

国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§ 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
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.....	40
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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的情况	43
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金	
基金简称	国寿安保尊荣中短债债券	
基金主代码	006773	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,612,475,526.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保尊荣中短债债券 A	国寿安保尊荣中短债债券 C
下属分级基金的交易代码:	006773	006774
报告期末下属分级基金的份额总额	4,608,835,699.87 份	4,003,639,826.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过重点投资中短期债券，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性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略、回购套利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总财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉	罗菲菲
	联系电话	010-50850744	010-58560666
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95568
传真		010-50850776	010-58560798
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100033	100031
法定代表人		王军辉	高迎欣

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

基金级别	国寿安保尊荣中短债债券 A	国寿安保尊荣中短债债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	59,503,515.36	116,038,482.74
本期利润	35,036,983.39	101,739,042.93
加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0136
本期加权平均净值利润率	0.84%	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.65%	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	238,462,618.02	189,553,632.22
期末可供分配基金份额利润	0.0517	0.0473
期末基金资产净值	4,854,716,744.83	4,199,670,601.77
期末基金份额净值	1.0533	1.0490
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.33%	4.90%

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

国寿安保尊荣中短债债券 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	-0.39%	0.05%	-0.49%	0.08%	0.10%	-0.03%
过去三个月	0.22%	0.05%	-0.02%	0.09%	0.24%	-0.04%
过去六个月	1.65%	0.05%	1.47%	0.07%	0.18%	-0.02%
过去一年	3.80%	0.03%	3.36%	0.05%	0.44%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.33%	0.04%	4.38%	0.04%	0.95%	0.00%

