

国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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 10 月 25 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 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	5,517,335.59 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	3,413,169.60 份	2,104,165.99 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 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	79,941.53	-10,129.01
2. 本期利润	26,117.04	-9,850.06
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0011	-0.0026
4. 期末基金资产净值	3,645,917.10	2,224,944.09
5. 期末基金份额净值	1.0682	1.0574

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	-1.13%	0.16%	-0.19%	0.11%	-0.94%	0.05%
过去六个月	-0.34%	0.12%	0.99%	0.11%	-1.33%	0.01%
过去一年	0.75%	0.12%	1.21%	0.14%	-0.46%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.82%	0.14%	4.44%	0.14%	2.38%	0.00%

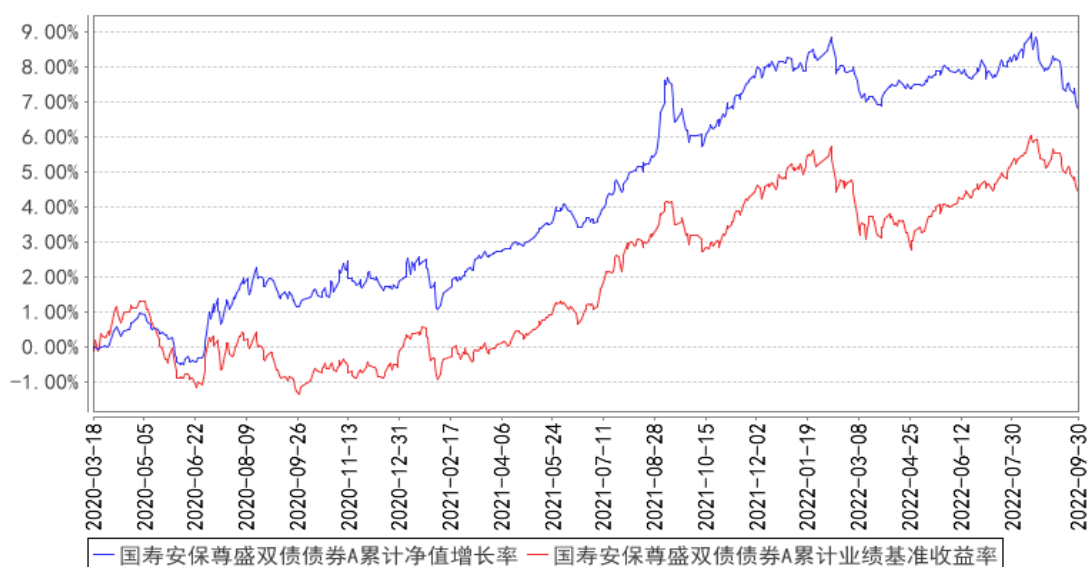
国寿安保尊盛双债债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

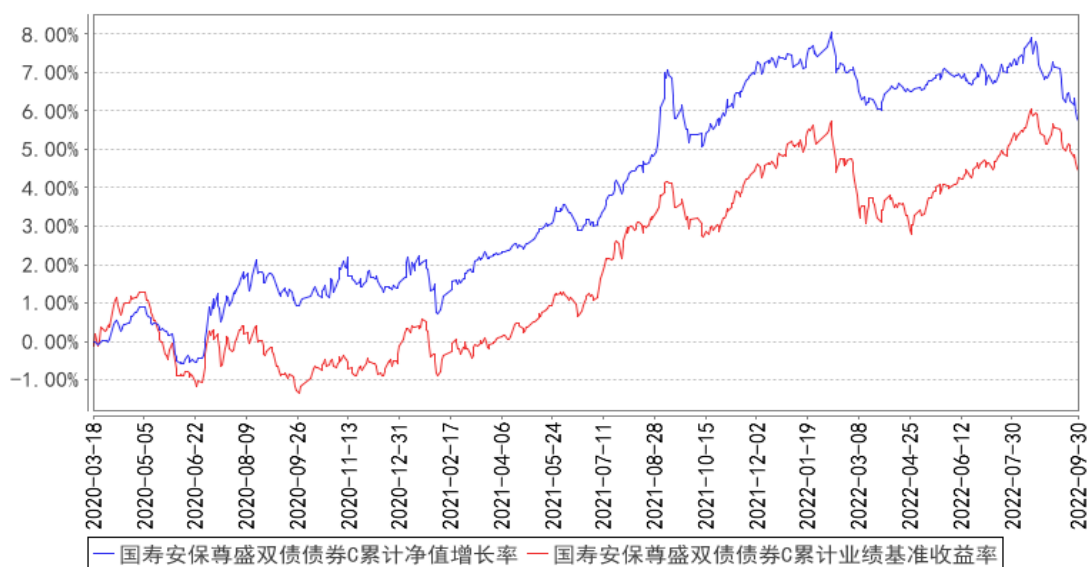
过去三个月	-1.23%	0.16%	-0.19%	0.11%	-1.04%	0.05%
过去六个月	-0.54%	0.12%	0.99%	0.11%	-1.53%	0.01%
过去一年	0.35%	0.12%	1.21%	0.14%	-0.86%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.74%	0.14%	4.44%	0.14%	1.30%	0.00%

