

国寿安保尊裕优化回报债券型
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 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

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期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 2024 年 08 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 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	39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
7.8 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贵金属投资明细	40
7.9 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	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
11.1 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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金	
基金简称	国寿安保尊裕优化回报债券	
基金主代码	004318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 23 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	
报告期末基金份额总额	410,093,098.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
下属分级基金的交易代码	004318	004319
报告期末下属分级基金的份 额总额	409,723,440.85 份	369,657.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过主要投资于债券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，并适时配置权益资产，并通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。
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，通过主动管理投资策略，在主要配置债券资产的前提下，适当配置权益类资产，达到增强收益的目的。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债综合（全价）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种。从预期风险收益方面看，本基金的预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

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	国寿安保基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4009-258-258	021-60637228
传真	010-50850776	021-60635778
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院 盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	100033	100033
法定代表人	于泳	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

§ 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
本期已实现收益	3,671,916.50	-14,392.46
本期利润	4,401,762.78	-339,534.22
加权平均基金份额本期利润	0.0096	-0.3170
本期加权平均净值利润率	0.94%	-31.59%
本期基金份额净值增长率	0.68%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,240,168.36	-3,714.76
期末可供分配基金份额利润	0.0055	-0.0100
期末基金资产净值	421,913,311.62	375,032.84
期末基金份额净值	1.030	1.015
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	14.38%	11.08%

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

国寿安保尊裕优化回报债券 A

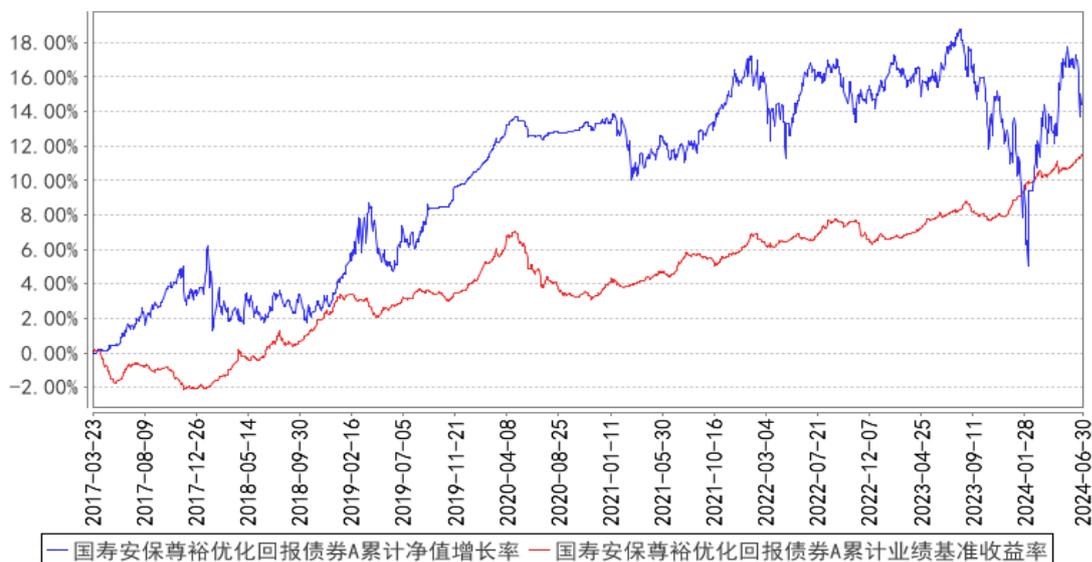
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.28%	0.49%	0.65%	0.03%	-2.93%	0.46%
过去三个月	1.48%	0.50%	1.06%	0.07%	0.42%	0.43%
过去六个月	0.68%	0.58%	2.42%	0.07%	-1.74%	0.51%
过去一年	-2.37%	0.49%	3.27%	0.06%	-5.64%	0.43%
过去三年	2.39%	0.36%	6.58%	0.05%	-4.19%	0.31%
自基金合同生效起至今	14.38%	0.28%	11.51%	0.06%	2.87%	0.22%

