

# 国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保尊盛双债债券	
基金主代码	008740	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 18 日	
报告期末基金份额总额	48,865,722.64 份	
投资目标	本基金以信用债和可转债为主要投资对象，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，判断证券市场对上述变量和政策的反应，并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整。	
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率×80%+中证可转换债券指数收益率×20%	
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。	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保尊盛双债债券 A	国寿安保尊盛双债债券 C

下属分级基金的交易代码	008740	008741
报告期末下属分级基金的份额总额	42,634,779.26 份	6,230,943.38 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）	
	国寿安保尊盛双债债券 A	国寿安保尊盛双债债券 C
1. 本期已实现收益	405,189.47	50,584.75
2. 本期利润	931,457.33	121,624.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0224	0.0210
4. 期末基金资产净值	46,162,283.62	6,697,907.68
5. 期末基金份额净值	1.0827	1.0749

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

国寿安保尊盛双债债券 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.11%	0.11%	1.88%	0.11%	0.23%	0.00%
过去六个月	4.45%	0.15%	3.85%	0.13%	0.60%	0.02%
过去一年	6.28%	0.14%	5.25%	0.12%	1.03%	0.02%
自基金合同生效起至今	8.27%	0.14%	5.12%	0.13%	3.15%	0.01%

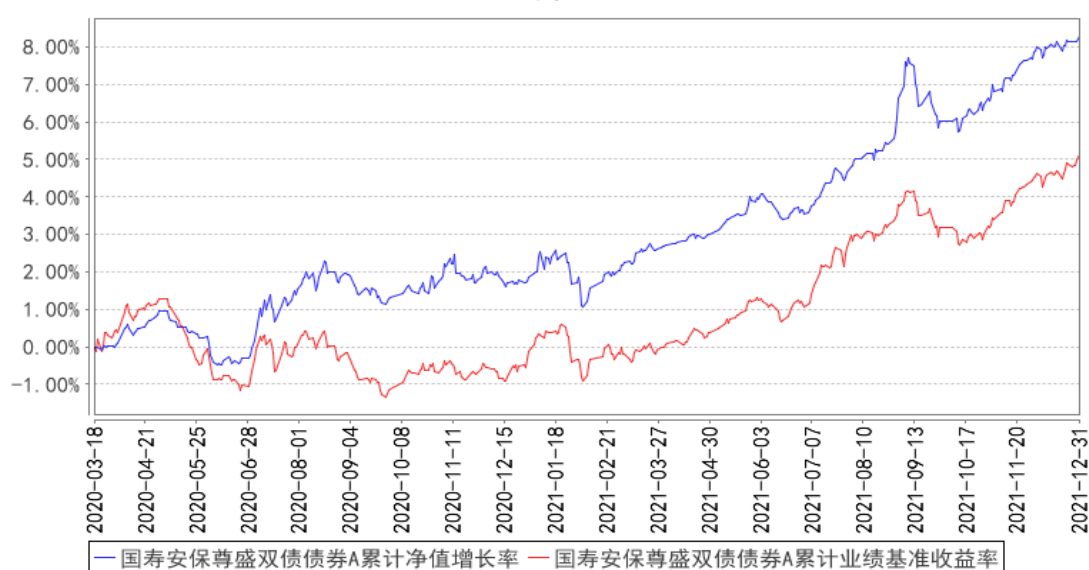
国寿安保尊盛双债债券 C

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	2.01%	0.11%	1.88%	0.11%	0.13%	0.00%
过去六个月	4.24%	0.15%	3.85%	0.13%	0.39%	0.02%
过去一年	5.86%	0.14%	5.25%	0.12%	0.61%	0.02%
自基金合同生效起至今	7.49%	0.14%	5.12%	0.13%	2.37%	0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国寿安保尊盛双债债券A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



国寿安保尊盛双债债券C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 2020 年 03 月 18 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 2020 年 03 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴闻	基金经理	2020 年 3 月 18 日	-	13 年	吴闻先生，硕士。曾任中信证券股份有限公司债务资本市场部高级经理，固定收益部副总裁，2014 年 9 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保灵活优选混合型证券投资基金、国寿安保稳荣混合型证券投资基金、国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金、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、国寿安保稳吉混合型证券投资基金、国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金及国寿安保稳盛 6 个月持有期混合型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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，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 公平交易专项说明