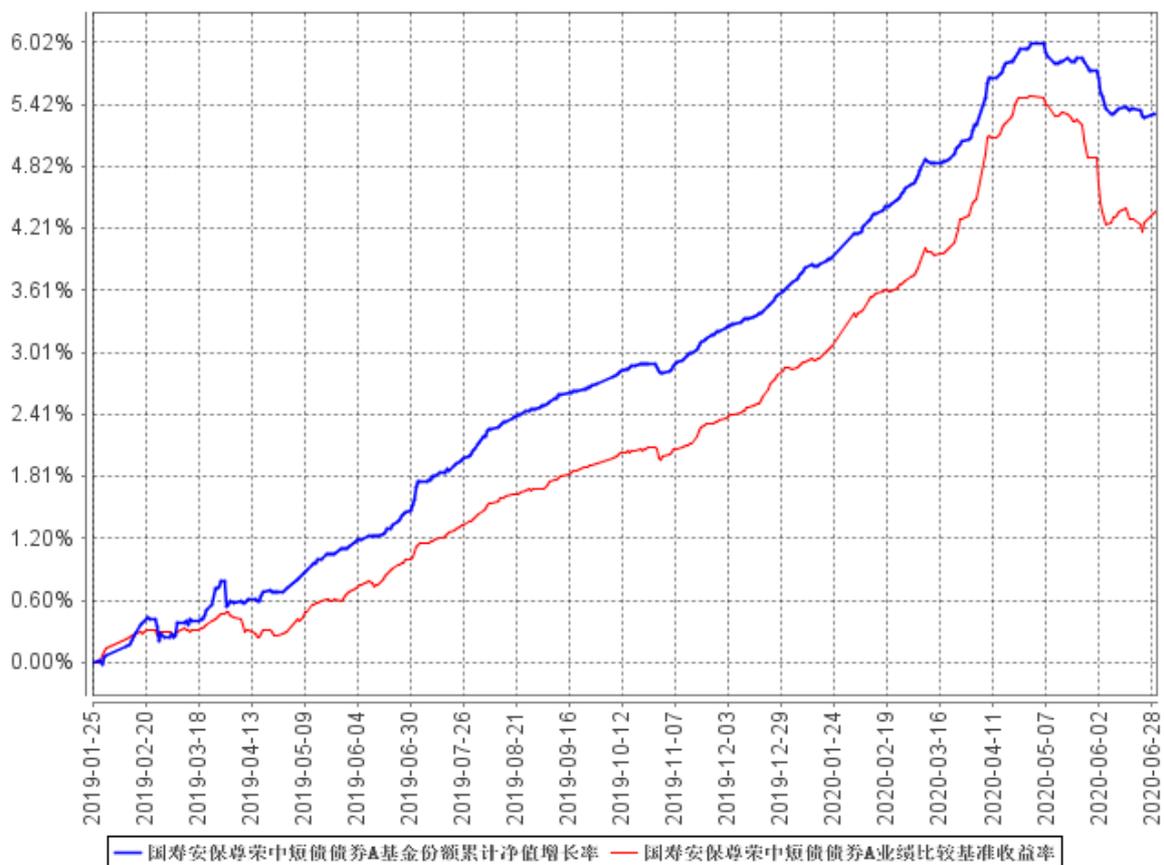
国寿安保尊荣中短债债券 C

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

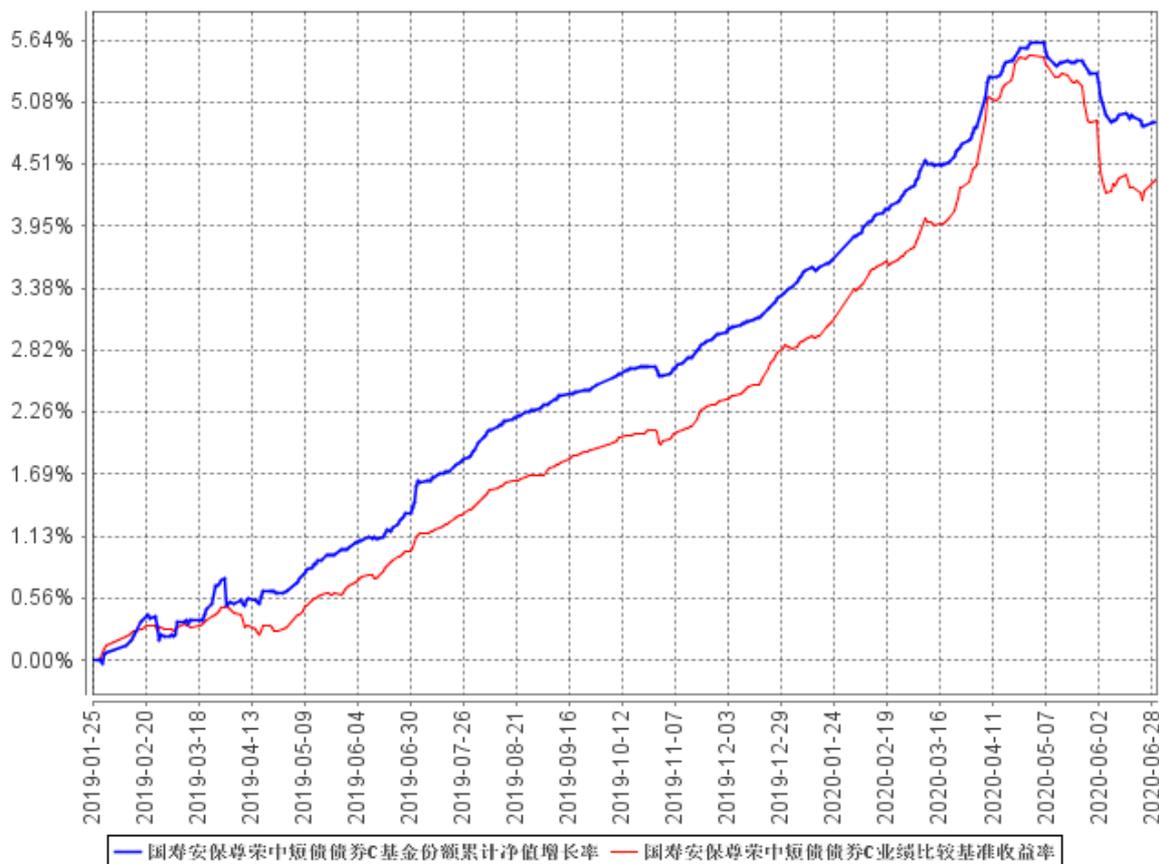
		准差②	率③	④		
过去一个月	-0.41%	0.04%	-0.49%	0.08%	0.08%	-0.04%
过去三个月	0.15%	0.05%	-0.02%	0.09%	0.17%	-0.04%
过去六个月	1.51%	0.04%	1.47%	0.07%	0.04%	-0.03%
过去一年	3.51%	0.03%	3.36%	0.05%	0.15%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.90%	0.04%	4.38%	0.04%	0.52%	0.00%