国寿安保尊裕优化回报债券 C

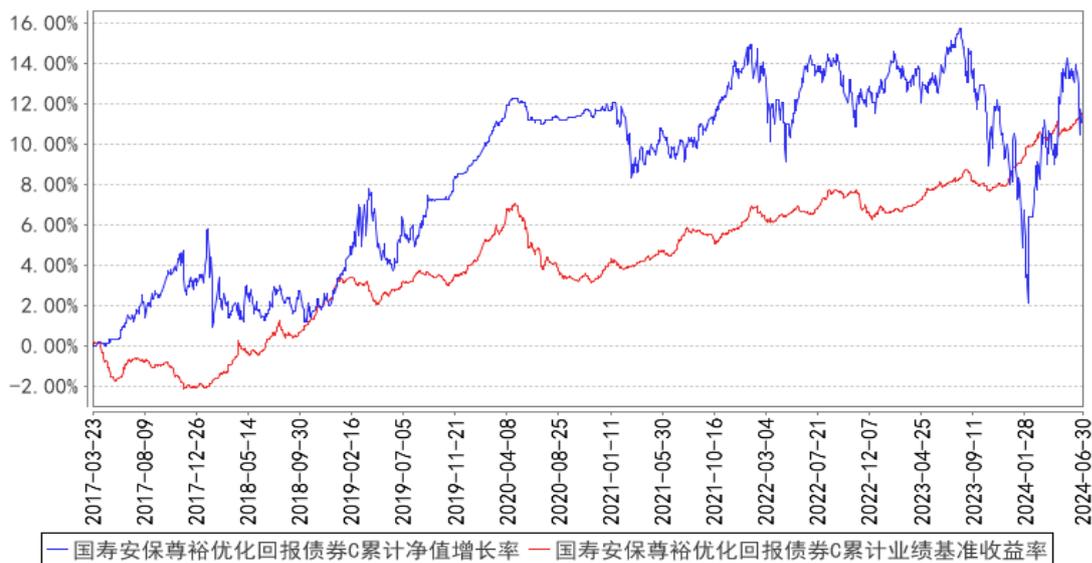
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.31%	0.50%	0.65%	0.03%	-2.96%	0.47%
过去三个月	1.40%	0.51%	1.06%	0.07%	0.34%	0.44%
过去六个月	0.50%	0.59%	2.42%	0.07%	-1.92%	0.52%
过去一年	-2.78%	0.49%	3.27%	0.06%	-6.05%	0.43%
过去三年	1.20%	0.35%	6.58%	0.05%	-5.38%	0.30%
自基金合同生效起至今	11.08%	0.28%	11.51%	0.06%	-0.43%	0.22%

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

国寿安保尊裕优化回报债券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



国寿安保尊裕优化回报债券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 2017 年 03 月 23 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 2017 年 03 月 23 日至 2024 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可(2013)1308号文核准,于2013年10月29日设立,公司注册资本12.88亿元人民币,公司股东为中国人寿资产管理有限公司,其持有股份85.03%,National Mutual Funds Management Ltd. (国家共同基金管理有限公司),其持有股份14.97%。

截至2024年6月30日,公司共管理102只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划,公司管理资产总规模为3790.84亿元,其中公募证券投资基金管理规模为3101.27亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
陶尹斌	基金经理	2019年9月9日	-	11年	硕士研究生,曾任中国人寿资产管理有限公司研究员,兴全基金管理有限公司研究员、投资经理助理、投资经理,现任国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金、国寿安保中债1-3年国开行债券指数型证券投资基金、国寿安保泰恒纯债债券型证券投资基金、国寿安保泰弘纯债债券型证券投资基金、国寿安保泰瑞纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保泰祥纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保泰悦3个月滚动持有债券型证券投资基金和国寿安保泰裕债券型证券投资基金基金经理。
冒浩	本基金的基金经理	2022年3月29日	-	16年	硕士,曾任UBS伦敦分析师,国联安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理,西南证券股份有限公司权益投资负责人。现任国寿安保基金管理有限公司基金经理。2022年3月起担任国寿安保尊裕优化回报债券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

