

国寿安保智慧生活股票型证券投资基金  
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	国寿安保智慧生活股票
基金主代码	001672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 1 日
报告期末基金份额总额	240,709,263.30 份
投资目标	本基金在深入研究的基础上，自下而上精选开拓和建设智慧生活的上市公司，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	在大类资产配置上，在具备足够多本基金所定义的投资标的时，优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票投资策略外，本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。在债券类资产的投资上，将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 X80%+中债综合指数收益率（全价）X20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中的高风险/高收益品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

## § 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）
1. 本期已实现收益	-3,579,359.97
2. 本期利润	-46,202,416.57
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2060
4. 期末基金资产净值	425,628,040.40
5. 期末基金份额净值	1.768

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。

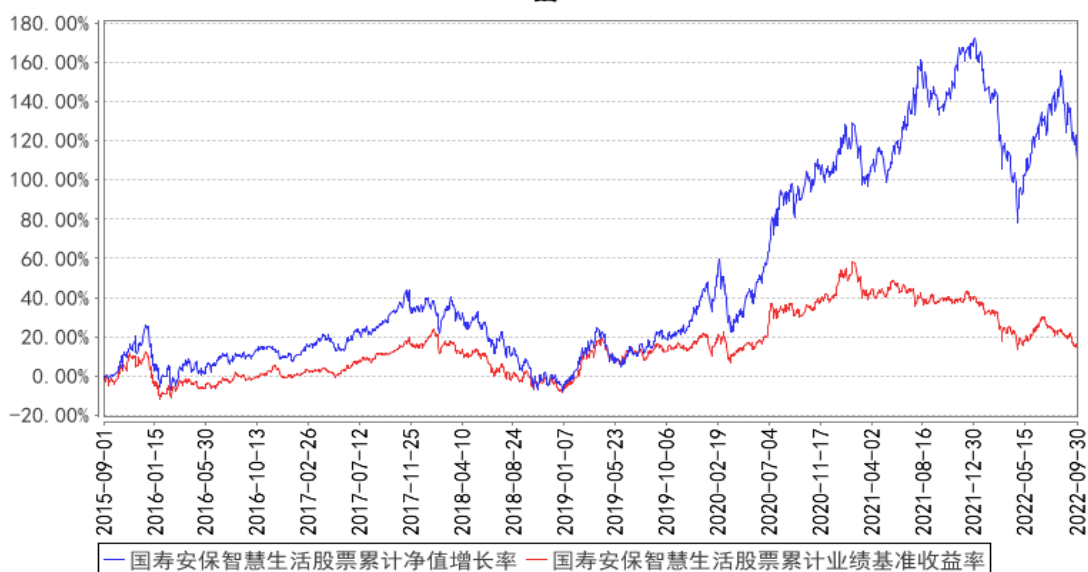
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	-9.33%	1.66%	-12.16%	0.71%	2.83%	0.95%
过去六个月	-1.39%	1.73%	-7.68%	0.95%	6.29%	0.78%
过去一年	-11.38%	1.51%	-17.36%	0.94%	5.98%	0.57%
过去三年	75.44%	1.55%	1.52%	1.01%	73.92%	0.54%
过去五年	59.85%	1.50%	2.61%	1.02%	57.24%	0.48%
自基金合同 生效起至今	109.67%	1.45%	14.21%	1.02%	95.46%	0.43%

#### 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

国寿安保智慧生活股票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 2015 年 09 月 01 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 2015 年 09 月 01 日至 2022 年 09 月 30 日。

