

国寿安保尊弘短债债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保尊弘短债债券
基金主代码	011008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 30 日
报告期末基金份额总额	274,454,305.31 份
投资目标	本基金主要通过重点投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动投资策略，主要包括：类属资产配置策略、利率预期策略、利率品种投资策略、信用债投资策略、分散投资策略、回购套利策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略等投资管理手段，对债券市场及债券收益率曲线的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债-综合财富（1 年以下）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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	国寿安保尊弘短债债券 A	国寿安保尊弘短债债券 C	国寿安保尊弘短债债券 E
下属分级基金的交易代码	011008	011009	011010
报告期末下属分级基金的份额总额	271,509,331.72 份	2,944,853.45 份	120.14 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）		
	国寿安保尊弘短债债券 A	国寿安保尊弘短债债券 C	国寿安保尊弘短债债券 E
1. 本期已实现收益	1,973,664.69	19,163.62	0.85
2. 本期利润	2,057,729.99	20,075.94	0.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0076	0.0068	0.0073
4. 期末基金资产净值	273,571,850.22	2,964,981.33	121.02
5. 期末基金份额净值	1.0076	1.0068	1.0073

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

国寿安保尊弘短债债券 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	0.76%	0.01%	0.68%	0.01%	0.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.76%	0.01%	0.69%	0.01%	0.07%	0.00%

国寿安保尊弘短债债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	-----------	--------	--------	-----	-----

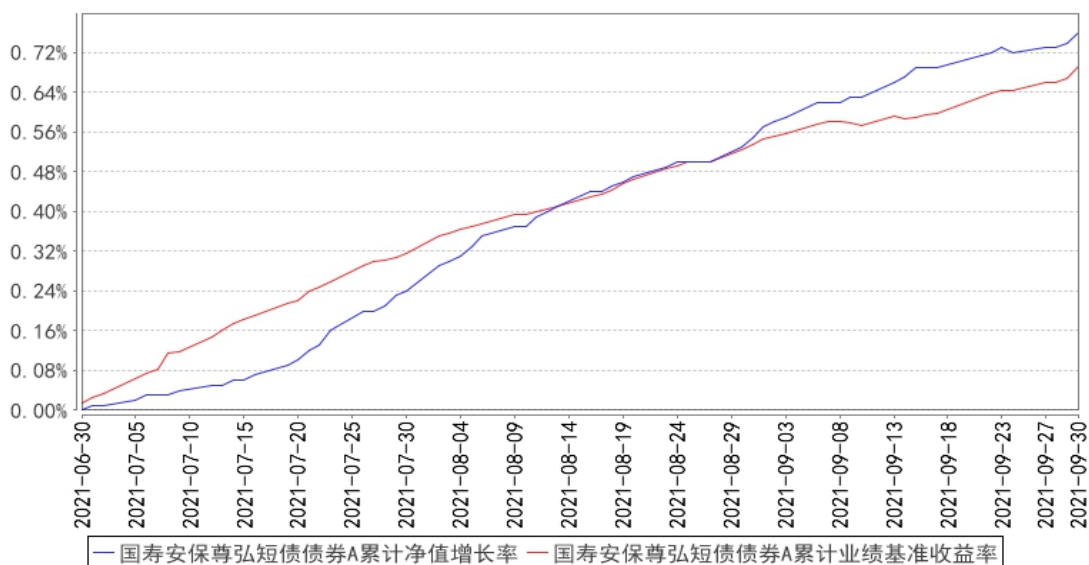
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	0.68%	0.01%	0.68%	0.01%	0.00%	0.00%
自基金合同 生效起至今	0.68%	0.01%	0.69%	0.01%	-0.01%	0.00%