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，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 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

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，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。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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 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

2024年上半年债券收益率曲线整体下移，市场行情主要可分为三个区间。一是出于降准降息的博弈，机构自跨年后抢跑配置，以央行宣布降准和春节后LPR调降为核心催化，同时多家全国性银行下调存款利率，10年及30年国债收益率分别下破2.3%和2.5%的整数关口。二是3-4月里投资者担忧资金防空转仍为监管重心，且央行多次表态对于长端收益率风险的关注，致使交投预期边际摇摆、利率出现短暂的快速上修，但在禁止手工补息的影响下，银行存款持续迁向非银机构，债券配置需求得到增厚，波动之中债券市场展露韧性。三是5月往后市场逐步消纳利率债供给的担忧，债市多头借由基本面数据的回落以及资金面的持续宽裕重新占据主导，曲线进一步走平，超

长债收益率再次向下脱离2.5%的政策利率。

权益方面，2024年伊始A股市场整体延续上年末的负反馈，且呈现出一定的流动性危机，中小盘及成长品种下跌尤为显著。进入2月后政策持续发力，汇金宣布扩大ETF增持以及证监会加强融券业务监管，紧接3月两会召开、多部门相继表态更多的稳增长措施，市场预期企稳，指数快速上修后震荡盘整。5月往后基本面数据有所趋弱，权益市场迎来调整，同时退市新规虽然利好远期上市公司整体质量，但短期不可避免地压制小盘股表现，使得大盘品种表现更优，沪深300较中证1000超额收益显著。从板块来看，“类债”的投资思路得到更多认可，银行、能源、交运等行业涨幅更佳，价值与成长风格的定价差异收敛显著。

报告期内，本基金出于宏观预期、中期赔率以及市场结构的考量在股债两端均采取了较为积极的策略部署，在含权仓位中更多通过板块轮动的捕捉来获得相对收益，在债券部分则延续了中长利率品种的持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保尊裕优化回报债券A基金份额净值为1.030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裕优化回报债券C基金份额净值为1.015元，本报告期基金份额净值增长率为0.50%；业绩比较基准收益率为2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，近月PMI持续位于收缩区间，且金融及地产数据继续指向需求疲弱，经济改善缓慢作为债市行情的基本盘没有变化。从海外环境来看，美国失业率及非农就业数据进一步夯实降息预期，国内外货币政策的周期差呈现收敛，人民币汇率压力边际改善，为央行后续的政策操作提供了更舒适的空间。面对当下的收益率曲线，虽然多个节点上的交投拥挤度有所上行，但滚动窗口内尚没有极端的风险信号出现，投资者纠结的依然是赔率和潜在波动的取舍，在延续中性乐观的策略思路下也需要对央行的监管引导保留一份关注。

权益方面，新旧动能转换的过程中传统方向资本开支受到压制，信用扩张路径传导不畅，资本市场难免经历“改革阵痛”。就政策层面而言，管理当局依然坚持做难而正确的事，从“两强两严”以及新“国九条”等资本市场新政到新一轮财税体制改革，根本上还是为权益市场的健康发展和地方债务的可持续做长远规划。

本基金将综合权衡股债的边际变化进行配比调整，在含权仓位的具体配置上会更

聚焦中长期逻辑通顺的先进制造、调整充分的医药消费以及拥挤度尚可的红利资产等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、研究部负责人以及各投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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，本基金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关损害基金份额持有人利益的行为。

为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期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：国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,030,389.94	11,533,623.13
结算备付金		1,867,846.82	1,238,859.46
存出保证金		96,098.18	106,198.09
交易性金融资产	6.4.7.2	420,443,735.61	519,058,401.09
其中：股票投资		72,664,800.00	99,610,318.00
基金投资		-	-
债券投资		347,778,935.61	419,448,083.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		425,182.98	4,329,996.03
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-

