

国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式
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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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 | 9 |
| 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 | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 10 |
| 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 | 10 |
| 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 | 10 |
| § 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 | 13 |
| 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 | 33 |
| 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 | 33 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 33 |
| 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..... | 34 |
| 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..... | 34 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 34 |
| 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 |
| 8.4 | 发起式基金发起资金持有份额情况 | 36 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 36 |
| § 10 | 重大事件揭示 | 36 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 36 |
| 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 | 37 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 37 |
| 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 | 37 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 37 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 38 |
| § 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 | 39 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 39 |
| 12.2 | 存放地点 | 39 |
| 12.3 | 查阅方式 | 39 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------------|
| 基金名称 | 国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 国寿安保泰瑞纯债一年定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 008503 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 26 日 |
| 基金管理人 | 国寿安保基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,128,586,134.23 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 | 本基金在投资策略上兼顾投资原则以及定期开放基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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 | 中债综合（全价）指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | 4009-258-258 | 95568 |
| 传真 | 010-50850776 | 010-57093382 |
| 注册地址 | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号 | 北京市西城区复兴门内大街 2 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 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 邮政编码 | 100033 | 100031 |
| 法定代表人 | 王军辉 | 高迎欣 |

2.4 信息披露方式

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

| | |
|---------------------|---------------------------|
| 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 | 76,045,842.90 |
| 本期利润 | 148,953,880.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0361 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.57% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.63% |
| 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 | 112,490,855.84 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0272 |
| 期末基金资产净值 | 4,243,926,630.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.0279 |
| 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 | 16.37% |

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

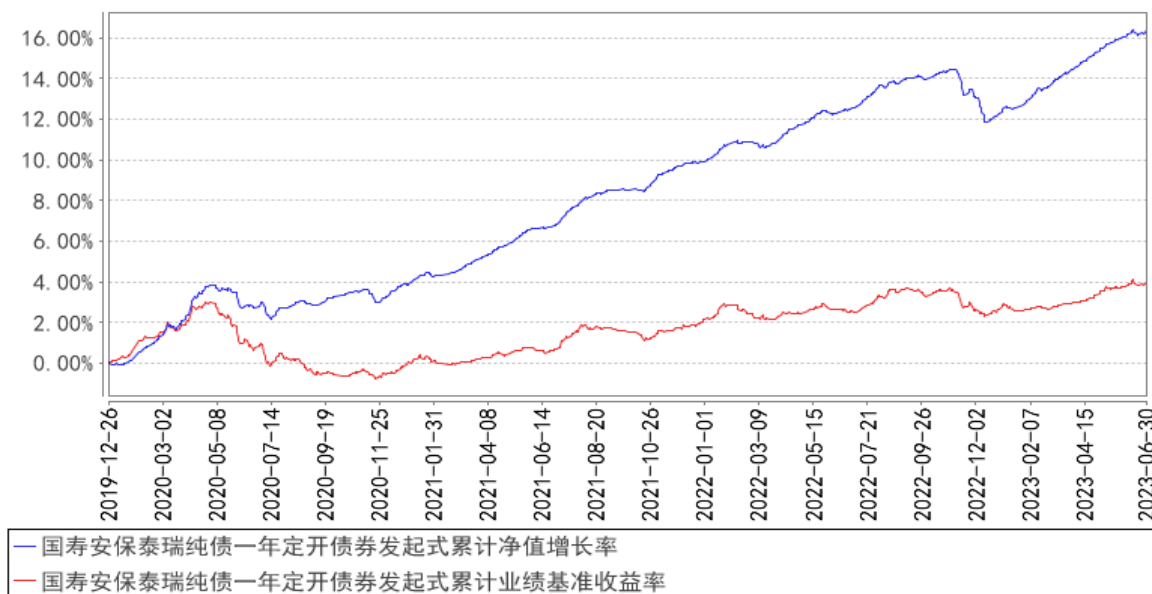
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.31% | 0.05% | 0.18% | 0.05% | 0.13% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.66% | 0.03% | 0.94% | 0.04% | 0.72% | -0.01% |
| 过去六个月 | 3.63% | 0.04% | 1.22% | 0.04% | 2.41% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.42% | 0.06% | 1.35% | 0.05% | 2.07% | 0.01% |
| 过去三年 | 13.17% | 0.05% | 2.99% | 0.05% | 10.18% | 0.00% |
| 自基金合同生效起 | 16.37% | 0.05% | 3.94% | 0.06% | 12.43% | -0.01% |

| | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|

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

国寿安保泰瑞纯债一年定开债券发起式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 2019 年 12 月 26 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 2019 年 12 月 26 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 | | |
| 陶尹斌 | 基金经理 | 2019年12月26日 | - | 9年 | 硕士研究生。曾任中国人寿资产管理有限公司研究员，兴全基金管理有限公司研究员、投资经理助理、投资经理，现任国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金、国寿安保中债 1-3 年国开行债券指数型证券投资基金、国寿安保泰恒纯债债券型证券投资基金、国寿安保泰弘纯债债券型证券投资基金、国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金和国寿安保泰祥纯债一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遵规守信情况的说明

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

4.4 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

债券市场上半年运行大致可分为四个区间，一是两会前随着防疫政策彻底转向，投资者对疫后经济复苏的预期升温，而后社融及 PMI 数据向好，且由于银行加码信贷投放，回购利率波动加剧。从预期扭转到月度数据的验证，收益率曲线先后经历熊陡和熊平。二是两会后政策当局对于全年经济增长目标设定偏谨慎，制造业等高频数据走弱，叠加央行降准补充中长期流动性以及机构面临资产荒，债券收益率一路下行，期间信用债先行领涨，随后利率债占据上风。三是进入 6 月后债市的交易拥挤度达到了阶段性的峰值，随着多家银行宣布下调存款利率以及央行超预期调降逆回购利率，债券做多情绪达到极点，但考虑到持仓浮盈较厚且对一揽子稳增长政策存在担忧，行情紧接迎来了年内的第二次大幅回调。四是 6 月末央行加大流动性投放，跨季资金面略有收敛但整体无忧，机构配置需求支撑延续，债市高位保持韧性，收益率震荡下修、重拾失地，期间利率及城投品种表现更优，二级资本债波动显著放大。

本基金在报告期内以较高的票息延续运行，在银行二级资本债、城投债、普通商金债等品种间依据信用利差水平做积极轮动，并适量参与了利率品种的波段交易，整体久期节奏吻合行情，取得了较好收益。

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 1.0279 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.63%，业绩比较基准收益率为 1.22%。

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，基本面对债券市场定价的支撑大概率延续，但稳增长政策的不确定性将对行情形成较大扰动，需要跟踪地产支持政策的实施力度。关于央行的货币政策，稳中偏松的基调在经济缺乏内生性动力的背景下不易改变。结合机构配置需求仍具厚度，债市韧性可期，可以更多地挖掘结构性机会来获取收益。

