

# 中银证券安进债券型证券投资基金

# 2019年半年度报告摘要

基金管理人:中银国际证券股份有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:2019年8月26日

§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法律责任。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。  
本报告中期财务资料未经审计。  
本报告自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。  
4.3 管理人对于报告期内基金投资情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规,建立了基金投资管理、资产管理业务公平交易管理办法,研究与交易部交易异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系,公司基金投资管理、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易所有投资管理活动,同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各个环节。  
报告期内,公司一直严格遵循公平交易相关规章制度,执行严格的公平交易行为,在严格方针指导下,报告期内,公司未出现任何异常关联交易以及禁止交易对手间的交易行为。  
报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下(如:1日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合间向交易开展交易价差分析,分析结果表明,本报告期内公司对各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。  
4.3.2 异常交易行为的专项说明  
报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发生同日反向交易成交较多的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。  
本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

单位:人民币元

项目	期初	本期	期末
一、收入	639,241,773.48	1,363,281,886.04	2,002,523,659.52
1.利息收入	719,697,109.84	817,122,413.24	1,536,819,523.08
其中:存款利息收入	1,171,600.37	2,369,260.36	3,540,860.72
债券利息收入	718,525,499.47	814,753,152.88	1,533,278,662.32
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,883,124.23	19,797,427.07	24,671,130.13
其他收入	-	-	-
减:其他费用(损失以“-”号填列)	-49,701,150.63	-17,174,026.26	-66,875,176.89
其中:销售费用	-	-	-
管理费用	-49,701,150.63	-17,174,026.26	-66,875,176.89
财务费用	-	-	-
其他费用	-	-	-
资产减值损失	-	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-30,714,794.70	648,486,268.13	341,771,473.43
其中:公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	51,837	57,92
汇兑损益	-	-	-
其他	67,109,403.03	76,650,463.00	143,759,866.03
二、费用	6,442.1	49,403,794.28	55,845,236.38
1.销售费用	6,442.1	16,407,920.46	18,849,362.56
2.管理费用	-	32,995,873.82	32,995,873.82
3.财务费用	6,442.1	1,000	2,000
4.其他费用	-	82,764.04	21,000.00
5.利息支出	-	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-	-
6.税金及附加	660,926.33	1,396,130.91	2,057,057.24
7.其他损益	194,894.36	368,411.21	563,305.57
8.其他	-	-	-
其中:公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	572,132,396.65	1,307,361,644.02	2,079,558,040.67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券安进债券
基金简称	安进债券
基金代码	000929
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年12月15日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同终止日期	不定期
下属分级基金名称	中银证券安进债券A
下属分级基金代码	-
下属分级基金场内简称	-
下属分级基金的交易代码	000929
下属分级基金的场内简称	安进A
基金合同生效日期	2016年12月15日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标:在有效控制风险的基础上,通过积极主动的资产管理,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。  
投资策略:本基金采取自上而下的资产配置策略,根据宏观经济形势、信用债市场利率变化及支持证券发行情况,动态调整资产配置,以获取长期稳健收益。  
业绩比较基准:中债综合全价债券指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%  
风险收益特征:本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险品种,其预期收益和风险低于股票型基金及混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中银国际证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
住所	北京市西城区银监会中银大厦21层	北京市东城区建国门内大街26号
法定代表人	汪建中	刘金尧
负责人	汪建中	刘金尧
联系人	李颖	李颖
联系电话	010-61928888	010-61928888
传真	010-61928888	010-61928888
网址	www.bocib.com	www.abchina.com

2.4 信息披露方式

本基金年度报告正文的披露网站为:www.bocib.com  
基金年度报告存放地点:基金管理人及基金托管人处

## §3 主要财务数据和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

项目	本报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)	本报告期末	上年度末
1.1.1 本期基金份额净值增长率	3.23%	3.23%	3.23%
1.1.2 本期基金份额净值增长率标准差	0.02%	0.02%	0.02%
1.1.3 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.4 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.5 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.6 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.7 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.8 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.9 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.10 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.11 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.12 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.13 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.14 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.15 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.16 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.17 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.18 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.19 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.20 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.21 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.22 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.23 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.24 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.25 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.26 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.27 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.28 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.29 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.30 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.31 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.32 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.33 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.34 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.35 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.36 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.37 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.38 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.39 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.40 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.41 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.42 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.43 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.44 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.45 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.46 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.47 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.48 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.49 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.50 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.51 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.52 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.53 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.54 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.55 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.56 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.57 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.58 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.59 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.60 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.61 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.62 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.63 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.64 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.65 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.66 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.67 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.68 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.69 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.70 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.71 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.72 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.73 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.74 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.75 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.76 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.77 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.78 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.79 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.80 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.81 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.82 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.83 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.84 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.85 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.86 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.87 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	0.01%	0.01%	0.01%
1.1.88 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差			