资产总计		437,863,253.53	536,267,077.80
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		15,005,019.16	25,117,334.25
应付清算款		90,722.12	2,231,670.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		141,148.92	189,578.50
应付托管费		35,287.23	47,394.63
应付销售服务费		126.29	7,267.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,611.58	4,141.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	296,993.77	409,513.91
负债合计		15,574,909.07	28,006,901.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	410,093,098.09	497,169,053.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,195,246.37	11,091,122.82
净资产合计		422,288,344.46	508,260,176.69
负债和净资产总计		437,863,253.53	536,267,077.80

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 410,093,098.09 份，其中国寿安保尊裕优化回报债券 A 基金份额总额 409,723,440.85 份，基金份额净值 1.030 元；国寿安保尊裕优化回报债券 C 基金份额总额 369,657.24 份，基金份额净值 1.015 元。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		5,541,060.74	8,241,229.98
1. 利息收入		65,285.12	51,716.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,239.36	22,944.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		33,045.76	28,772.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,060,668.36	7,289,354.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,468,046.23	1,207,417.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12,178,287.27	5,445,989.42
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	350,427.32	635,947.60
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	404,704.52	856,300.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	10,402.74	43,857.76
减：二、营业总支出		1,478,832.18	1,233,768.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	932,997.50	835,530.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	233,249.46	208,882.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,877.64	959.79
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		197,784.68	80,172.02
其中：卖出回购金融资产支出		197,784.68	80,172.02
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,832.40	550.34
8. 其他费用	6.4.7.23	109,090.50	107,673.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,062,228.56	7,007,461.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,062,228.56	7,007,461.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,062,228.56	7,007,461.54

6.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	497,169,053.87	-	11,091,122.82	508,260,176.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	497,169,053.87	-	11,091,122.82	508,260,176.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-87,075,955.78	-	1,104,123.55	-85,971,832.23
（一）、综合收益总额	-	-	4,062,228.56	4,062,228.56
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-87,075,955.78	-	-2,958,105.01	-90,034,060.79
其中：1. 基金申购款	19,672,569.92	-	800,118.55	20,472,688.47
2. 基金赎回款	-106,748,525.70	-	-3,758,223.56	-110,506,749.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	410,093,098.09	-	12,195,246.37	422,288,344.46
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	215,212,453.55	-	7,602,286.62	222,814,740.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	215,212,453.55	-	7,602,286.62	222,814,740.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	285,584,921.20	-	20,025,519.37	305,610,440.57
（一）、综合收益总额	-	-	7,007,461.54	7,007,461.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	285,584,921.20	-	13,018,057.83	298,602,979.03
其中：1. 基金申购款	375,191,855.61	-	16,888,387.38	392,080,242.99
2. 基金赎回款	-89,606,934.41	-	-3,870,329.55	-93,477,263.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	500,797,374.75	-	27,627,805.99	528,425,180.74

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：

鄂华

王文英

于晓树

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金(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[2016]926号《关于准予国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金募集的批复》注册,由国寿安保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《国寿安保尊裕优化回报债券型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 349,345,404.21 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第 61090605_A05 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 03 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 349,448,765.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 103,361.44 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以

下简称“建设银行”)。

根据《国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保尊裕优化回报债券型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固定收益类金融工具，包括银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、债券回购和债券类资产，其中债券类资产包括国内依法发行上市的国家债券、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、证券公司短期公司债券、同业存单、可转让存单，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的相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，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(全价)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其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、

地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	15,030,389.94
等于：本金	15,029,341.31
加：应计利息	1,048.63
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	15,030,389.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	86,002,083.94	-	72,664,800.00	-13,337,283.94	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	227,774,070.18	789,379.38	221,845,525.28	-6,717,924.28
	银行间市场	121,009,746.66	1,754,410.33	125,933,410.33	3,169,253.34
	合计	348,783,816.84	2,543,789.71	347,778,935.61	-3,548,670.94
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	434,785,900.78	2,543,789.71	420,443,735.61	-16,885,954.88	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金于本报告期内未进行债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期内未进行其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期内未进行其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	212,458.41
其中：交易所市场	208,441.13
银行间市场	4,017.28
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	296,993.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保尊裕优化回报债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	475,762,925.14	475,762,925.14
本期申购	19,466,641.01	19,466,641.01
本期赎回（以“-”号填列）	-85,506,125.30	-85,506,125.30
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	409,723,440.85	409,723,440.85