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

国寿安保尊荣中短债债券A基金份额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



国寿安保尊荣中短债债券C基金份额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：本基金的基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效，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 2019 年 1 月 25 日至 2020 年 6 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%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(澳大利亚安保资本投资有限公司),其持有股份 14.97%。截至 2020 年 6 月 30 日,公司共管理 63 只公募基金和部分私募资产管理计划,公司管理资产总规模为 2807.05 亿元,其中公募基金管理规模 2119.18 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		
黄力	基金经理	2019 年 1 月 25 日	-	10 年	黄力先生,硕士,中国籍。曾任中国人寿资产管理有限公司投资经理助理;现任国寿安保安裕纯债半年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保安盛纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金、国寿安保尊耀纯债债券型证券投资基金和国寿安保尊恒利率债债券型证券投资基金基金经理。
阚磊	-	2019 年 2 月 19 日	-	10 年	硕士研究生,曾任中国人寿资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理,兴业基金管理有限公司 FOF 基金投资部副总监,现任国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金、国寿安保安泽纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金和国寿安保尊耀纯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或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《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 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

2020 年上半年，突发的新冠肺炎疫情在全球扩散，全球经济呈现较大的下行压力。美联储在 3 月份连续降息至零率，海外各经济体均推出强有力宽松的货币政策。新冠疫情在二季度有所缓解，但不同国家的疫情有所分化，海外经济仍处于缓慢复苏过程中。国内有效控制住新冠疫情的蔓延，央行通过降准、再贷款、再贴现等货币政策有效应对疫情对经济的冲击。国内经济在二季度出现明显的复苏，生长端回暖速度较快，工业增加值同比逐步上行，外需好于预期，固定资产投资逐月改善，但消费受收入下滑影响，恢复较慢。整体看，国内经济恢复好于海外经济，但经济增长仍面临内外部诸多不确定性因素。

从政策面来看，在一季度疫情期间，央行及时通过降准、公开市场操作、再贷款、再贴现等货币政策应对疫情对经济的冲击，在二季度经济开始复苏期间，货币政策回归常态操作，维持资金面的合理充裕，充分体现了货币政策的灵活适度。

上半年国内债券市场收益率呈现先下后上的 V 型走势，受新冠疫情和货币政策等因素影响，利率债和信用债收益率呈大幅震荡走势。

投资运作方面，本基金在上半年主要以中高等级、中短久期信用债为主要配置品种，波段交易利率债。

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荣中短债债券 A 基金份额净值为 1.0533 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.65%；截至本报告期末国寿安保尊荣中短债债券 C 基金份额净值为 1.0490 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.51%；同期业绩比较基准收益率为 1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年下半年中国经济仍将处于新冠疫情背景下的复苏阶段，通过加快形成以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局，完善宏观调控跨周期设计和调节。但受海外疫情控制情况、中美摩擦等因素影响，经济复苏仍然面临较多不确定性因素。预计 2020 年下半年中国 GDP 增速仍将复苏上行至潜在经济增速位置，财政政策将更加积极有为、注重实效，预计下半年财政支出将大幅增加，支持和提升基建投资增速，货币政策将更加灵活适度、精准导向，在中国经济复苏的大背景下，货币政策将更加注重适度，并更重视使用直达实体经济的货币政策工具，以更好引导资金进入实体经济，实现宽货币向宽信用的转变。

债券市场方面，受宏观经济延续修复趋势及货币政策回归常态的影响，考虑到当前债券市场收益率经过二季度调整后处于中性位置，预计债券市场将呈现上有顶、下有底的震荡走势。在经济增速处于修复过程中，中长期利率债收益率波动性将增大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

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、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，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签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	299,978,451.93	1,873,181.88
结算备付金		10,821,593.41	-
存出保证金		691,298.59	11,985.98
交易性金融资产	6.4.7.2	9,664,122,550.00	2,900,264,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,478,377,550.00	2,779,870,000.00
资产支持证券投资		185,745,000.00	120,394,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	134,652,829.60	43,890,269.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,125,288.91	42,451,934.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,111,392,012.44	2,988,491,371.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		751,153,144.43	299,187,013.83
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		299,705,540.53	23,735,910.62
应付管理人报酬		2,657,857.02	656,617.43
应付托管费		885,952.33	218,872.46
应付销售服务费		1,384,952.51	290,462.46
应付交易费用	6.4.7.7	238,750.23	59,352.73
应交税费		808,230.47	223,897.09