国寿安保尊弘短债债券 E

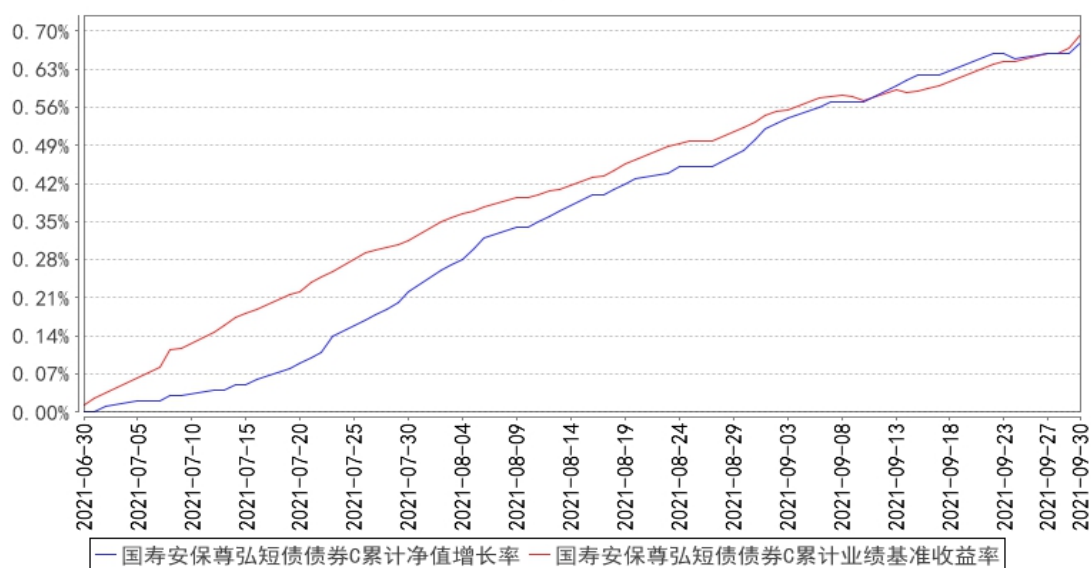
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.73%	0.01%	0.68%	0.01%	0.05%	0.00%
自基金合同 生效起至今	0.73%	0.01%	0.69%	0.01%	0.04%	0.00%

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

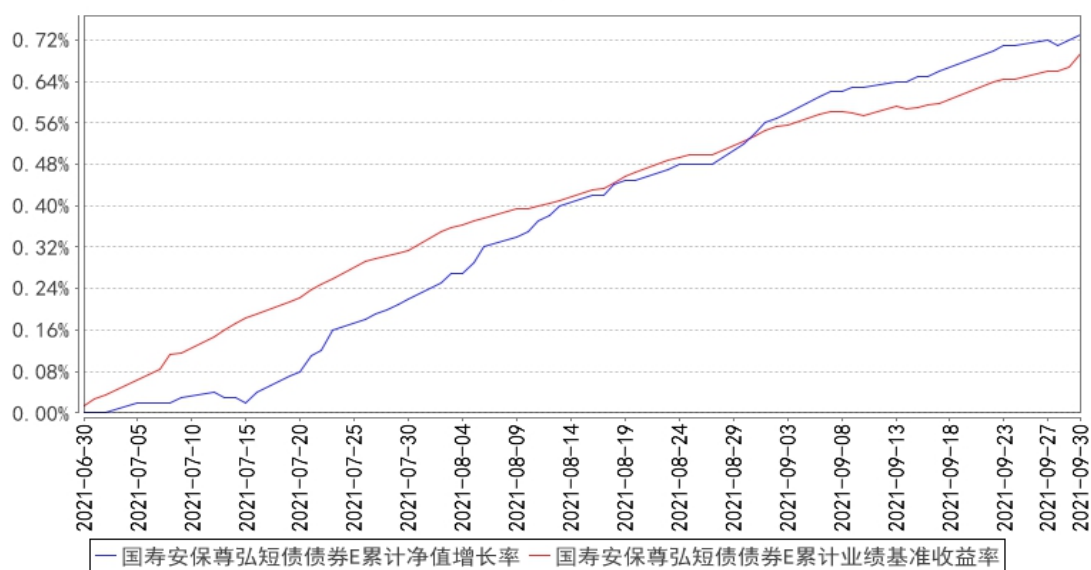
国寿安保尊弘短债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国寿安保尊弘短债债券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



国寿安保尊弘短债债券E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 2021 年 06 月 30 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约定。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。图示日期为 2021 年 06 月 30 日至 2021 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		
桑迎	本基金的基金经理	2021年6月30日	-	19年	硕士研究生。2002年7月至2003年8月，任职于交通银行北京分行，担任交易员；2004年11月至2008年1月，任职于华夏银行总行资金部，担任交易员；2008年2月至2013年12月，任职于嘉实基金，历任交易员、基金经理。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司，现任国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金、国寿安保货币市场基金和国寿安保尊弘短债债券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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保尊弘短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

