国寿安保尊诚纯债债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保尊诚纯债债券	
基金主代码	008873	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 21 日	
报告期末基金份额总额	2,678,651,949.58 份	
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，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，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	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，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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保尊诚纯债债券 A	国寿安保尊诚纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	008873	008874

报告期末下属分级基金的份额总额	2,676,507,744.90 份	2,144,204.68 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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）	
	国寿安保尊诚纯债债券 A	国寿安保尊诚纯债债券 C
1.本期已实现收益	7,252,077.95	2,716.96
2.本期利润	-534,215.94	-3,073.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0002	-0.0014
4.期末基金资产净值	3,161,386,252.03	2,483,960.46
5.期末基金份额净值	1.1812	1.1585

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

国寿安保尊诚纯债债券 A

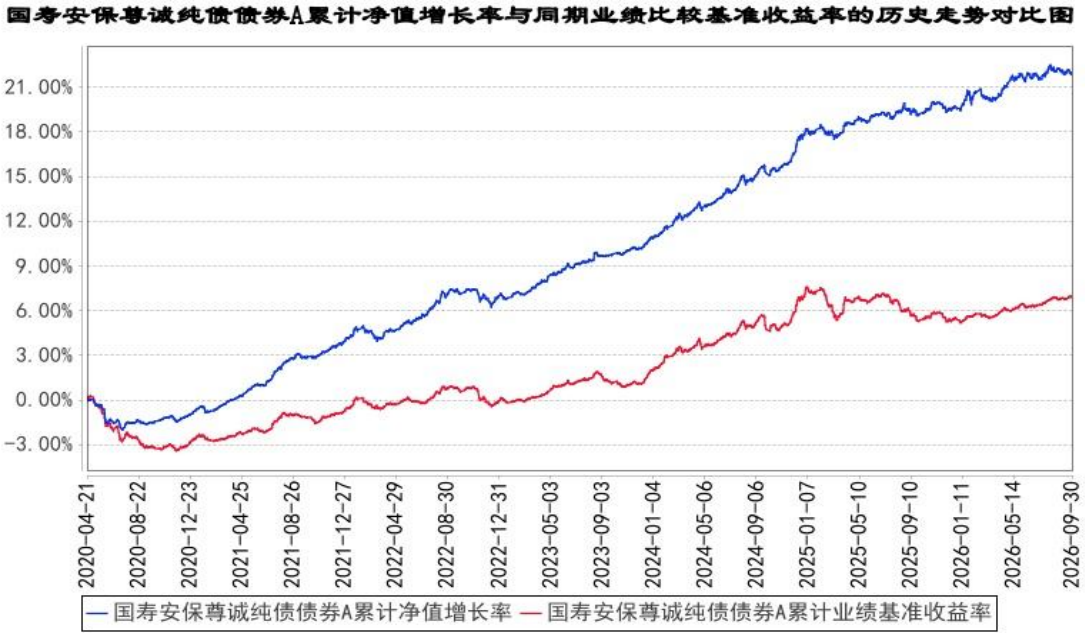
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.04%	0.08%	0.52%	0.03%	-0.56%	0.05%
过去六个月	1.43%	0.09%	1.15%	0.03%	0.28%	0.06%
过去一年	2.20%	0.10%	1.48%	0.04%	0.72%	0.06%
过去三年	10.94%	0.08%	5.66%	0.07%	5.28%	0.01%
过去五年	18.35%	0.08%	8.15%	0.07%	10.20%	0.01%
自基金合同生效起至今	21.82%	0.07%	6.91%	0.07%	14.91%	0.00%

国寿安保尊诚纯债债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.12%	0.08%	0.52%	0.03%	-0.64%	0.05%
过去六个月	1.28%	0.09%	1.15%	0.03%	0.13%	0.06%
过去一年	1.89%	0.10%	1.48%	0.04%	0.41%	0.06%
过去三年	9.91%	0.08%	5.66%	0.07%	4.25%	0.01%
过去五年	16.32%	0.08%	8.15%	0.07%	8.17%	0.01%

