益率曲线的变化进行预测，相机而动、积极调整。 |
| 业绩比较基准 | 中债-金融债券总全价（总值）指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | 恒丰银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 韩占锋 |
| | 联系电话 | 010-50850744 |
| | 电子邮箱 | public@gsfunds.com.cn |
| 客户服务电话 | 4009-258-258 | 95395 |
| 传真 | 010-50850776 | 021-63890708 |
| 注册地址 | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号 | 济南市历下区泺源大街 8 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 | 上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦 16 楼 |
| 邮政编码 | 100033 | 200023 |
| 法定代表人 | 王军辉 | 陈颖 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------|------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
|----------------|------|

| | |
|---------------------|---------------------------|
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | 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(2023年1月1日-2023年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 14,489,932.93 |
| 本期利润 | 19,353,367.14 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0174 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.70% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.76% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 28,212,691.25 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0261 |
| 期末基金资产净值 | 1,107,241,535.44 |
| 期末基金份额净值 | 1.0261 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.56% |

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。

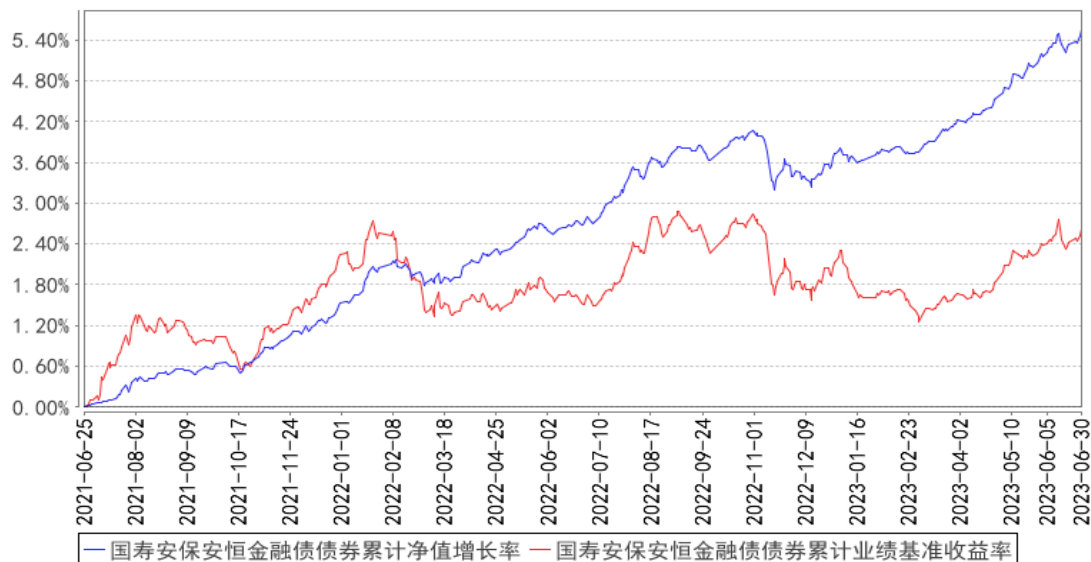
3.2 基金净值表现

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 | 0.37% | 0.06% | 0.27% | 0.07% | 0.10% | -0.01% |
| 过去三个月 | 1.27% | 0.04% | 0.93% | 0.06% | 0.34% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.76% | 0.04% | 0.46% | 0.06% | 1.30% | -0.02% |
| 过去一年 | 2.71% | 0.05% | 1.00% | 0.08% | 1.71% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.56% | 0.05% | 2.61% | 0.08% | 2.95% | -0.03% |

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

国寿安保安恒金融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 2021 年 06 月 25 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 2021 年 06 月 25 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 94 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 3226.04 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2507.58 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 | | |
| 李一鸣 | 本基金的基金经理 | 2021年6月25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、国寿安保安诚纯债一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保安和纯债债券型证券投资基金和国寿安保安吉纯债半年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年突如其来的银行风险事件成为全球市场的焦点,缓解了美联储步步紧逼的鹰派加息压力,海外各央行同时面对“抗通胀、稳增长、防风险”三大主线挑战。国内方面,年初疫情高峰过后,各项经济指标持续呈底部回升态势,修复方向初步得到数据验证。但进入二季度之后,宏观数据呈现需求边际放缓,生产指标分化的特征,打破了市场对经济复苏持续性的预期。当前宏观经济已经从四五月份的下滑阶段转向底部企稳阶段,但居民和企业资产负债表还没有明显修复,需求不足是经济面临的重大问题,内生增长动能依旧偏弱;虽然消费存在一些结构性亮点,但房地产市场在长周期内的下行压力对经济形成较为明显的拖累。