应付利息		60,839.94	82,030.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,398.38	210,000.00
负债合计		1,057,004,665.84	324,664,157.48
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	8,612,475,526.61	2,573,806,057.92
未分配利润	6.4.7.10	441,911,819.99	90,021,156.30
所有者权益合计		9,054,387,346.60	2,663,827,214.22
负债和所有者权益总计		10,111,392,012.44	2,988,491,371.70

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，国寿安保尊荣中短债债券 A 基金份额净值 1.0533 元，基金份额总额 4,608,835,699.87 份；国寿安保尊荣中短债债券 C 基金份额净值 1.0490 元，基金份额总额 4,003,639,826.74 份。国寿安保尊荣中短债债券份额总额合计为 8,612,475,526.61 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 25 日(基金 合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		184,513,100.26	17,854,681.63
1.利息收入		216,126,668.00	18,212,400.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	541,168.47	217,388.34
债券利息收入		209,795,951.42	16,885,958.20
资产支持证券利息收入		3,195,602.13	495,246.70
买入返售金融资产收入		2,593,945.98	613,807.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,786,110.65	-933,103.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,786,110.65	-933,103.33
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-38,765,971.78	575,028.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	2,366,293.39	355.53
减:二、费用		47,737,073.94	3,685,408.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,882,225.71	1,311,848.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,960,741.88	437,282.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,667,282.15	431,710.17
4. 交易费用	6.4.7.19	260,783.51	34,959.42
5. 利息支出		11,311,349.56	1,308,961.58
其中: 卖出回购金融资产支出		11,311,349.56	1,308,961.58
6. 税金及附加		489,160.72	40,285.67
7. 其他费用	6.4.7.20	165,530.41	120,359.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		136,776,026.32	14,169,273.52
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		136,776,026.32	14,169,273.52

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金

本报告期: 2020年1月1日至2020年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,573,806,057.92	90,021,156.30	2,663,827,214.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	136,776,026.32	136,776,026.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	6,038,669,468.69	215,114,637.37	6,253,784,106.06
其中: 1.基金申购款	29,334,137,593.62	1,401,136,128.45	30,735,273,722.07
2.基金赎回款	-23,295,468,124.93	-1,186,021,491.08	-24,481,489,616.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少)	-	-	-

少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	8,612,475,526.61	441,911,819.99	9,054,387,346.60
项目	上年度可比期间 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,141,117,413.79	-	1,141,117,413.79
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	14,169,273.52	14,169,273.52
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数 (净值减少以“-”号 填列)	-263,357,725.72	-1,437,726.88	-264,795,452.60
其中: 1.基金申购款	461,741,360.23	4,305,453.99	466,046,814.22
2.基金赎回款	-725,099,085.95	-5,743,180.87	-730,842,266.82
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	877,759,688.07	12,731,546.64	890,491,234.71

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:

_____ 左季庆 _____ 王文英 _____ 韩占锋
 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

国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金(简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2018】1991号)核准,由国寿安保基金管理有限公司(简称“国寿安保”)于2019年1月9日至2019年1月22日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2019)验字第61090605_A02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019

年 1 月 25 日正式生效。本基金将基金份额分为 A 类和 C 类不同的类别。在投资人认（申）购时收取认（申）购费，不收取销售服务费，且在赎回时根据持有期限收取赎回费的，称为 A 类基金份额；在投资者认（申）购时不收取认（申）购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费的，称为 C 类基金份额。首次募集规模为 691,688,923.87 份 A 类基金份额，449,428,489.92 份 C 类基金份额。国寿安保尊荣中短债 A 类及 C 类收到的实收基金合计 1,141,117,413.79 元人民币，分别折合成 A 类和 C 类基金份额，合计折合 1,141,117,413.79 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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。

本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开证券投资基金信息披露

露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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告相一致。

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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试

点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳

的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	299,978,451.93
定期存款	-
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	-
合计：	299,978,451.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,186,224,570.92	1,173,050,950.00
	银行间市场	8,331,550,029.69	8,305,326,600.00
	合计	9,517,774,600.61	9,478,377,550.00
资产支持证券	185,279,000.00	185,745,000.00	466,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,703,053,600.61	9,664,122,550.00	-38,931,050.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,783.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	595.60
应收债券利息	132,302,427.94
应收资产支持证券利息	2,333,925.54
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	97.40
合计	134,652,829.60

