中银证券安誉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:中国民生银行股份有限公司

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的法律责任。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券安誉债券	
场内简称	-	
基金主代码	004956	
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	2018年3月29日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,418,994,406.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	004956	004957
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	2,415,876,111.55份	3,118,294.91份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券投资策略、中小企业私募债券投资策略及资产支持证券投资策略,以期获得长期稳定收益。
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,其预期收益和预期风险低于股票型及混合型基金,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		中银国际证券股份有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵向雷	罗菲菲
	联系电话	021-20328000	010-58560666
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-61195566,400-620-8888	95568
传真		021-50372474	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
本期已实现收益	19,328,097.09	10,297,260.55
本期利润	29,436,846.59	7,918,725.79
加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0217
本期基金份额净值增长率	1.83%	1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0094	0.8792
期末基金资产净值	2,444,883,949.76	5,875,434.37
期末基金份额净值	1.0120	1.8842

注:1.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;

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

3.期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

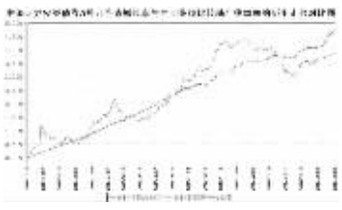
3.2 基金净值表现

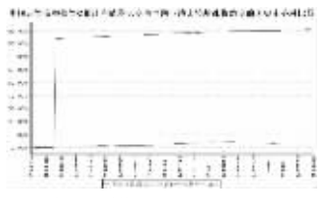
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银证券安誉债券A						
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	0.66%	0.03%	0.28%	0.03%	0.38%	0.00%
过去三个月	0.90%	0.03%	-0.24%	0.06%	1.14%	-0.03%
过去六个月	1.83%	0.03%	0.24%	0.06%	1.59%	-0.03%
过去一年	3.86%	0.02%	2.82%	0.06%	1.04%	-0.04%
自基金合同生效起至今	4.77%	0.02%	3.89%	0.07%	0.88%	-0.05%
中银证券安誉债券C						
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	0.62%	0.03%	0.28%	0.03%	0.34%	0.00%
过去三个月	0.86%	0.03%	-0.24%	0.06%	1.10%	-0.03%
过去六个月	1.74%	0.03%	0.24%	0.06%	1.50%	-0.03%
过去一年	3.67%	0.02%	2.82%	0.06%	0.85%	-0.04%
自基金合同生效起至今	91.98%	4.74%	3.89%	0.07%	88.09%	4.67%

注:业绩比较基准=中债综合全价指数收益率。

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





注:1.本基金合同于2018年3月29日生效;

2.按照基金合同约定,自基金成立日起6个月为建仓期,截止本报告期末,基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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

中银国际证券股份有限公司(以下简称"中银国际证券")经中国证监会批准于2002年2月28日在上海成立,注册资本25亿元人民币。股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝屹企业管理中心(有限合伙)、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司。中银国际证券的经营范围包括:证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理业务、为期货公司提供中间介绍业务。截至2019年6月30日,本管理人共管理十七只证券投资基金,包括:中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金(原中银证券保本1号混合型证券投资基金)、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金基金经理。

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		
王玉玺	本基金基金经理	2018年3月29日	-	13	王玉玺,硕士研究生。2006年7月至2008年7月任职于中国农业银行资金运营部,担任交易员;2008年8月至2016年6月任职于中国农业银行金融市场部,担任交易员、高级交易员;2016年6月加入中银国际证券股份有限公司,历任中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券保本1号混合型证券投资基金基金经理,现任基金管理部副总经理、中银国际证券中国红债券宝投资主办人、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金基金经理。
吴康	本基金基金经理	2019年6月5日	-	6	吴康,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。2013年1月至2014年7月任职于财通基金管理有限公司,担任固定收益交易员;2014年8月至2014年12月任职于嘉合基金管理有限公司,担任固定收益交易员;2014年12月加入中银国际证券股份有限公司,现任中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安誉债券型证券投资基金基金经理。