货币政策方面,央行保持稳健精准的货币政策,发挥货币政策工具的总量和结构双重功能,加大逆周期调节力度。央行上半年陆续降低了存款准备金率和公开市场政策利率,流动性水平整体维持宽松。

2023 年上半年债券市场整体呈现震荡走强格局。受流动性收紧及市场交易经济疫后复苏及稳增长政策持续发力的核心逻辑影响,年初债券市场一度走弱,收益率曲线平坦化形变。二季度之后,市场对强刺激政策引发的资金担忧情绪有所减弱,且随着基本面数据整体不及预期,货币政策出现放松信号,叠加海外金融风险发酵提升避险情绪及机构欠配压力较大,债市整体再度显著走强。

投资运作方面,本基金在报告期内以中短期利率债为主要配置品种,对中长期利率品种进行波段操作。

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 1.0261 元;本报告期基金份额净值增长率为 1.76%,业绩比较基准收益率为 0.46%。

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 2023 年下半年,由于美国经济韧性持续超出预期,就业市场表现良好,在工资粘性作用下,通胀下行仍将慢于预期。同时,地产明显回温将强化货币紧缩的必要性。国内来看,当前需求恢复动能仍不足,非制造业虽然韧性较强但下行压力依然存在。随着经济复苏进入常态化和稳增长政策出台,内需不足的问题有些许改善,但难以支撑经济进一步复苏。目前居民和企业杠杆提升空间及意愿不大,若中央政府杠

杆率提升也偏慢，可能并不能有效缓解居民和企业债务杠杆提升缓慢所造成的“资产荒”格局，优质资产依然具有稀缺性。与此同时，相对于宽信用及财政政策出台，宽货币的确定性是更强的，下半年降息降准及引导银行负债利率下行将是大概率事件。

展望后市，7 月份政治局会议表态略超市场预期，未来一段时间随着政策组合拳的陆续推出，地产政策、化债方案的落地，政府债券供给放量，权益市场风险偏好的回升等因素都可能对债市形成阶段性扰动。但在基本面核心矛盾尚未解决的宏观背景下，流动性保持合理宽裕，叠加机构配置动力持续存在，下半年债券市场虽有震荡，但仍可积极关注配置及交易机会。

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、研究部负责人以及各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

本基金于 2023 年 3 月 29 日登记权益并除息，2023 年 3 月 30 日每份份额发放红利 0.0250 元人民币。

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,132,050.49 | 1,972,788.21 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 24,192.62 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,441,995,024.79 | 1,428,275,928.77 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,441,995,024.79 | 1,428,275,928.77 |
| 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 | - | - |
| 资产总计 | | 1,443,151,267.90 | 1,430,248,716.98 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022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 | | 335,419,645.17 | 114,032,678.13 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 272,411.41 | 348,622.64 |
| 应付托管费 | | 90,803.81 | 116,207.54 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 126,872.07 | 239,810.37 |
| 负债合计 | | 335,909,732.46 | 114,737,318.68 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 1,079,028,844.19 | 1,273,172,534.02 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 28,212,691.25 | 42,338,864.28 |
| 净资产合计 | | 1,107,241,535.44 | 1,315,511,398.30 |
| 负债和净资产总计 | | 1,443,151,267.90 | 1,430,248,716.98 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0261 元，基金份额总额 1,079,028,844.19 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 24,016,835.95 | 49,603,824.43 |
| 1. 利息收入 | | 4,793.16 | 16,840.28 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 4,793.16 | 13,086.46 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 3,753.82 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 19,148,608.58 | 54,679,758.16 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 19,148,608.58 | 54,679,758.16 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 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 | 4,863,434.21 | -5,092,774.01 |
| 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 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 4,663,468.81 | 9,152,549.00 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,703,387.07 | 4,822,074.67 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 567,795.65 | 1,607,358.20 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,271,357.20 | 2,590,806.10 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,271,357.20 | 2,590,806.10 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 120,928.89 | 132,310.03 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 19,353,367.14 | 40,451,275.43 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 19,353,367.14 | 40,451,275.43 |