本基金在底仓配置上以中短久期、中高等级品种为主，挖掘高票息个券，弹性仓位方面则视利差偏离情况积极轮动，力求捕捉更多结构性收益。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 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：国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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 | 22,268,485.20 | 2,349,396.38 |
| 结算备付金 | | 91,017,803.37 | 102,544,961.66 |
| 存出保证金 | | 3,151,431.00 | 77,291.02 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 6,526,013,799.72 | 6,139,080,133.21 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 6,510,669,132.22 | 6,094,078,248.30 |
| 资产支持证券投资 | | 15,344,667.50 | 45,001,884.91 |
| 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 | | 6,642,451,519.29 | 6,244,051,782.27 |
| 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 | | 2,396,157,374.57 | 2,146,682,121.52 |
| 应付清算款 | | 483,686.74 | 304,791.12 |
| 应付赎回款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | | 1,044,865.39 | 1,043,445.92 |
| 应付托管费 | | 348,288.46 | 347,815.30 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 273,601.93 | 384,659.33 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 217,071.54 | 316,198.66 |
| 负债合计 | | 2,398,524,888.63 | 2,149,079,031.85 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 4,128,586,134.23 | 4,128,586,134.23 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 115,340,496.43 | -33,613,383.81 |
| 净资产合计 | | 4,243,926,630.66 | 4,094,972,750.42 |
| 负债和净资产总计 | | 6,642,451,519.29 | 6,244,051,782.27 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0279 元，基金份额总额 4,128,586,134.23 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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 | | 183,984,914.04 | 123,232,061.89 |
| 1. 利息收入 | | 639,198.46 | 660,070.28 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 636,330.43 | 646,236.76 |
| 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 | | 2,868.03 | 13,833.52 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 110,437,678.24 | 108,211,155.23 |
| 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 | 111,194,932.94 | 106,491,445.79 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | 409,031.17 | 1,719,709.44 |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | -1,166,285.87 | - |
| 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 | 72,908,037.34 | 14,360,836.38 |
| 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 | | 35,031,033.80 | 28,676,518.34 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,208,114.09 | 6,063,738.25 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,069,371.33 | 2,021,246.05 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 26,376,117.84 | 20,140,991.55 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 26,376,117.84 | 20,140,991.55 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 222,087.25 | 315,952.96 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 155,343.29 | 134,589.53 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 148,953,880.24 | 94,555,543.55 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 148,953,880.24 | 94,555,543.55 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 148,953,880.24 | 94,555,543.55 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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） | 4,128,586,134.23 | - | -33,613,383.81 | 4,094,972,750.42 |
| 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） | 4,128,586,134.23 | - | -33,613,383.81 | 4,094,972,750.42 |

| | | | | |
|--|--|------------|----------------|------------------|
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | - | - | 148,953,880.24 | 148,953,880.24 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 148,953,880.24 | 148,953,880.24 |
| (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) | 4,128,586,134.23 | - | 115,340,496.43 | 4,243,926,630.66 |
| 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) | 3,950,108,642.22 | - | 76,096,351.88 | 4,026,204,994.10 |
| 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) | 3,950,108,642.22 | - | 76,096,351.88 | 4,026,204,994.10 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | - | - | 94,555,543.55 | 94,555,543.55 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 94,555,543.55 | 94,555,543.55 |
| (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) | 3,950,108,642.22 | - | 170,651,895.43 | 4,120,760,537.65 |

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>鄂华</u> | <u>王文英</u> | <u>于晓树</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

国寿安保泰瑞纯债一年定期开放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[2019]2449号《关于准予国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》的注册,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《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放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、定期开放式,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 999,998,000.00 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2019)验字第 61090605_A13 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,018,000.02 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,000.02 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”),基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,200.02 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放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,包括债券(包括国债、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、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换公司债、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、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的相关规定)。本基金不投资股票,因持有可转换债券转股所形成的股票,本基金将在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。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%,但在每个开放期的前 1 个月和后 1 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。封闭期内,本基金在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;开放期内,在每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后,本基金持有不低于基金资产净值的 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基金管理有限公司于 2023 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、《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》、《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式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[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。对资管产品在2018年1月1日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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 2023年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 22,268,485.20 |
| 等于：本金 | 22,264,318.85 |
| 加：应计利息 | 4,166.35 |
| 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 | 22,268,485.20 |

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 | 1,769,386,848.93 | 18,560,088.14 | 1,788,331,088.14 | 384,151.07 |
| | 银行间市场 | 4,642,783,910.04 | 64,531,544.08 | 4,722,338,044.08 | 15,022,589.96 |
| | 合计 | 6,412,170,758.97 | 83,091,632.22 | 6,510,669,132.22 | 15,406,741.03 |
| 资产支持证券 | 15,271,000.00 | 59,667.50 | 15,344,667.50 | 14,000.00 | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 6,427,441,758.97 | 83,151,299.72 | 6,526,013,799.72 | 15,420,741.03 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | 备注 |
|---------------|------------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | -151,201,500.00 | - | - | - |
| 其中： 国债期货投资 | -151,201,500.00 | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | - | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | -151,201,500.00 | - | - | - |

