# 国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

## 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。本半年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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6月30日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国联安增富一年定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 006495 |
| 交易代码 | 006495 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年11月14日 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,009,999,000.00份 |

### 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。 |
| 投资策略 | 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。<br>1.封闭期投资策略<br>本基金封闭期内将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,通过定量分析增强组合策略操作的方法,确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果,利用自主开发的信用分析系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,以尽量获取最大化的信用溢价。本基金封闭期内采用的投资策略包括:期限结构策略、久期策略、行业配置策略、个券挖掘策略等。<br>(1)期限结构策略<br>通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类型债券进行久期配置;当收益率曲线走势难以判断时,参考基准指数的样本券久期构建组合久期,确保组合收益超过基准收益。具体来看,又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。<br>1)骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。<br>2)子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点,适用于收益率曲线较陡时;杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端,适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动;梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线,适用于收益率曲线水平移动。<br>(2)久期策略<br>本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析,进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低利率变动对组合带来的影响。本基金管理人的固定收益团队将定期对利率期限结构进行预判,在考虑封闭期剩余期限的基础上,制定相应的久期目标,当预期市场利率水平将上升时,适当降低组合的久期;预期市场利率将下降时,适当提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。<br>(3)行业配置策略<br>债券市场所涉及行业众多,同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生,本基金分别采用以下的分析策略:<br>1)分散化投资:发行人涉及众多行业,本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构,避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。<br>2)行业投资:本基金将依照对下一阶段各行业景气度特征的研判,确定在下一阶段在各行业的配置比例,卖出景气度降低行业的债券,提前布局景气度提升行业的债券。<br>(4)个券挖掘策略<br>本部分策略强调公司价值挖掘的重要性,在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略,甄别具有估值优势、基本面改善的公司,采取高度分散策略,重点布局优势债券,争取提高组合超额收益空间。<br>(5)信用债投资策略<br>信用品种收益率的主要影响因素为利率品种基准收益与信用利差。信用利差是信用产品相对国债、央行票据等利率产品获取较高收益的来源。信用利差主要受两方面的影响,一方面为债券所对应信用等级的市场平均信用利差水平,另一方面为发行人本身的信用状况。信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响,因此,一方面,本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势;另一方面,本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅,即采用内外结合的信用研究和评级制度,研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体债的实际信用状况。<br>(6)中小企业私募债券投资策略<br>中小企业私募债券本质上为公司债,本基金对中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。<br>本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素,给予不同因素不同权重,采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估,选择发行主体资质优良,估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。<br>(7)资产支持证券投资策略<br>资产支持证券定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产证券化产品的质量和利率风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。<br>(8)国债期货投资策略<br>本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融杠生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。<br>2.开放期投资策略<br>开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险较低收益的产品 |

注:本基金以开放期和封闭期相结合的方式运作。封闭期指自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)一年的期间,如果封闭期到期日的次日为非工作日的,封闭期相应顺延。首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入首个开放期,第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间,如果封闭期到期日的次日为非工作日的,封闭期相应顺延,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。开放期指自封闭期结束之日后第一个工作日(含该日)五至二十个工作日,具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务,开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的,开放期时间顺延,直到满足开放期的时间要求。

### 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 | | 国联安基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李华 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-38992888 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | customer.service@cpicfunds.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 021-38784766/4007000365 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-50151582 | 010-66275853 |

### 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | www.cpicfunds.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼 |

## 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日至2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 85,022,228.53 |
| 本期利润 | 77,623,049.48 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0155 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.55% |
| 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 | 0.0100 |
| 期末基金资产净值 | 5,070,009,331.02 |
| 期末基金份额净值 | 1.0120 |

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益要低于所列数字。

2、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,包含停牌股票按公允价值调整的影响。

3、对期末可供分配利润,采用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。

4、本基金基金合同于2018年11月14日生效。截至报告期末,本基金成立未满1年。

### 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

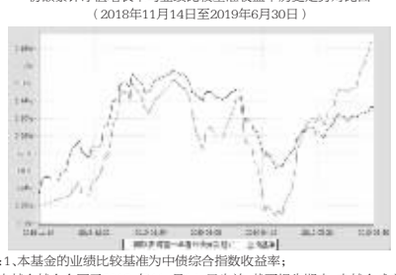
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.95% | 0.04% | 0.28% | 0.03% | 0.67% | 0.01% |
| 过去三个月 | 0.75% | 0.10% | -0.24% | 0.06% | 0.99% | 0.04% |
| 过去六个月 | 1.55% | 0.10% | 0.24% | 0.06% | 1.31% | 0.04% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 2.26% | 0.09% | 1.35% | 0.06% | 0.91% | 0.03% |