2021 年三季度国内宏观经济整体走势平稳，但受到疫情反复和房地产信用事件等影响部分经济数据出现走弱迹象。在这样的背景下央行在货币政策执行中更偏向维护经济稳定，使用降准等政策工具适度投放资金增加对实体经济的支持。在巨量资金投放的同时，央行也注意维持市场利率体系的平稳。整个季度看，隔夜回购均价 2.06%，7 天回购均价 2.27%，货币市场关键性的资金指标基本稳定在央行政策利率周围上下波动。货币市场短期债券方面，受到资金利率稳定的影响高等级存单收益率季度内保持稳定。3 个月期 AAA 级别存单收益率收益稳定在 2.3-2.5% 区间，1 年期 AAA 级别存单收益率则在 2.65-2.8% 区间内。信用债券方面，受到经济向好以及流动性充裕等因素的影响信用债券出现较大修复行情。特别是一些地方国有企业，二级市场成交收益率从大幅度高于估值直至回落至估值水平以下，一级市场发行也逐步恢复。总体而言，2021 年三季度是流动性较为充裕货币市场平稳运行的一段时期。

三季度，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，结合本基金的客户现金流特点，以确保组合流动性、安全性为首要任务；灵活配置信用债券投资和利率债券投资，努力管理收益回撤，保障组合充足流动性。本基金成功应对了市场和规模的波动，投资业绩平稳，实现了均衡安全性、流动性和收益性的目标，组合的持仓结构、流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

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弘短债债券 A 基金份额净值为 1.0076 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.76%；截至本报告期末国寿安保尊弘短债债券 C 基金份额净值为 1.0068 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.68%；截至本报告期末国寿安保尊弘短债债券 E 基金份额净值为 1.0073 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.73%；业绩比较基准收益率为 0.68%。

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	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	251,029,000.00	90.72
	其中：债券	251,029,000.00	90.72
	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	19,060,228.59	6.89
	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	3,905,480.67	1.41
8	其他资产	2,726,464.91	0.99
9	合计	276,721,174.17	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投资股票。

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	19,912,000.00	7.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,032,000.00	7.24
	其中：政策性金融债	20,032,000.00	7.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,236,000.00	29.01
6	中期票据	130,849,000.00	47.32
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	251,029,000.00	90.78

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	101754046	17 华电股 MTN001	200,000	20,320,000.00	7.35
2	101754036	17 中航工 MTN001	200,000	20,300,000.00	7.34
3	101900756	19 中电投 MTN010A	200,000	20,176,000.00	7.30
4	101900895	19 中石油 MTN004	200,000	20,142,000.00	7.28
5	012102546	21 云能投 SCP005	200,000	20,092,000.00	7.27

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

本基金本报告期末投资持有国债期货。

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

报告期内基金投资的前十名证券除“21 云能投 SCP005”（债券代码：012102546）的发行主体云南省能源投资集团有限公司外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。

云南省能源投资集团有限公司于 2021 年 4 月 29 日发布公告称，云南省能源投资集团有限公司子公司云南能投威信煤炭有限公司（以下简称“能投威信”）收到云南煤矿安全监察局昭通监察分局于 2021 年 3 月 29 日出具的国家煤矿安全监察行政处罚告知书（云煤安监昭告(2021)26009 号），能投威信因违反了《国务院关于预防煤炭生产安全事故的特别规定》第八条第（十五）项、《煤矿重大事故隐患判定标准》第十八条第（五）项、《煤矿安全规程》第六百七十九条第一款、《煤矿安全规程》第二百七十三条、《中华人民共和国安全生产法》第三十二条、《煤矿安全规程》第四百六十一条第一款的规定。云南煤矿安全监察局昭通监察分局对能投威信作出暂扣能投威信观音山煤矿一井安全生产许可证（证号：（滇）MK 安许证字[20190015]）、责令停产整

顿 30 日，对能投威信给予警告，并处罚款一百八十壹万贰仟元整（¥1,812,000.00）的行政处罚。

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投资股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,726,464.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,726,464.91

5.10.4 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。

5.10.5 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存在流通受限情况的股票。

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	国寿安保尊弘短 债债券 A	国寿安保尊弘短 债债券 C	国寿安保尊弘 短债债券 E
报告期期初基金份额总额	271,509,331.72	2,944,853.45	120.14
报告期期间基金总申购份额	-	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	-
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	271,509,331.72	2,944,853.45	120.14

§ 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

本基金基金管理人本报告期末持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 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

无。

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弘短债债券型证券投资基金募集的文件

9.1.2 《国寿安保尊弘短债债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3 《国寿安保尊弘短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弘短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

2021 年 10 月 27 日