| | | | |
|---------------|--|---------------|---------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 19,353,367.14 | 40,451,275.43 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|--------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 1,273,172,534.02 | - | 42,338,864.28 | 1,315,511,398.30 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期末初净资产（基金净值） | 1,273,172,534.02 | - | 42,338,864.28 | 1,315,511,398.30 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -194,143,689.83 | - | -14,126,173.03 | -208,269,862.86 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 19,353,367.14 | 19,353,367.14 |
| （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） | -194,143,689.83 | - | -6,503,826.05 | -200,647,515.88 |
| 其中：1. 基金申购款 | 7,087.31 | - | 232.67 | 7,319.98 |
| 2. 基金赎回款 | -194,150,777.14 | - | -6,504,058.72 | -200,654,835.86 |
| （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） | - | - | -26,975,714.12 | -26,975,714.12 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 1,079,028,844.19 | - | 28,212,691.25 | 1,107,241,535.44 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 4,188,016,462.73 | - | 64,321,224.83 | 4,252,337,687.56 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|-------------------|---|----------------|-------------------|
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期初净资产(基金净值) | 4,188,016,462.73 | - | 64,321,224.83 | 4,252,337,687.56 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -2,027,507,696.71 | - | -13,054,545.42 | -2,040,562,242.13 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 40,451,275.43 | 40,451,275.43 |
| (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) | -2,027,507,696.71 | - | -43,914,862.30 | -2,071,422,559.01 |
| 其中：1. 基金申购款 | 312,769,356.20 | - | 7,228,864.22 | 319,998,220.42 |
| 2. 基金赎回款 | -2,340,277,052.91 | - | -51,143,726.52 | -2,391,420,779.43 |
| (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) | - | - | -9,590,958.55 | -9,590,958.55 |
| (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) | 2,160,508,766.02 | - | 51,266,679.41 | 2,211,775,445.43 |

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：

鄂华

王文英

于晓树

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

国寿安保安恒金融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[2021]1625号《关于准予国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金注册的批复》注册,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《国寿安保安恒金融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 5,800,018,031.82 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0650 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 06 月 25 日正

式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,800,018,036.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 4.54 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”)，基金托管人为恒丰银行股份有限公司(以下简称“恒丰银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保安恒金融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，包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券))、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具等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，也不投资于可转换债券、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%，其中，投资于金融债的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金所界定的金融债券是指由银行和其他金融机构发行的债券，包括政策性银行、商业银行、证券公司、保险公司、财务公司及其他金融机构发行的债券。本基金投资的信用债券，经国内信用评级机构认定的主体评级须在 AA+(含 AA+)以上。主体评级为 AAA 的信用债投资占信用债资产的比例为 50%-100%；主体评级为 AA+的信用债投资占信用债资产的比例为 0-50%。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级(具体评级机构名单以基金管理人确认为准)。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券，基金管理人需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定，以基金管理人的判断结果为准。本基金的业绩比较基准为：中债-金融债券总全价(总值)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 2023 年 08 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《国寿安保安恒金融

债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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净资产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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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[2012]85号《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《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》、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

(5) 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 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,132,050.49 |
| 等于：本金 | 1,131,823.19 |
| 加：应计利息 | 227.30 |
| 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 | 1,132,050.49 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | |
| | 银行间市场 | 1,416,273,712.09 | 18,540,024.79 | 1,441,995,024.79 | 7,181,287.91 |
| | 合计 | 1,416,273,712.09 | 18,540,024.79 | 1,441,995,024.79 | 7,181,287.91 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,416,273,712.09 | 18,540,024.79 | 1,441,995,024.79 | 7,181,287.91 | |

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

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023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 | 27,693.12 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 27,693.12 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 99,178.95 |
| 合计 | 126,872.07 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,273,172,534.02 | 1,273,172,534.02 |
| 本期申购 | 7,087.31 | 7,087.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -194,150,777.14 | -194,150,777.14 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,079,028,844.19 | 1,079,028,844.19 |