注:1、本基金基金合同于2018 年11 月14 日生效,截至报告期末,本基金成立不满一年;

2、上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。

#### 3.2.2 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

国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年11月14日至2019年6月30日)



注:1、本基金的业绩比较基准为中债综合指数收益率;

2、本基金基金合同于2018 年11 月14 日生效,截至报告期末,本基金成立不满一年;

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

4、上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。

## 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

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司,其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司,是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险(集团)股份有限公司控股的资产管理公司;外方股东为德国安联集团,是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末,公司共管理四十六只开放式基金。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队,借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验,结合本地投资研究与客户服务的成功实践,秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念,力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 欧阳健 | 本基金基金经理、兼任国联安货币市场证券投资基金、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增瑞政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金经理、固定收益部总经理兼养老金及FOP投资部总经理。 | 2018-11-27 | - | 17年(自2002年起) | 欧阳健先生,硕士研究生。2002年9月至2016年2月在广发银行股份有限公司金融市场部担任利率及衍生产品交易主管。2016年2月至2018年5月在广发证券股份有限公司固定收益投资部担任部门执行董事。2018年5月加入国联安基金管理有限公司,担任固定收益部副总监、现任固定收益部总经理兼养老金及FOP投资部总经理。2018年6月起任国联安货币市场证券投资基金的基金经理。2018年11月起兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年5月起兼任国联安增瑞政策性金融债纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 沈丹 | 本基金基金经理、兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安双佳信用债券型证券投资基金基金经理、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增盈纯债债券型证券投资基金基金经理、国联安增鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。 | 2018-11-14 | - | 9年(自2010年起) | 沈丹女士,硕士研究生。2010年8月至2015年2月在中国人保资产管理股份有限公司担任交易员;2015年3月至2017年2月在江苏常熟农村商业银行股份有限公司任投资经理。2017年3月加入国联安基金管理有限公司,担任基金经理助理。2017年8月至2018年11月兼任国联安鑫乾混合型证券投资基金和国联安鑫隆混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月至2018年6月兼任国联安鑫裕混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月至2018年11月兼任国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起兼任国联安灵活配置混合型证券投资基金(原国联安保本混合型证券投资基金)的基金经理。2018年7月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年11月起兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年1月起兼任国联安增鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019年5月起兼任国联安增盈纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 郑海峰 | 本基金基金经理、兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。 | 2018-11-14 | 2019-05-16 | 13年(自2006年起) | 郑海峰先生,硕士研究生。2006年11月至2011年8月担任北方之星数码技术(北京)有限公司金融研发部固定收益分析师;2011年8月至2013年12月担任信商银行股份有限公司全球金融部债券交易员;2014年2月至2017年9月担任东海证券股份有限公司资产管理分公司固定收益投资部投资经理;2017年9月加入国联安基金管理有限公司,担任投资经理。2018年2月至2019年5月任国联安信心增益债券型证券投资基金的基金经理,2018年11月至2019年5月兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |

注:1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

### 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》、《国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无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

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章,制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”),用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会;在交易环节严格按照时间优先,价格优先的原则执行指令;如遇指令价相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

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同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

### 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

上半年,债市收益率先上后下,整体略有上行。3月PMI突然冲高至50.5,叠加1月4.6万亿的社融数据,市场对经济的乐观情绪升温,一季度权益市场高涨,债券持续承压,债券市场在4月份利率大幅振荡上行。二季度后两个月随着基本面数据的下行市场情绪又开始重新回到经济下行路径,5月末出现的包商银行事件对市场形成了短暂冲击,央行果断出手维护市场流动性安全,利率在5.6两个月持续下行。

本基金密切跟踪市场动向,面对震荡行情依然看多后市,没有对仓位做出明显调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为1.55%,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

展望下半年,经济下行压力仍在,虽然G20峰会期间中美两国首脑达成了部分共识,情绪上出现一些边际改善,但在宽松货币环境下解决债务问题仍然是未来一段时间的主基调。本基金将继续跟踪经济基本面、货币政策等方面的变化,适时进行持仓结构调整。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成,并根据业务分工履行相应的职责,所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值工作小组成员1/2以上多数票通过,量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致,估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策,公司和基金托管银行有充分沟通,积极商讨达成一致意见;对于估值结果,公司和基金托管银行有详细的核对流程,达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定,以及本基金实际运作情况,本基金对本报告期内利润分配情况如下,符合本基金基金合同的相关规定。