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	238,750.23
合计	238,750.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-
预提费用	109,398.38
合计	109,398.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保尊荣中短债债券 A

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,466,870,271.66	1,466,870,271.66
本期申购	9,836,528,752.26	9,836,528,752.26
本期赎回(以“-”号填列)	-6,694,563,324.05	-6,694,563,324.05
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,608,835,699.87	4,608,835,699.87

金额单位：人民币元

国寿安保尊荣中短债债券 C		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,106,935,786.26	1,106,935,786.26
本期申购	19,497,608,841.36	19,497,608,841.36
本期赎回(以“-”号填列)	-16,600,904,800.88	-16,600,904,800.88
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,003,639,826.74	4,003,639,826.74

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保尊荣中短债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,222,555.19	821,227.19	53,043,782.38
本期利润	59,503,515.36	-24,466,531.97	35,036,983.39
本期基金份额交易产生的变动数	126,736,547.47	31,063,731.72	157,800,279.19
其中：基金申购款	451,680,639.84	66,972,449.30	518,653,089.14
基金赎回款	-324,944,092.37	-35,908,717.58	-360,852,809.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	238,462,618.02	7,418,426.94	245,881,044.96

单位：人民币元

国寿安保尊荣中短债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,350,452.23	626,921.69	36,977,373.92

本期利润	116,038,482.74	-14,299,439.81	101,739,042.93
本期基金份额交易产生的变动数	37,164,697.25	20,149,660.93	57,314,358.18
其中：基金申购款	771,306,109.73	111,176,929.58	882,483,039.31
基金赎回款	-734,141,412.48	-91,027,268.65	-825,168,681.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	189,553,632.22	6,477,142.81	196,030,775.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	524,090.17
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	16,271.46
其他	806.84
合计	541,168.47

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期无股票投资产生的收益/损失。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,786,110.65
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	4,786,110.65

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	26,262,386,734.81

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,977,487,232.57
减：应收利息总额	280,113,391.59
买卖债券差价收入	4,786,110.65

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-38,728,971.78
——股票投资	-
——债券投资	-38,864,971.78
——资产支持证券投资	136,000.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-37,000.00
——权证投资	-
——期货投资	-37,000.00
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	-38,765,971.78
----	----------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	2,366,163.48
转换费收入 006774	129.91
合计	2,366,293.39

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	4,489.97
银行间市场交易费用	256,167.54
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
期货交易费用	126.00
合计	260,783.51

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	600.00
银行费用	37,532.03
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
合计	165,530.41

6.4.7.21 分部报告

无。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”）	基金托管人、销售机构
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、 代销机构
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

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未发生应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,882,225.71	1,311,848.69
其中：支付销售机构的客户维护费	8,795,404.90	744,260.37

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,960,741.88	437,282.87

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊荣中短债债券 A	国寿安保尊荣中短债债券 C	合计
国寿安保	-	75,799.72	75,799.72
民生银行	-	155,302.41	155,302.41
中国人寿	-	102.11	102.11
合计	-	231,204.24	231,204.24

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊荣中短 债债券 A	国寿安保尊荣中短 债债券 C	合计
国寿安保	-	39.00	39.00
合计	-	39.00	39.00

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 0.30%。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 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
民生银行	284,374,762.19	-	-	-	5,544,943,000.00	371,713.01
上年度可比期间 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
民生银行	10,000,195.63	-	-	-	250,147,000.00	14,128.99

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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度末基金管理人未有运用自有资金投资本基金的情况。

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

国寿安保尊荣中短债债券 A				
关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
国寿财富管理 有限公司	40,985,319.31	0.8893%	45,784,705.31	3.1213%
中国人寿保险 股份有限公司	-	-	148,825,927.00	10.1458%

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 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
民生银行	299,978,451.93	524,090.17	6,502,696.81	168,634.77

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2020 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

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截止本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形式的卖出回购证余额 751,153,144.43，是以如下债券作为质押：