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值 | 公允价值变动 |
|------------|--------------|----------|-----------------|---------------|
| T2309 | 10 年期国债 2309 | -150.00 | -152,947,500.00 | -1,746,000.00 |
| 合计 | | | | -1,746,000.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | | | | -1,746,000.00 |
| 净额 | | | | - |

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

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 | | 107,975.60 |
| 其中：交易所市场 | | - |
| 银行间市场 | | 107,975.60 |
| 应付利息 | | - |
| 预提费用 | | 109,095.94 |
| 合计 | | 217,071.54 |

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 | 4,128,586,134.23 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 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 | 4,128,586,134.23 | 4,128,586,134.23 |

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 | 36,445,012.94 | -70,058,396.75 | -33,613,383.81 |
| 本期利润 | 76,045,842.90 | 72,908,037.34 | 148,953,880.24 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 112,490,855.84 | 2,849,640.59 | 115,340,496.43 |

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 | 31,799.40 |
| 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 | 603,760.22 |
| 其他 | 770.81 |
| 合计 | 636,330.43 |

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 | 114,941,769.64 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入 | -3,746,836.70 |
| 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 | 111,194,932.94 |

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 | 9,876,992,325.50 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 9,726,707,616.08 |
| 减：应计利息总额 | 153,928,658.62 |
| 减：交易费用 | 102,887.50 |
| 买卖债券差价收入 | -3,746,836.70 |

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|--------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 409,031.17 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 409,031.17 |

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出资产支持证券成交总额 | 40,005,323.50 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 39,405,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 600,323.50 |
| 减：交易费用 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - |

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 |
|----------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 国债期货投资收益 | -1,166,285.87 |

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 | 74,654,037.34 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 74,578,037.34 |
| 资产支持证券投资 | 76,000.00 |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | -1,746,000.00 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | -1,746,000.00 |
| 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 | 72,908,037.34 |

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

无。

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 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 27,647.35 |
| 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 | 155,343.29 |

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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大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 |
| 民生银行 | 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 |
| 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 |
| 广发银行股份有限公司（简称“广发银行”） | 基金管理人股东之股东的联营企业 |

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未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 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 | 6,208,114.09 | 6,063,738.25 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30 \% \div \text{当年天数}$$

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 | 2,069,371.33 | 2,021,246.05 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

本基金于本报告期及上年度可比期间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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,200.02 | 10,000,200.02 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,200.02 | 10,000,200.02 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.24% | 0.25% |

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 | | 上年度末 | |
|-------|------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| | 2023 年 6 月 30 日 | | 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 (%) |
| 中国人寿 | 3,778,813,509.03 | 91.53 | 3,778,813,509.03 | 91.53 |

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 | |
|-------|---------------------------------|--------|---------------------------------|--------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 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 |

| | | | | |
|------|---------------|-----------|--------------|-----------|
| 民生银行 | 22,268,485.20 | 31,799.40 | 2,412,450.36 | 22,250.64 |
|------|---------------|-----------|--------------|-----------|

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，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

本基金于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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金于本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于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 1,276,479,832.40 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|---------------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 102380923 | 23 乌城轨 MTN002 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.11 | 600,000 | 60,668,786.89 |
| 2020036 | 20 西安银行二级 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.66 | 400,000 | 41,062,316.94 |
| 2020080 | 20 长沙银行二级 | 2023 年 7 月 3 日 | 106.10 | 673,000 | 71,403,456.16 |
| 2023005 | 20 平安人寿 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.72 | 366,000 | 37,230,284.00 |
| 2023008 | 20 光大永明人寿 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.06 | 625,000 | 63,785,860.65 |
| 2120044 | 21 长沙银行二级 | 2023 年 7 月 3 日 | 103.25 | 200,000 | 20,650,404.37 |
| 2121062 | 21 北京农商二级 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.99 | 200,000 | 20,598,784.66 |
| 2220030 | 22 重庆银行二级 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.59 | 1,445,000 | 146,804,103.83 |
| 232280003 | 22 成都银行二级资本债 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.77 | 239,000 | 24,561,584.74 |
| 012380639 | 23 碧水源 SCP001(科创票据) | 2023 年 7 月 4 日 | 101.43 | 400,000 | 40,572,677.26 |
| 012381376 | 23 碧水源 SCP003(科创票据) | 2023 年 7 月 4 日 | 100.93 | 100,000 | 10,092,792.35 |
| 102100770 | 21 昌吉州 MTN001 | 2023 年 7 月 4 日 | 102.06 | 400,000 | 40,825,530.06 |
| 102281677 | 22 宜春交通 MTN002 | 2023 年 7 月 4 日 | 101.97 | 600,000 | 61,179,534.25 |
| 102282158 | 22 郑新建投 MTN001 | 2023 年 7 月 4 日 | 101.20 | 625,000 | 63,251,746.58 |