国寿安保尊裕优化回报债券 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,406,128.73	21,406,128.73
本期申购	205,928.91	205,928.91
本期赎回（以“-”号填列）	-21,242,400.40	-21,242,400.40
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	369,657.24	369,657.24

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期间无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保尊裕优化回报债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,402,819.71	12,271,225.90	10,868,406.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,402,819.71	12,271,225.90	10,868,406.19
本期利润	3,671,916.50	729,846.28	4,401,762.78
本期基金份额交易产生的变动数	-28,928.43	-3,051,369.77	-3,080,298.20
其中：基金申购款	-308,195.58	1,104,314.04	796,118.46
基金赎回款	279,267.15	-4,155,683.81	-3,876,416.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,240,168.36	9,949,702.41	12,189,870.77

国寿安保尊裕优化回报债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-335,537.01	558,253.64	222,716.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-335,537.01	558,253.64	222,716.63
本期利润	-14,392.46	-325,141.76	-339,534.22
本期基金份额交易产生的变动数	346,214.71	-224,021.52	122,193.19
其中：基金申购款	-5,929.27	9,929.36	4,000.09
基金赎回款	352,143.98	-233,950.88	118,193.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,714.76	9,090.36	5,375.60

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	22,743.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,795.69
其他	699.68

合计	32,239.36
----	-----------

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,468,046.23
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-7,468,046.23

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	301,635,366.02
减：卖出股票成本总额	308,507,618.89
减：交易费用	595,793.36
买卖股票差价收入	-7,468,046.23

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,928,190.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,250,096.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,178,287.27

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,076,122,345.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,060,783,843.54
减：应计利息总额	6,014,187.71
减：交易费用	74,218.31

买卖债券差价收入	9,250,096.37
----------	--------------

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资产生的收益/损失。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	350,427.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	350,427.32

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	404,704.52
股票投资	-2,775,877.95
债券投资	3,180,582.47
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	404,704.52

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	10,402.48
基金转换费收入	0.26

合计	10,402.74
----	-----------

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,955.14
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	109,090.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人、注册登记机构、直销机构
建设银行	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司、销售机构
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	932,997.50	835,530.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,365.80	36,822.21
应支付基金管理人的净管理费	920,631.70	798,708.30

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	233,249.46	208,882.55

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服 务费的各关 联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C	合计
国寿安保	-	1.82	1.82

建设银行	-	74.17	74.17
合计	-	75.99	75.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C	合计
国寿安保	-	1.81	1.81
建设银行	-	360.91	360.91
中国人寿	-	1.81	1.81
合计	-	364.53	364.53

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
报告期初持有的基金份额	37,698,699.13	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	37,698,699.13	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	9.20%	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国寿安保尊裕优化回报债券 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
中国人寿	76,060,518.73	18.56	96,060,518.73	20.19

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	15,030,389.94	22,743.99	24,990,842.74	18,304.69

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌等而流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 15,005,019.16 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210005	21 付息国债 05	2024 年 7 月 16 日	125.14	100,000	12,514,311.48
240401	24 农发 01	2024 年 7 月 16 日	100.68	60,000	6,040,554.10
合计				160,000	18,554,865.58

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。监事会对董事会、管理层履职情况进行监督。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理