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度，海外新冠疫情存在反复，美国经济延续复苏态势、通胀处于高位，美联储货币政策态度转鹰。中国经济虽然受益于较高的出口增长和制造业投资增长，但房地产行业信用风险在四季度加速暴露，对地产产业链预期形成较大的负面影响，地产销售、投资、土地购置均表现低迷，基建投资和居民消费也表现偏弱，经济下行压力持续加大。价格方面，煤、钢等前期受供给因素影响大幅上涨的大宗商品价格在四季度显著回落，PPI 呈现高位筑顶回落走势，CPI 低位小幅回升。

政策方面，四季度央行延续了稳健灵活适度的货币政策基调，货币市场利率维持平稳，12 月实施全面降准，1 年期 LPR 利率也出现下调。12 月召开的中央经济工作会议高度强调稳增长的重要性，市场预期货币政策有望进一步宽松，积极财政政策的实施节奏也将提前。

债券市场方面，10 月中上旬受降准预期落空、大宗商品价格上涨影响债市明显回调，此后商品价格回落、基本面持续走弱、货币政策宽松预期升温等因素推动债市收益率大幅下行。信用债方面，在房地产行业信用事件不断出现的影响下，高收益债券信用利差继续扩大，投资需求往高等级债券集中。可转债方面，四季度受宽松预期和股市结构性行情推动，可转债指数继续上涨。

投资运作方面，本基金在报告期内以高等级、中短久期信用债为主要配置品种，不投资低等级信用债，转债持仓兼顾正股低估值和高景气品种，利率债持仓比例较低。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保尊盛双债债券 A 基金份额净值为 1.0827 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.11%；截至本报告期末国寿安保尊盛双债债券 C 基金份额净值为 1.0749 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.01%；业绩比较基准收益率为 1.88%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金自 2021 年 11 月 08 日至 2021 年 12 月 10 日存在连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	50,406,679.38	87.47
	其中：债券	50,406,679.38	87.47
	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	6,528,236.38	11.33
8	其他资产	689,571.25	1.20
9	合计	57,624,487.01	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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。

#### 5.2.2 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持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,000,300.00	1.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	26,841,404.50	50.78
	其中：政策性金融债	2,210,464.30	4.18

4	企业债券	50,450.00	0.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,114,400.00	15.35
7	可转债（可交换债）	14,400,124.88	27.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,406,679.38	95.36

#### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	102100611	21 华侨城 MTN001	40,000	4,082,400.00	7.72
2	175463	20 国君 G7	40,000	4,082,000.00	7.72
3	102101322	21 东方电气 MTN002	40,000	4,032,000.00	7.63
4	175741	21 海通 02	30,000	3,058,800.00	5.79
5	149274	20 申证 10	30,000	3,046,800.00	5.76

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 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。

#### 5.10 投资组合报告附注

##### 5.10.1 本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

海通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到证监会分局的处罚；招商证券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。

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。



### 5.10.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	846.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	688,724.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	689,571.25

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132015	18 中油 EB	2,078,600.00	3.93
2	113021	中信转债	2,018,159.60	3.82
3	110059	浦发转债	1,899,587.00	3.59
4	113009	广汽转债	1,135,579.60	2.15
5	123111	东财转 3	884,626.80	1.67
6	127018	本钢转债	794,102.40	1.50
7	123107	温氏转债	684,348.60	1.29
8	113048	晶科转债	586,995.60	1.11
9	132018	G 三峡 EB1	581,984.00	1.10
10	128132	交建转债	555,948.02	1.05
11	128107	交科转债	522,977.28	0.99
12	113024	核建转债	504,996.30	0.96
13	111000	起帆转债	411,328.40	0.78
14	113026	核能转债	388,305.20	0.73
15	113516	苏农转债	333,144.00	0.63
16	127032	苏行转债	207,049.48	0.39
17	113043	财通转债	21,868.20	0.04
18	113050	南银转债	17,748.00	0.03
19	132008	17 山高 EB	4,227.20	0.01

### 5.10.5 报告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持有股票。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保尊盛双债债券 A	国寿安保尊盛双债债券 C
报告期期初基金份额总额	44,413,614.70	5,758,962.26
报告期期间基金总申购份额	13,978,505.16	2,615,798.03
减：报告期期间基金总赎回份额	15,757,340.60	2,143,816.91
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	42,634,779.26	6,230,943.38

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人本报告期内未投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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	20211105~20211212	9,902,150.00	-	9,902,150.00	-	-
	2	20211220~20211229	-	9,260,048.16	-	9,260,048.16	18.95
	3	20211001~20211231	12,378,041.83	-	-	12,378,041.83	25.33
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>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金募集的文件
- 9.1.2 《国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 9.1.5 报告期内国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 9.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 9.2 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

### 9.3 查阅方式

- 9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)
- 9.3.3 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

2022 年 1 月 24 日