| | | | | | |
|-----------|----------------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 2023005 | 20 平安人寿 | 2023 年 7 月 5 日 | 101.72 | 3,158,000 | 321,238,352.11 |
| 102381044 | 23 郑州高新 MTN001 | 2023 年 7 月 6 日 | 100.69 | 445,000 | 44,807,113.23 |
| 1920065 | 19 齐鲁银行二级 | 2023 年 7 月 6 日 | 105.17 | 1,300,000 | 136,722,681.10 |
| 2220017 | 22 西安银行二级 01 | 2023 年 7 月 6 日 | 102.00 | 1,000,000 | 102,001,901.64 |
| 2220030 | 22 重庆银行二级 | 2023 年 7 月 6 日 | 101.59 | 555,000 | 56,384,967.21 |
| 232380008 | 23 广州农商行二级 资本债 01 | 2023 年 7 月 6 日 | 103.82 | 372,000 | 38,619,230.82 |
| 合计 | | | | 13,703,000 | 1,402,462,108.85 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 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人民币 1,119,677,542.172 元，于 2023 年 07 月 03 日到期。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

本基金于本报告期末参与转融通业务。

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 | 22,268,485.20 | - | - | - | 22,268,485.20 |
| 结算备付金 | 91,017,803.37 | - | - | - | 91,017,803.37 |
| 存出保证金 | 3,151,431.00 | - | - | - | 3,151,431.00 |
| 交易性金融资产 | 1,684,925,077.39 | 1,942,634,685.68 | 2,898,454,036.65 | - | 6,526,013,799.72 |
| 资产总计 | 1,801,362,796.96 | 1,942,634,685.68 | 2,898,454,036.65 | - | 6,642,451,519.29 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|--------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,044,865.39 | 1,044,865.39 |
| 应付托管费 | - | - | - | 348,288.46 | 348,288.46 |
| 应付清算款 | - | - | - | 483,686.74 | 483,686.74 |
| 卖出回购金融资产款 | 2,396,157,374.57 | - | - | - | 2,396,157,374.57 |
| 应交税费 | - | - | - | 273,601.93 | 273,601.93 |
| 其他负债 | - | - | - | 217,071.54 | 217,071.54 |
| 负债总计 | 2,396,157,374.57 | 0.00 | 0.00 | 2,367,514.06 | 2,398,524,888.63 |
| 利率敏感度缺口 | -594,794,577.61 | 1,942,634,685.68 | 2,898,454,036.65 | -2,367,514.06 | 4,243,926,630.66 |
| 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 | 2,349,396.38 | - | - | - | 2,349,396.38 |
| 结算备付金 | 102,544,961.66 | - | - | - | 102,544,961.66 |
| 存出保证金 | 77,291.02 | - | - | - | 77,291.02 |
| 交易性金融资产 | 2,840,584,373.73 | 1,846,929,209.34 | 1,451,566,550.14 | - | 6,139,080,133.21 |
| 资产总计 | 2,945,556,022.79 | 1,846,929,209.34 | 1,451,566,550.14 | - | 6,244,051,782.27 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,043,445.92 | 1,043,445.92 |
| 应付托管费 | - | - | - | 347,815.30 | 347,815.30 |
| 应付清算款 | - | - | - | 304,791.12 | 304,791.12 |
| 卖出回购金融资产款 | 2,146,682,121.52 | - | - | - | 2,146,682,121.52 |
| 应交税费 | - | - | - | 384,659.33 | 384,659.33 |
| 其他负债 | - | - | - | 316,198.66 | 316,198.66 |
| 负债总计 | 2,146,682,121.52 | - | - | 2,396,910.33 | 2,149,079,031.85 |
| 利率敏感度缺口 | 798,873,901.27 | 1,846,929,209.34 | 1,451,566,550.14 | -2,396,910.33 | 4,094,972,750.42 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况； | | |
| | 2. 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； | | |
| | 3. 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 | -30,271,124.23 | -18,813,280.95 |
| | -25 个基准点 | 30,546,749.00 | 18,942,061.87 |