## § 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		
张琦	股票投资总监、股票投资部总监及基金经理	2015 年 9 月 23 日	-	17 年	金融学硕士，2005 年 1 月至 2015 年 5 月，任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理等职，2015 年 6 月加入国寿安保基金管理有限公司，现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监，国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保目标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保消费新蓝海灵活配置混合型证券投资基金和国寿安保高股息混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。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》、《国寿安保智慧生活股票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，从海外来看，俄乌冲突持续加剧，欧洲面临的能源危机深化，对其制造业造成了显著影响，欧洲经济与金融面临的挑战日益严峻；美联储三季度两次加息计 150 个基点以抑制通胀，美债收益率的高企与美元指数的强势上涨对非美经济体的货币与金融产生了直接冲击。从国内情况来看，疫情持续反复以及库存周期的下行，造成了经济下行压力加大，决策层针对房地产市场出台了一系列稳定措施，尽管 PMI 指数与金融数据都有所好转，但资本市场信心和预期过度趋于悲观。

报告期内，国内 A 股市场结束了之前的反弹趋势，上证指数下跌 11.01%，科创 50 指数下跌 15.04%，沪深 300 指数下跌 15.16%，创业板指数下跌 18.56%。行业指数表现上，仅煤炭行业微涨 0.97%，综合、公用事业、石油石化等少数行业跌幅在 5% 以内，而建筑材料、电力设备、电子、汽车、传媒等行业表现落后。

报告期内，本基金维持了中高权益仓位，在行业选择和风格特征上，延续了之前偏向科技制造与泛消费的总体配置思路。考虑到市场的变化，相较于上一报告期，减持了轻工、食品饮料、医药等行业，适当增加了性价比相对较高的机械、电子、新能

源等科技制造行业的配置比例，行业集中度有进一步提升。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.768 元；本报告期基金份额净值增长率为 -9.33%，业绩比较基准收益率为 -12.16%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 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	367,041,567.63	80.39
	其中：股票	367,041,567.63	80.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,550,081.53	0.34
	其中：债券	1,550,081.53	0.34
	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	30,000,000.00	6.57
	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	57,950,021.32	12.69
8	其他资产	42,927.08	0.01
9	合计	456,584,597.56	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	356,674,835.83	83.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,060.89	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,028.26	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	399,782.88	0.09
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,849,279.89	2.31
N	水利、环境和公共设施管理业	36,697.28	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,882.60	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	367,041,567.63	86.24

### 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投资港股通股票。

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603348	文灿股份	240,000	17,133,600.00	4.03
2	002056	横店东磁	800,000	15,832,000.00	3.72
3	600933	爱柯迪	869,994	15,816,490.92	3.72
4	300990	同飞股份	165,740	15,279,570.60	3.59
5	002409	雅克科技	230,000	14,142,700.00	3.32
6	605222	起帆电缆	600,000	12,750,000.00	3.00
7	002254	泰和新材	769,966	12,565,845.12	2.95
8	002484	江海股份	520,000	12,563,200.00	2.95
9	603966	法兰泰克	1,099,900	12,131,897.00	2.85
10	300421	力星股份	900,000	11,988,000.00	2.82

### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,550,081.53	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,550,081.53	0.36

### 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	110090	爱迪转债	15,500	1,550,081.53	0.36

#### 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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1 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，法兰泰克重工股份有限公司、江苏力星通用钢球股份有限公司、上海起帆电缆股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境部的处罚；江苏力星通用钢球股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚；江苏力星通用钢球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。

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。

##### 5.11.2 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

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。

##### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------



1	存出保证金	28,925.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,001.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,927.08

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 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流通受限的股票。

#### 5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	203,771,294.33
报告期期间基金总申购份额	42,695,714.04
减：报告期期间基金总赎回份额	5,757,745.07
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	240,709,263.30

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	1	20220701~20220930	52,282,635.52	-	-	52,282,635.52	21.72

构	2	20220701~20220930	89,806,466.10	-	-	-89,806,466.10	37.31
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智慧生活股票型证券投资基金募集的文件
- 9.1.2 《国寿安保智慧生活股票型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《国寿安保智慧生活股票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 报告期内国寿安保智慧生活股票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.gsfoods.com.cn](http://www.gsfoods.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