本基金以截止至2019年1月23日的可供分配利润为基准,于2019年1月28日实施分红,向截止至2019年1月28日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的基金份额持有人,按每10份基金份额0.052元派发红利。共发放红利26,051,994.80元。

本基金以截止至2019年5月17日的可供分配利润为基准,于2019年5月28日实施分红,向截止至2019年5月28日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的基金份额持有人,按每10份基金份额0.053元派发红利。共发放红利26,552,994.70元。

### 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金对基金份额持有人进行了利润分配,分配金额为52,604,989.50元。

### 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。

## 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:国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 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 | 484,034.60 | 3,835,015.64 |
| 结算备付金 | 422,000.00 | 71,320,868.63 |
| 存出保证金 | 72,605.72 | 8,663.26 |
| 交易性金融资产 | 4,958,556,800.00 | 3,496,524,000.00 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 4,958,556,800.00 | 3,496,524,000.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 8,000,000.00 | 1,360,600,000.00 |
| 应收证券清算款 | 842.05 | 70,106,582.55 |
| 应收利息 | 104,669,099.32 | 44,494,231.48 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 5,072,205,381.69 | 5,046,889,361.56 |
| **负债和所有者权益** | **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 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 1,243,245.54 | 1,280,120.46 |
| 应付托管费 | 414,415.19 | 426,706.81 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | - | 16,237.50 |
| 应交税费 | 386,104.03 | 128,536.79 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 152,285.91 | 46,488.96 |
| 负债合计 | 2,196,050.67 | 1,898,090.52 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 5,009,999,000.00 | 5,009,999,000.00 |
| 未分配利润 | 60,010,331.02 | 34,992,271.04 |
| 所有者权益合计 | 5,070,009,331.02 | 5,044,991,271.04 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,072,205,381.69 | 5,046,889,361.56 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0120元,基金份额总额5,009,999,000.00份。

### 6.2 利润表

会计主体:国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
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 |
|---|---|
| 一、收入 | 87,985,753.46 |
| 1.利息收入 | 95,384,932.51 |
| 其中:存款利息收入 | 142,115.61 |
| 债券利息收入 | 93,861,747.53 |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 1,381,069.37 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | - |
| 其中:股票投资收益 | - |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | - |
| 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) | -7,399,179.05 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | - |
| 减:二、费用 | 10,362,703.98 |
| 1. 管理人报酬 | 7,499,057.41 |
| 2. 托管费 | 2,499,685.80 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 7,150.98 |
| 5. 利息支出 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - |
| 6. 税金及附加 | 233,741.18 |
| 7. 其他费用 | 123,068.61 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 77,623,049.48 |
| 减:所得税费用 | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 77,623,049.48 |

注:本基金于2018年11月14日成立。截至报告期末,本基金成立未满1年,无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
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) | 5,009,999,000.00 | 34,992,271.04 | 5,044,991,271.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 77,623,049.48 | 77,623,049.48 |
| 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) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | - | -52,604,989.50 | -52,604,989.50 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 5,009,999,000.00 | 60,010,331.02 | 5,070,009,331.02 |

注:本基金于2018年11月14日成立,截至报告期末,本基金成立未满1年,无上年度可比期间数据。

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:

基金管理人负责人:孟朝霞,主管会计工作负责人:李柯,会计机构负责人:仲晓峰

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

国联安增富一年定期开放纯债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[2018]1485号《关于准予国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由国联安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《国联安增富一年定期开放纯债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5,009,999,000.00元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第1800307号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年11月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,009,999,000.00份,无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分不少于10,000,000.00份基金份额,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《国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即本基金以封闭运作和开放运作交替循环的方式运作。本基金以1年为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。在每个运作周期结束后进入自由开放期。在开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且不超过20个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准,具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安增富一年定期开放纯债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,包括国债、政府机构债券、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款)、同业存单、货币市场工具、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相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外),可交换债券。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;为保护基金份额持有人利益,开放期开始前1个月、开放期以及开放期结束后1个月,本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制;开放期内,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,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但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;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:中债综合指数收益率。

#### 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》、《国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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2018年11月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的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2018年11月14日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年11月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的·分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

##### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易日最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

##### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

##### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

##### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

##### 6.4.4.9 收入/(损失