注:1.上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的涵义遵从行业协会《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《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定,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,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

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,建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、研究与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。公司基金管理业务、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、二级市场交易等所有投资管理活动,同时涵盖包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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与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同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

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发生同日反向交易成交较少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交易。

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

2019年一季度经济下行压力较大,二季度初公布的经济及金融数据均高于市场预期,其中PMI指数一度重返扩张区域,新订单指数连续2个月好转。5、6月份随着主要分项指标持续回落,企业主动去库存压力加大,PMI指数再次回到荣枯线以下,上半年经济呈现底部震荡的态势。市场流动性方面,年初央行继续维持流动性合理充裕,1月14日当周央行更是创纪录净投放1.16万亿以应对缴税及春节前提现所产生的资金缺口。二季度随着经济短暂回暖,央行打破此前市场对4月降准的预期,转而在4月24日开展2674亿TMLF以实现流动性的精准滴灌。5月初中美贸易摩擦再度发酵,央行罕见的在盘中宣布定向降准以稳定市场信心,隔夜回购利率一度下探至1.0%附近。但月末受包商银行事件影响货币市场利率快速上行,6月中旬央行及证监会连续出台一系列维稳政策纾解非银机构流动性压力,隔夜Shibor创10年多新低,资金面最终平稳度过半年末时点。总体来看,上半年债券市场在经济基本面及各类事件冲击的推动下,整体收益率呈现先上后下的走势。

报告期内,本基金主要配置了中高等级信用债、银行同业存单和利率债,以获取稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券安誉债券A基金份额净值为1.0120元,本报告期基金份额净值增长率为1.83%;截至本报告期末中银证券安誉债券C基金份额净值为1.8842元,本报告期基金份额净值增长率为1.74%;同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年下半年,国内经济依然面临较大下行压力,而中美贸易谈判的反复则会进一步增加不确定性。在此背景下,资金面维持合理宽松依然是大概率事件,经济基本面及货币政策总体对债券构成支持。同时,需要警惕债券供给上升及各类突发事件所带来的回调风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长,成员由基金管理部、业务营运部、内控与法律合规部、审计部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金对本报告期内利润进行的收益分配情况如下:2019年4月27日公告每10份A\C级基金份额派发红利0.020元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在连续二十个工作日基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,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,完全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,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,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规定进行。

5.3 托管人对本半年度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、投资组合报告等内容真实、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:中银证券安誉债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款		3,020,735.13	932,308.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	1,957.22
交易性金融资产		2,518,792,056.17	261,781,000.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,406,996,500.00	261,781,000.00
资产支持证券投资		111,795,556.17	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		51,664,355.84	7,971,925.59
应收股利		-	-
应收申购款		410,581.31	300.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,573,887,728.45	270,687,491.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		121,999,819.00	23,958,844.06
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,990.45	74,658.76
应付管理人报酬		623,890.91	62,802.38
应付托管费		207,963.65	20,934.12
应付销售服务费		14,989.03	4,030.96
应付交易费用		51,229.25	3,030.09
应交税费		19,618.19	-
应付利息		33,271.41	13,918.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		171,572.43	339,999.00
负债合计		123,128,344.32	24,478,217.69
所有者权益:			
实收基金		2,418,994,406.46	237,035,056.50
未分配利润		31,764,977.67	9,174,217.23
所有者权益合计		2,450,759,384.13	246,209,273.73
负债和所有者权益总计		2,573,887,728.45	270,687,491.42

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额2,418,994,406.46份,其中中银证券安誉债券A基金份额总额为2,415,876,111.55份,基金份额净值1.0120元;中银证券安誉债券C基金份额总额为3,118,294.91份,基金份额净值1.8842元。