工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,030,389.94	-	-	-	15,030,389.94
结算备付金	1,867,846.82	-	-	-	1,867,846.82
存出保证金	96,098.18	-	-	-	96,098.18
交易性金融资产	112,039,341.32	180,211,367.74	55,528,226.55	72,664,800.00	420,443,735.61
应收清算款	-	-	-	425,182.98	425,182.98
资产总计	129,033,676.26	180,211,367.74	55,528,226.55	73,089,982.98	437,863,253.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	141,148.92	141,148.92
应付托管费	-	-	-	35,287.23	35,287.23
应付清算款	-	-	-	90,722.12	90,722.12
卖出回购金融资产款	15,005,019.16	-	-	-	15,005,019.16
应付销售服务费	-	-	-	126.29	126.29
应交税费	-	-	-	5,611.58	5,611.58
其他负债	-	-	-	296,993.77	296,993.77
负债总计	15,005,019.16	-	-	569,889.91	15,574,909.07
利率敏感度缺口	114,028,657.10	180,211,367.74	55,528,226.55	72,520,093.07	422,288,344.46
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,533,623.13	-	-	-	11,533,623.13
结算备付金	1,238,859.46	-	-	-	1,238,859.46
存出保证金	106,198.09	-	-	-	106,198.09
交易性金融资产	82,029,624.04	278,522,327.83	58,896,131.22	99,610,318.00	519,058,401.09
应收清算款	-	-	-	4,329,996.03	4,329,996.03
资产总计	94,908,304.72	278,522,327.83	58,896,131.22	103,940,318.03	536,267,077.80
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	189,578.50	189,578.50
应付托管费	-	-	-	47,394.63	47,394.63
应付清算款	-	-	-	2,231,670.43	2,231,670.43
卖出回购金融资产款	25,117,334.25	-	-	-	25,117,334.25
应付销售服务费	-	-	-	7,267.88	7,267.88
应交税费	-	-	-	4,141.51	4,141.51
其他负债	-	-	-	409,513.91	409,513.91
负债总计	25,117,334.25	-	-	2,889,566.86	28,006,901.11
利率敏感度缺口	69,790,970.47	278,522,327.83	58,896,131.22	101,050,747.17	508,260,176.69

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-823,873.59	-1,297,778.26
	-25 个基点	858,750.11	1,360,817.56

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无重大价格风险(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 17.21%(2023 年 12 月 31 日:19.60%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	294,510,325.28	412,855,182.65
第二层次	125,933,410.33	106,203,218.44
第三层次	-	-
合计	420,443,735.61	519,058,401.09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	72,664,800.00	16.60
	其中：股票	72,664,800.00	16.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	347,778,935.61	79.43
	其中：债券	347,778,935.61	79.43
	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	16,898,236.76	3.86
8	其他各项资产	521,281.16	0.12
9	合计	437,863,253.53	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	4,073,500.00	0.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,420,600.00	6.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,247,000.00	0.53
F	批发和零售业	-	-
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	20,808,550.00	4.93
J	金融业	3,491,000.00	0.83
K	房地产业	2,562,000.00	0.61
L	租赁和商务服务业	312,450.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	5,525,700.00	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,224,000.00	1.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,664,800.00	17.21

7.2.2 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投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300015	爱尔眼科	700,000	7,224,000.00	1.71
2	301269	华大九天	75,000	5,778,750.00	1.37
3	000066	中国长城	550,000	4,812,500.00	1.14
4	002368	太极股份	200,000	4,510,000.00	1.07
5	600276	恒瑞医药	105,000	4,038,300.00	0.96
6	688111	金山办公	16,000	3,640,000.00	0.86
7	600570	恒生电子	200,000	3,532,000.00	0.84
8	688621	阳光诺和	75,000	3,202,500.00	0.76
9	002603	以岭药业	200,000	3,066,000.00	0.73
10	000998	隆平高科	250,000	2,457,500.00	0.58
11	601066	中信建投	125,000	2,405,000.00	0.57
12	301096	百诚医药	40,000	2,323,200.00	0.55
13	000032	深桑达 A	150,000	2,247,000.00	0.53
14	688516	奥特维	50,000	2,090,500.00	0.50
15	000739	普洛药业	150,000	2,035,500.00	0.48
16	002271	东方雨虹	150,000	1,851,000.00	0.44
17	300747	锐科激光	100,000	1,775,000.00	0.42
18	300896	爱美客	10,000	1,721,000.00	0.41
19	002041	登海种业	200,000	1,616,000.00	0.38
20	688083	中望软件	20,000	1,452,400.00	0.34
21	002244	滨江集团	200,000	1,452,000.00	0.34
22	300171	东富龙	100,000	1,189,000.00	0.28
23	603187	海容冷链	100,000	1,166,000.00	0.28
24	000560	我爱我家	500,000	1,110,000.00	0.26
25	601881	中国银河	100,000	1,086,000.00	0.26
26	600775	南京熊猫	100,000	800,000.00	0.19
27	002385	大北农	200,000	770,000.00	0.18
28	688777	中控技术	20,000	754,000.00	0.18
29	600536	中国软件	20,000	598,400.00	0.14
30	688363	华熙生物	10,000	565,700.00	0.13
31	300366	创意信息	75,000	543,000.00	0.13
32	300724	捷佳伟创	10,000	540,100.00	0.13
33	601888	中国中免	5,000	312,450.00	0.07