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
042000003	20 津城建 CP001	2020 年 7 月 1 日	100.13	129,000	12,916,770.00
012000251	20 南航股 SCP002	2020 年 7 月 1 日	100.15	1,862,000	186,479,300.00
200304	20 进出 04	2020 年 7 月 1 日	99.83	6,000,000	598,980,000.00
合计				7,991,000	798,376,070.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于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

本报告期末本基金未有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务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。本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在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。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

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财务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。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在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。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

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约责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性

风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措

施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资

产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	299,978,451.93	-	-	-	299,978,451.93
结算备付金	10,821,593.41	-	-	-	10,821,593.41
存出保证金	216,418.09	-	-	474,880.50	691,298.59
交易性金融资产	7,499,439,950.00	2,164,682,600.00	-	185,745,000.00	9,849,867,550.00
应收证券清算款	-	-	-	37,000.00	37,000.00
应收利息	-	-	-	134,652,829.60	134,652,829.60

应收申购款	-	-	-	1,125,288.91	1,125,288.91
其他资产	-	-	-	-185,782,000.00	-185,782,000.00
资产总计	7,810,456,413.43	2,164,682,600.00	-	136,252,999.01	10,111,392,012.44
负债					
卖出回购金融资产款	751,153,144.43	-	-	-	751,153,144.43
应付赎回款	-	-	-	299,705,540.53	299,705,540.53
应付管理人报酬	-	-	-	2,657,857.02	2,657,857.02
应付托管费	-	-	-	885,952.33	885,952.33
应付销售服务费	-	-	-	1,384,952.51	1,384,952.51
应付交易费用	-	-	-	238,750.23	238,750.23
应付利息	-	-	-	60,839.94	60,839.94
应交税费	-	-	-	808,230.47	808,230.47
其他负债	-	-	-	109,398.38	109,398.38
负债总计	751,153,144.43	-	-	305,851,521.41	1,057,004,665.84
利率敏感度缺口	7,059,303,269.00	2,164,682,600.00	-	-169,598,522.40	9,054,387,346.60
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,873,181.88	-	-	-	1,873,181.88
存出保证金	11,985.98	-	-	-	11,985.98
交易性金融资产	1,615,937,000.00	1,214,609,000.00	69,718,000.00	-	2,900,264,000.00
应收利息	-	-	-	43,890,269.64	43,890,269.64
应收申购款	-	-	-	42,451,934.20	42,451,934.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,617,822,167.86	1,214,609,000.00	69,718,000.00	86,342,203.84	2,988,491,371.70
负债					
卖出回购金融资产款	299,187,013.83	-	-	-	299,187,013.83
应付赎回款	-	-	-	23,735,910.62	23,735,910.62
应付管理人报酬	-	-	-	656,617.43	656,617.43
应付托管费	-	-	-	218,872.46	218,872.46
应付销售服务费	-	-	-	290,462.46	290,462.46
应付交易费用	-	-	-	59,352.73	59,352.73
应付利息	-	-	-	82,030.86	82,030.86
应交税费	-	-	-	223,897.09	223,897.09
其他负债	-	-	-	210,000.00	210,000.00
负债总计	299,187,013.83	-	-	25,477,143.65	324,664,157.48
利率敏感度缺口	1,318,635,154.03	1,214,609,000.00	69,718,000.00	60,865,060.19	2,663,827,214.22

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下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。

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-18,327,691.92	-8,089,278.59
	-25 个基点	18,327,691.92	8,089,278.59

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比 例（%）	公允价值	占基金资产 净值比 例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,664,122,550.00	106.73	2,900,264,000.00	108.88
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,664,122,550.00	106.73	2,900,264,000.00	108.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金主要投资于固定收益品种，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本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币 9,664,122,550.00 元（上年度末：2,900,264,000.00 元），无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,664,122,550.00	95.58
	其中：债券	9,478,377,550.00	93.74
	资产支持证券	185,745,000.00	1.84
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	310,800,045.34	3.07
8	其他各项资产	136,469,417.10	1.35
9	合计	10,111,392,012.44	100.00

7.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

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沪港通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,054,850,600.00	11.65
	其中：政策性金融债	598,980,000.00	6.62
4	企业债券	1,317,594,950.00	14.55
5	企业短期融资券	4,315,634,000.00	47.66
6	中期票据	2,790,298,000.00	30.82
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,478,377,550.00	104.68