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 2022 年 09 月 30 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	-	14 年	基金经理，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所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

2022 年三季度，海外通胀居高不下，美联储、欧央行大幅加息并维持鹰派基调，10 年美国国债收益率从 3.0% 攀升至 3.8% 附近，美元指数持续走强。受央行收紧货币和地缘政治风险增大影响，发达经济体衰退风险逐步增加，全球股票指数多数下跌。中国经济三季度运行在主动去库存阶段，虽汽车销量增速维持高位、基建投资增速明显回升，但出口增速高位回落，房地产销售、投资持续下滑，经济企稳态势相对偏弱。物价方面，PPI 呈现持续回落走势，CPI 维持在温和区间，核心通胀低位运行。

政策方面，为应对疫情反复和地产下行对经济的负面影响，三季度政策性金融支持力度进一步增大，房地产相关政策也在继续放松，央行于 8 月下调政策利率，货币市场利率低位运行。

债市方面，在经济恢复不及预期、物价温和、公开市场利率下降的环境下，三季度债券市场利率整体小幅下行，高等级信用债的信用利差位于低位，房地产行业债券信用风险继续暴露，投资需求以高等级债券为主。转债市场三季度走势较弱，中证转债指数下跌 3.8%。

投资运作方面，基金在报告期内以高等级信用债和估值相对合理的转债为主要持仓，阶段性参与长久期利率债交易，并保持组合高流动性。

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 1.0682 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.13%；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 1.0574 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.23%；业绩比较基准收益率为-0.19%。

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 2022 年 7 月 5 日至 2022 年 9 月 30 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	5,132,485.85	78.00
	其中：债券	5,132,485.85	78.00
	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	1,241,334.55	18.87
8	其他资产	206,135.79	3.13
9	合计	6,579,956.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	311,393.98	5.30
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,316,382.93	22.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,504,708.94	59.70
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,132,485.85	87.42

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	110059	浦发转债	5,250	564,643.97	9.62
2	132015	18 中油 EB	5,000	527,462.88	8.98
3	163225	20 宝钢 01	5,000	508,606.71	8.66
4	163453	20 中化 01	5,000	505,321.26	8.61
5	113021	中信转债	4,390	484,847.72	8.26

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，安徽海螺水泥股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国石油天然气集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚；宝山钢铁股份有限公司、中信银行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；宝山钢铁股份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；江苏银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信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；江苏银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信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；上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚；中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚；中信

银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到综合行政执法局的处罚。

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

本基金本报告期末未持有股票。。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,925.16
2	应收证券清算款	202,210.63
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	206,135.79

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	110059	浦发转债	564,643.97	9.62
2	132015	18 中油 EB	527,462.88	8.98
3	113021	中信转债	484,847.72	8.26
4	113050	南银转债	444,683.33	7.57
5	110053	苏银转债	348,983.40	5.94
6	132018	G 三峡 EB1	285,683.56	4.87
7	110075	南航转债	269,795.45	4.60
8	113053	隆 22 转债	185,126.88	3.15
9	110085	通 22 转债	127,896.00	2.18

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	41,411,123.62	5,448,413.63
报告期期间基金总申购份额	3,097.44	3,926.22
减：报告期期间基金总赎回份额	38,001,051.46	3,348,173.86
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	3,413,169.60	2,104,165.99

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本报告期内未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金交易本基金。

§ 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	20220705~20220921	9,260,048.16	-	9,260,048.16	-	-
	2	20220822	4,643,752.90	-	4,643,752.90	-	-
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

2022 年 8 月 29 日，本基金管理人发布了《国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，就

关于终止国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金合同有关事项进行表决。公告称，在 2022 年 8 月 31 日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决，投票表决时间自 2022 年 9 月 1 日起至 2022 年 10 月 10 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会于 2022 年 10 月 11 日表决通过了《关于终止国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起正式生效。自 2022 年 10 月 12 日起，本基金进入财产清算期。

§ 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
- 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 10 月 26 日