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688111	金山办公	16,713,406.59	3.29
2	600266	城建发展	13,449,409.00	2.65
3	301269	华大九天	12,755,127.00	2.51
4	002368	太极股份	12,356,076.00	2.43
5	688083	中望软件	11,958,849.80	2.35
6	600048	保利发展	11,911,550.00	2.34
7	688777	中控技术	10,103,438.94	1.99
8	002271	东方雨虹	8,591,080.00	1.69
9	002244	滨江集团	7,967,500.00	1.57
10	688516	奥特维	7,943,089.49	1.56
11	000733	振华科技	7,938,915.00	1.56
12	300724	捷佳伟创	7,643,485.62	1.50
13	600775	南京熊猫	6,469,659.70	1.27
14	300366	创意信息	6,202,500.00	1.22
15	601100	恒立液压	5,864,605.00	1.15
16	000066	中国长城	5,555,000.00	1.09
17	601066	中信建投	5,540,436.00	1.09
18	688095	福昕软件	5,344,372.98	1.05
19	600276	恒瑞医药	5,169,140.00	1.02
20	301095	广立微	4,752,395.00	0.94

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688111	金山办公	18,614,535.38	3.66
2	600048	保利发展	16,875,004.00	3.32
3	600266	城建发展	15,403,588.00	3.03
4	688083	中望软件	14,908,299.96	2.93
5	688777	中控技术	14,375,723.72	2.83
6	000733	振华科技	12,382,041.00	2.44
7	688516	奥特维	12,034,660.13	2.37
8	300366	创意信息	10,840,773.00	2.13
9	300724	捷佳伟创	10,068,904.00	1.98
10	301269	华大九天	9,205,337.00	1.81
11	002271	东方雨虹	8,537,812.00	1.68
12	002368	太极股份	7,839,069.00	1.54

13	688363	华熙生物	6,877,495.58	1.35
14	002244	滨江集团	6,722,250.00	1.32
15	300171	东富龙	6,404,479.00	1.26
16	601100	恒立液压	6,111,550.00	1.20
17	600248	陕建股份	6,009,000.00	1.18
18	000066	中国长城	5,714,338.00	1.12
19	603187	海容冷链	5,582,150.00	1.10
20	600775	南京熊猫	5,461,052.00	1.07

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	284,337,978.84
卖出股票收入（成交）总额	301,635,366.02

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,514,311.48	2.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	113,419,098.85	26.86
	其中：政策性金融债	91,689,307.07	21.71
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）	221,845,525.28	52.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	347,778,935.61	82.36

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190409	19 农发 09	300,000	30,921,147.54	7.32
2	272380003	23 利安人寿资本补充债 01	200,000	21,729,791.78	5.15
3	127018	本钢转债	180,000	21,253,798.36	5.03
4	210218	21 国开 18	200,000	20,433,590.16	4.84

5	240401	24 农发 01	200,000	20,135,180.33	4.77
---	--------	----------	---------	---------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，安徽鸿路钢结构(集团)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；本钢板材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；国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方监管局的处罚；利安人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方监管局的处罚；中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局、国家金融监督管理总局地方监管局、国家外汇管理局、中国人民银行分行的处罚。