注：上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 2023 年 06 月 30 日，本基金无重大价格风险(2022 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 2023 年 06 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 | 6,526,013,799.72 | 6,139,080,133.21 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 6,526,013,799.72 | 6,139,080,133.21 |

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 | 6,526,013,799.72 | 98.25 |
| | 其中：债券 | 6,510,669,132.22 | 98.02 |
| | 资产支持证券 | 15,344,667.50 | 0.23 |
| 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 | 113,286,288.57 | 1.71 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,151,431.00 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 6,642,451,519.29 | 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

本基金本报告期内未持有股票。

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 | 3,433,670,212.14 | 80.91 |
| | 其中：政策性金融债 | 52,063,356.16 | 1.23 |
| 4 | 企业债券 | 1,202,701,661.28 | 28.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 292,001,230.65 | 6.88 |
| 6 | 中期票据 | 1,582,296,028.15 | 37.28 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 6,510,669,132.22 | 153.41 |

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 | 2023005 | 20 平安人寿 | 3,700,000 | 376,371,723.50 | 8.87 |
| 2 | 2020080 | 20 长沙银行二级 | 3,100,000 | 328,901,506.85 | 7.75 |
| 3 | 232280012 | 22 广州银行二级资本债 01 | 2,800,000 | 294,797,424.66 | 6.95 |
| 4 | 232380008 | 23 广州农商行二级资本债 01 | 2,700,000 | 280,300,868.85 | 6.60 |
| 5 | 185784 | 22 开源 01 | 2,500,000 | 251,678,739.73 | 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 199386 | 首城 01 优 | 100,000 | 10,055,265.21 | 0.24 |
| 2 | 112101 | 恒信 58A1 | 300,000 | 5,289,402.29 | 0.12 |

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

7.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的，并结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过空头套期保值等策略进行操作，对冲投资风险。本基金国债期货交易总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金的国债期货投资整体操作上相对谨慎，对基金的收益以及波动性控制都有一定的积极作用。后期仍将努力把握确定性较大的机会，对冲投资风险，提升基金收益。

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，长沙银行股份有限公司、光大永明人寿保险有限公司、广东顺德农村商业银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司、重庆银行股份有限公司、珠海华润银行股份有限公司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；长沙银行股份有限公司、广东顺德农村商业银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、开源证券股份有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚；长沙银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司、重庆银行股份有限公司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；光大永明人寿保险有限公司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；广州农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到银行间市场交易商协会的处罚。

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

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,151,431.00 |
| 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 | 3,151,431.00 |

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 (%) |
| 7 | 589,798,019.18 | 4,128,586,134.23 | 100.00 | - | - |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人的从业人员本报告期末未持有本基金。

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情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,200.02 | 0.24 | 10,000,200.02 | 0.24 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,200.02 | 0.24 | 10,000,200.02 | 0.24 | 3 年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 12 月 26 日）基金份额总额 | 1,000,018,000.02 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,128,586,134.23 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 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 | 4,128,586,134.23 |

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

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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关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 (%) | |
| 兴业证券 | 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，本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(%) |
| 兴业证券 | 2,005,331,130.00 | 100.00 | 87,134,051,000.00 | 100.00 | - | - |

10.8 其他重大事件

无。

§ 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 | 3,778,813,509.03 | 0.00 | 0.00 | 3,778,813,509.03 | 91.53 |
| 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泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式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 报告期内国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式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.gsfunds.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