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

本基金于本报告期末无其他综合收益。

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 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 52,945,780.71 | -10,606,916.43 | 42,338,864.28 |
| 本期利润 | 14,489,932.93 | 4,863,434.21 | 19,353,367.14 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -8,487,507.61 | 1,983,681.56 | -6,503,826.05 |
| 其中：基金申购款 | 312.15 | -79.48 | 232.67 |
| 基金赎回款 | -8,487,819.76 | 1,983,761.04 | -6,504,058.72 |
| 本期已分配利润 | -26,975,714.12 | - | -26,975,714.12 |
| 本期末 | 31,972,491.91 | -3,759,800.66 | 28,212,691.25 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 4,704.40 |
| 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 | 88.76 |
| 合计 | 4,793.16 |

6.4.7.14 股票投资收益

本基金于本报告期无股票投资收益。

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 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 19,143,771.79 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,836.79 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 19,148,608.58 |

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 |
|------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 881,711,359.34 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 871,366,224.21 |
| 减：应计利息总额 | 10,328,023.34 |

| | |
|----------|-----------|
| 减：交易费用 | 12,275.00 |
| 买卖债券差价收入 | 4,836.79 |

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收益。

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

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 4,863,434.21 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 4,863,434.21 |
| 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 | 4,863,434.21 |

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | - |
| 银行费用 | 3,149.94 |
| 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 | 120,928.89 |

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

本基金的基金管理人于 2023 年 6 月 30 日宣告 2023 年度第二次分红，向截至 2023 年 7 月 3 日止在本基金注册登记人国寿安保登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 |
|------------------------|------------------------|
| 国寿安保 | 基金管理人、注册登记机构、直销机构 |
| 恒丰银行 | 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,703,387.07 | 4,822,074.67 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 16,808.80 | - |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金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：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 567,795.65 | 1,607,358.20 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金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：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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 2023年6月30日 | | 上年度末 2022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（%） |
| 恒丰银行 | 289,999,000.00 | 26.88 | 289,999,000.00 | 22.78 |
| 中国人寿 | - | - | 194,136,090.08 | 15.25 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 |
| 恒丰银行 | 1,132,050.49 | 4,704.40 | 1,879,041.55 | 13,086.46 |

注：本基金的银行存款由基金托管人恒丰银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每10 份基金 份额分 红数 | 现金形式 发放总额 | 再投资 形式发 放总额 | 本期利润分配 合计 | 备 注 |
|----|-----------|-----|----|-------------------------|--------------|-------------------|--------------|--------|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------|---|-----------------|--------|---------------|--------|---------------|---|
| 1 | 2023 年 3 月 29 日 | - | 2023 年 3 月 29 日 | 0.2500 | 26,975,460.44 | 253.68 | 26,975,714.12 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.2500 | 26,975,460.44 | 253.68 | 26,975,714.12 | - |

6.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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 2023 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 335,419,645.17 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 |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 200203 | 20 国开 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.99 | 1,424,000 | 146,660,725.04 |
| 230201 | 23 国开 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.97 | 1,000,000 | 100,970,136.61 |
| 230301 | 23 进出 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.95 | 1,000,000 | 100,951,311.48 |
| 230404 | 23 农发 04 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.61 | 106,000 | 10,770,150.27 |
| 合计 | | | | 3,530,000 | 359,352,323.40 |

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市场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内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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约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(净资产)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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 2023 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 | 1,132,050.49 | - | - | - | 1,132,050.49 |
| 存出保证金 | 24,192.62 | - | - | - | 24,192.62 |
| 交易性金融资产 | 251,920,710.39 | 1,006,001,046.70 | 184,073,267.70 | - | 1,441,995,024.79 |
| 资产总计 | 253,076,953.50 | 1,006,001,046.70 | 184,073,267.70 | - | 1,443,151,267.90 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 272,411.41 | 272,411.41 |
| 应付托管费 | - | - | - | 90,803.81 | 90,803.81 |
| 卖出回购金融资产款 | 335,419,645.17 | - | - | - | 335,419,645.17 |
| 其他负债 | - | - | - | 126,872.07 | 126,872.07 |
| 负债总计 | 335,419,645.17 | - | - | 490,087.29 | 335,909,732.46 |
| 利率敏感度缺口 | -82,342,691.67 | 1,006,001,046.70 | 184,073,267.70 | -490,087.29 | 1,107,241,535.44 |
| 上年度末 2022 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 | 1,972,788.21 | - | - | - | 1,972,788.21 |
| 交易性金融资产 | 423,435,545.21 | 861,270,602.74 | 143,569,780.82 | - | 1,428,275,928.77 |
| 资产总计 | 425,408,333.42 | 861,270,602.74 | 143,569,780.82 | - | 1,430,248,716.98 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 348,622.64 | 348,622.64 |
| 应付托管费 | - | - | - | 116,207.54 | 116,207.54 |
| 卖出回购金融资产款 | 114,032,678.13 | - | - | - | 114,032,678.13 |
| 其他负债 | - | - | - | 239,810.37 | 239,810.37 |
| 负债总计 | 114,032,678.13 | - | - | 704,640.55 | 114,737,318.68 |
| 利率敏感度缺口 | 311,375,655.29 | 861,270,602.74 | 143,569,780.82 | -704,640.55 | 1,315,511,398.30 |