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	200304	20 进出 04	6,000,000	598,980,000.00	6.62
2	1822022	18 浦银租赁债	2,500,000	256,425,000.00	2.83
3	012000251	20 南航股 SCP002	2,000,000	200,300,000.00	2.21
4	042000003	20 津城建 CP001	2,000,000	200,260,000.00	2.21
5	012000458	20 湘高速 SCP001	2,000,000	200,180,000.00	2.21

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	165728	20 首置优	500,000	50,150,000.00	0.55
2	165933	申领 1	500,000	49,930,000.00	0.55
3	139862	19 首开 3A	200,000	20,142,000.00	0.22
4	165918	云能投 1A	160,000	16,008,000.00	0.18
5	139878	国链 11A1	100,000	10,067,000.00	0.11
6	138007	国链 13A1	100,000	10,064,000.00	0.11
7	165795	申六局 3A	100,000	10,060,000.00	0.11
7	165795	申六局 3A	100,000	10,060,000.00	0.11
8	159908	申六局 1A	100,000	10,025,000.00	0.11
9	159958	19 平 8A1	300,000	4,590,000.00	0.05
10	139867	平汽 2A1	300,000	3,573,000.00	0.04
11	159754	19 平 6A1	200,000	1,136,000.00	0.01

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

7.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的，并结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，对冲投资风险。本基金国债期货交易总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
T2009	T2009	10	-10,027,500.00	-500.00	-
TF2009	TF2009	20	-20,331,000.00	-36,500.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-37,000.00
国债期货投资本期收益(元)					-
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-37,000.00

7.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金的国债期货投资整体操作上相对谨慎，对基金的收益以及波动性控制都有一定的积极作用。后期仍将努力把握确定性较大的机会，对冲投资风险，提升基金收益。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除“18 浦银租赁债”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。

中国银保监会上海监管局于 2019 年 8 月 15 日作出处罚决定，浦银金融租赁股份有限公司因违规提供政府性融资被责令改正并处罚款 50 万元。

本基金的投资决策主要基于对投资标的的价值分析，相关决策程序符合法律法规和公司制度的要求。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	691,298.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	134,652,829.60
5	应收申购款	1,125,288.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,469,417.10

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限制的股票。

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
国寿安保尊荣中短债债券 A	1,691	2,725,508.99	3,765,181,836.84	81.69%	843,653,863.03	18.31%
国寿安保尊荣中短债债券 C	18,848	212,417.22	126,459,239.14	3.16%	3,877,180,587.60	96.84%
合计	20,539	419,323.02	3,891,641,075.98	45.19%	4,720,834,450.63	54.81%

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	国寿安保尊荣中短债债券 A	122,060.25	0.0026%
	国寿安保尊荣中短债债券 C	670,444.75	0.0167%
	合计	792,505.00	0.0092%

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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国寿安保尊荣中短债债券 A	0~10
	国寿安保尊荣中短债债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保尊荣中短债债券 A	0~10
	国寿安保尊荣中短债债券 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保尊荣中短债 债券 A	国寿安保尊荣中短债 债券 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）基金份 额总额	691,688,923.87	449,428,489.92
本报告期期初基金份额总额	1,466,870,271.66	1,106,935,786.26
本报告期基金总申购份额	9,836,528,752.26	19,497,608,841.36
减：本报告期基金总赎回份额	6,694,563,324.05	16,600,904,800.88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	4,608,835,699.87	4,003,639,826.74

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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，基金管理人及托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

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
兴业证券	2,861,849,248.08	100.00%	1,448,100,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 14 日
2	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 18 日
3	关于调整国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务时间的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 30 日
4	国寿安保基金关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 25 日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 27 日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加南京苏宁基金销售有限公司转换手续费率优惠活动的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 30 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金在喜鹊财富基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 15 日
8	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 22 日
9	关于国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 23 日
10	关于国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限制金...	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 29 日
11	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金 2019 年度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 30 日
12	国寿安保尊荣中短债债券型	中证报、证监会指定	2020 年 6 月 5 日

	证券投资基金托管协议	网站及公司网站	
13	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金基金合同	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020年6月5日
14	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2020年第1号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020年6月5日
15	国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金更新招募说明书（2020年第1号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020年6月5日
16	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加恒泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020年6月17日

§ 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

无。

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荣中短债债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保尊荣中短债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荣中短债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.gsfoods.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

2020 年 8 月 29 日