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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,098.18
2	应收清算款	425,182.98
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	521,281.16

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127018	本钢转债	21,253,798.36	5.03
2	128134	鸿路转债	19,811,878.08	4.69
3	113516	苏农转债	19,246,452.06	4.56
4	123194	百洋转债	17,786,321.92	4.21
5	127038	国微转债	17,097,034.42	4.05
6	123210	信服转债	16,576,464.66	3.93
7	118009	华锐转债	12,393,014.38	2.93
8	110064	建工转债	11,716,282.60	2.77
9	113661	福 22 转债	10,635,531.51	2.52
10	123158	宙邦转债	9,665,745.89	2.29
11	111014	李子转债	8,503,300.23	2.01
12	113047	旗滨转债	8,223,893.84	1.95
13	113059	福莱转债	7,476,843.84	1.77
14	123150	九强转债	6,584,170.55	1.56
15	123107	温氏转债	6,309,952.06	1.49
16	110067	华安转债	6,100,321.23	1.44
17	118025	奕瑞转债	5,653,885.96	1.34
18	118044	赛特转债	4,707,658.63	1.11
19	128122	兴森转债	2,806,822.60	0.66
20	113641	华友转债	2,536,675.34	0.60
21	118024	冠宇转债	1,644,809.59	0.39
22	127066	科利转债	1,636,384.93	0.39
23	110075	南航转债	1,239,841.37	0.29
24	113024	核建转债	1,103,582.19	0.26
25	113042	上银转债	568,367.53	0.13
26	127076	中宠转 2	566,491.51	0.13

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国寿安保尊裕优化回报债券 A	127	3,226,168.83	409,158,532.88	99.86	564,907.97	0.14
国寿安保尊裕优化回报债券 C	135	2,738.20	-	-	369,657.24	100.00
合计	262	1,565,240.83	409,158,532.88	99.77	934,565.21	0.23

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	国寿安保尊裕优化回报债券 A	307,881.11	0.08
	国寿安保尊裕优化回报债券 C	325.28	0.09
	合计	308,206.39	0.08

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	国寿安保尊裕优化回报债券 A	0~10
	国寿安保尊裕优化回报债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保尊裕优化回报债券 A	10~50
	国寿安保尊裕优化回报债券 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
基金合同生效日（2017年3月23日）基金份额总额	319,286,871.13	30,161,894.52
本报告期期初基金份额总额	475,762,925.14	21,406,128.73
本报告期基金总申购份额	19,466,641.01	205,928.91

减：本报告期基金总赎回份额	85,506,125.30	21,242,400.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	409,723,440.85	369,657.24

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2024 年 3 月 27 日发布公告，王大朋先生于 2024 年 3 月 25 日离任公司总经理助理；基金管理人于 2024 年 6 月 15 日发布公告，王文英女士于 2024 年 6 月 14 日任公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2021 年 10 月 20 日起，改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中银国际	2	326,196,298.74	55.67	210,689.74	51.71	-
东方证券	2	146,879,603.72	25.07	94,869.51	23.29	-
中信建投	1	103,014,061.40	17.58	97,441.53	23.92	-
长江证券	1	9,883,381.00	1.69	4,406.92	1.08	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中银国际	1,339,402,233.01	70.40	-	-	-	-
东方证券	373,511,408.06	19.63	-	-	-	-
中信建投	153,370,394.59	8.06	-	-	-	-
长江证券	36,390,055.27	1.91	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20240105~20240429	96,060,518.73	0.00	20,000,000.00	76,060,518.73	18.55
	2	20240101~20240630	190,838,740.46	0.00	0.00	190,838,740.46	46.54
	3	20240515~20240527	75,701,701.53	19,211,335.25	47,000,000.00	47,913,036.78	11.68
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 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

12.3 查阅方式

- 12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfunds.com.cn
- 12.3.3 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

2024 年 8 月 31 日