6.2 利润表

会计主体:中银证券安誉债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		44,743,186.40	26,117,143.61
1.利息收入		49,335,482.78	26,230,715.82
其中:存款利息收入		128,744.07	23,440,428.35
债券利息收入		49,012,004.89	2,069,728.78
资产支持证券利息收入		135,847.85	-
买入返售金融资产收入		58,885.97	720,558.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-13,564,507.56	1,947.92
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-13,564,507.56	1,947.92
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		7,730,214.74	-120,740.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,241,996.44	5,219.87
减:二、费用		7,387,614.02	4,630,638.73
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	3,298,635.37	3,796,226.23
2.托管费	6.4.8.2.2	1,099,545.15	636,026.85
3.销售服务费	6.4.8.2.3	175,797.31	76,787.14
4.交易费用		30,914.99	2,390.43
5.利息支出		2,636,130.91	-
其中:卖出回购金融资产支出		2,636,130.91	-
6.税金及附加		19,191.68	-
7.其他费用		127,398.61	119,208.08
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		37,355,572.38	21,486,504.88
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		37,355,572.38	21,486,504.88

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银证券安誉债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	237,035,056.50	9,174,217.23	246,209,273.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,355,572.38	37,355,572.38
三、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)	2,181,959,349.96	26,437,595.84	2,208,396,945.80
其中:1.基金申购款	4,016,468,224.94	463,179,662.11	4,479,647,887.05
2.基金赎回款	-1,834,508,874.98	-436,742,066.27	-2,271,250,941.25
四、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)	-	-41,202,407.78	-41,202,407.78
五、期末所有者权益(基金净值)	2,418,994,406.46	31,764,977.67	2,450,759,384.13
项目	上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,600,034,880.40	-	2,600,034,880.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,486,504.88	21,486,504.88
三、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)	-197,275,852.69	1,418,835.74	-195,857,016.95
其中:1.基金申购款	4,313,769.78	3,107,326.18	7,421,095.96
2.基金赎回款	-201,589,622.47	-1,688,490.44	-203,278,112.91
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,402,759,027.71	22,905,340.62	2,425,664,368.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1	至7.4财务报表由下列负责人签署:		
	宁敏	沈锋	戴景义
	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

中银证券安誉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[2017]1124号《关于准予中银证券安誉债券型证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司(原"中银国际证券有限责任公司",于2017年12月29日更名)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安誉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基金,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2,600,034,866.70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(2018)第229号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》于2018年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,600,034,880.40份基金份额,其中认购资金利息折合13.70份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,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")。

根据《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安誉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,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债、可分离交易债券的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券、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)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;保持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%。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中银国际证券股份有限公司于2019年8月23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(年度报告和半年度报告)》、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》、《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止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

本基金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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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 。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司(“中银证券”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	基金托管人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
中银证券	136,843,583.57	100.00	148,584,452.08	100.00

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,298,635.37	3,796,226.23
其中:支付销售机构的客户维护费	428,868.97	1,144,620.77

注:支付基金管理人中银国际的管理费按合同规定为:按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

根据2018年6月29日发布的《中银国际证券股份有限公司关于中银证券安誉债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自2018年6月29日起执行调整后的管理费率:按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,099,545.15	636,026.85

注:支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C	合计
中国银行	0.00	790.68	790.68
中银证券	0.00	171,836.53	171,836.53
合计	0.00	172,627.21	172,627.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C	合计
中银证券	-	74,907.05	74,907.05
中国银行	-	249.07	249.07
合计	-	75,156.12	75,156.12

注:支付基金销售机构的中银证券安誉债券型证券投资基金C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中银证券,再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

C类基金份额日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 0.35%/ 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
基金合同生效日(2018年3月29日)持有的基金份额	299,999,000.00	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	329,464,004.72	-
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	329,464,004.72	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.6200%	-
项目	上年度可比期间 2018年3月29日至2018年6月30日	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
基金合同生效日(2018年3月29日)持有的基金份额	299,999,000.00	-
报告期初持有的基金份额	299,999,000.00	-
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	299,999,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.4900%	-

6.4.8.4.2 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

注:本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018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	3,020,735.13	128,737.25	7,548,165.83	177,781.17

注:本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额121,999,819.00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