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 | 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。 | |
| 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（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|----------|----------------------|------------------------|
| +25 个基准点 | -8,545,826.69 | -6,796,784.40 |
| -25 个基准点 | 8,662,093.90 | 6,886,099.00 |

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

基金管理人通过对宏观经济和资本市场的深入分析，采用主动的投资管理策略，把握不同时期各金融市场的收益水平，在约定的投资比例下，合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产，在严格控制下行风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本基金均无重大价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2022 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（2022 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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 1,441,995,024.79 | 1,428,275,928.77 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 1,441,995,024.79 | 1,428,275,928.77 |

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 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,441,995,024.79 | 99.92 |
| | 其中：债券 | 1,441,995,024.79 | 99.92 |
| | 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 | 1,132,050.49 | 0.08 |
| 8 | 其他各项资产 | 24,192.62 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 1,443,151,267.90 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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 | 91,311,325.64 | 8.25 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,350,683,699.15 | 121.99 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,350,683,699.15 | 121.99 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,441,995,024.79 | 130.23 |

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 | 200203 | 20 国开 03 | 2,400,000 | 247,180,997.26 | 22.32 |
| 2 | 092218005 | 22 农发清发 05 | 2,200,000 | 223,027,079.45 | 20.14 |
| 3 | 230201 | 23 国开 01 | 1,000,000 | 100,970,136.61 | 9.12 |
| 4 | 230301 | 23 进出 01 | 1,000,000 | 100,951,311.48 | 9.12 |
| 5 | 200212 | 20 国开 12 | 800,000 | 84,216,832.88 | 7.61 |

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、中国进出口银行、中国农业发展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；中国进出口银行、中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚；中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚；中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局的处罚；中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到公安局的处罚。中国进出口银行本期内被银行间市场交易商协会立案调查。

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投资股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 24,192.62 |
| 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 | 24,192.62 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未投资股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------------|----------------|-----------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 202 | 5,341,726.95 | 1,079,012,606.23 | 100.00 | 16,237.96 | 0.00 |

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 | 14,850.02 | 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 (2021 年 6 月 25 日) 基金份额总额 | 5,800,018,036.36 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,273,172,534.02 |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,087.31 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 194,150,777.14 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,079,028,844.19 |

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 4 日发布公告，鄂华先生自 2023 年 1 月 3 日起任公司总经理、董事，左季庆先生于 2023 年 1 月 3 日离任公司总经理、董事；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，韩占锋先生自 2023 年 1 月 5 日起任公司督察长，申梦玉先生于 2023 年 1 月 5 日离任公司督察长；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，董瑞倩女士于 2023 年 1 月 5 日离任公司固定收益投资总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 财通证券 | 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(%) |
| 财通证券 | 89,772,926.00 | 100.00 | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-------------------|------------|
| 1 | 关于国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 证券时报、证监会规定网站及公司网站 | 2023年3月27日 |
| 2 | 国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金分红公告 | 证券时报、证监会规定网站及公司网站 | 2023年3月28日 |
| 3 | 关于国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 证券时报、证监会规定网站及公司网站 | 2023年6月29日 |
| 4 | 国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金分红公告 | 证券时报、证监会规定网站及公司网站 | 2023年6月30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 | 20230101~20230630 | 497,724,160.65 | 0.00 | 0.00 | 497,724,160.65 | 46.13 |
| | 2 | 20230101~20230630 | 289,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 289,999,000.00 | 26.88 |
| | 3 | 20230101~20230630 | 291,289,445.58 | 0.00 | 0.00 | 291,289,445.58 | 27.00 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

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恒金融债债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保安恒金融债债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保安恒金融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恒金融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

2023 年 8 月 31 日