自基金合同生效起至今	19.03%	0.07%	6.91%	0.07%	12.12%	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





注：本基金基金合同生效日为 2020 年 04 月 21 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2020 年 04 月 21 日至 2026 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		
高鑫	本基金的基金经理	2021 年 3 月 1 日	-	13 年	硕士，曾就职于中国银行间市场交易商协会，2015 年 4 月加入国寿安保基金管理有限公司。现任国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、国寿安保尊享债券型证券投资基金、国寿安保尊诚纯债债券型证券投资基金和国寿安保安诚纯债一年定期开放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《证券业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《中华人民共和国证券投资基金法》、《国寿安保尊诚纯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，采用不同的时间窗口，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。本报告期内，未发生基金管理人管理的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

2026 年三季度，中东地缘冲突重新推高油价，海外主要经济体同步加息，且市场对美联储进一步加息预期较强，美元指数、美债收益率明显上行。国内方面，经济结构存在一定分化，出口高景气支撑生产，但消费、投资增速仍处在低位，内需尚未形成有效接力。

流动性和政策方面，货币政策延续适度宽松基调，加大逆周期调节力度，侧重运用结构型工具，流动性保持合理充裕，货币市场利率中枢小幅上行。

债券市场方面，三季度收益率震荡下行。季度初，资金面有所收敛，收益率震荡；随后，在基本面数据偏弱、货币政策预期提升、权益市场风险偏好下降等因素影响下，收益率持续下行；9 月，在资金面、稳增长政策预期等影响下，收益率保持震荡。

投资运作方面，本基金在报告期内均衡配置高等级信用债和利率债，灵活调整组合久期和杠杆水平，提高波段操作频率获取资本利得。转债方面灵活调整仓位水平，注重控制回撤。

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诚纯债债券 A 基金份额净值为 1.1812 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.04%；截至本报告期末国寿安保尊诚纯债债券 C 基金份额净值为 1.1585 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.12%；业绩比较基准收益率为 0.52%。

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	3,332,752,555.73	94.95
	其中：债券	3,332,752,555.73	94.95
	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	152,958,575.34	4.36
	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	20,943,309.81	0.60
8	其他资产	3,365,833.18	0.10
9	合计	3,510,020,274.06	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股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	458,542,262.70	14.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,155,970,021.34	68.14
	其中：政策性金融债	1,451,404,213.68	45.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	165,145,734.26	5.22
7	可转债（可交换债）	157,529,868.94	4.98
8	同业存单	395,564,668.49	12.50
9	其他	-	-
10	合计	3,332,752,555.73	105.34

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	112609137	26 浦发银行 CD137	4,000,000	395,564,668.49	12.50
2	2600002	26 超长特别国债 02	3,100,000	317,426,786.89	10.03
3	250405	25 农发 05	2,500,000	252,035,273.97	7.97
4	200205	20 国开 05	2,000,000	214,188,493.15	6.77
5	260205	26 国开 05	1,900,000	194,748,854.79	6.16

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局地方监管分局、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、中国人民银行分支行的处罚；中国农业发展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、国家金融监督管理总局地方监管分局、国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行的处罚；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、中国人民银行分支行的处罚；恒丰银行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分局、国家金融监督管理总局地方监管局、国家外汇管理局、中国人民银行分支行的处罚。

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	52,452.58

2	应收证券清算款	3,313,380.60
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	3,365,833.18

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118030	睿创转债	11,405,644.50	0.36
2	127092	运机转债	11,043,833.77	0.35
3	118010	洁特转债	8,587,637.33	0.27
4	123263	鼎捷转债	7,580,919.17	0.24
5	118042	奥维转债	6,977,018.65	0.22
6	127110	广核转债	6,953,658.48	0.22
7	111004	明新转债	6,811,102.61	0.22
8	113042	上银转债	6,365,862.61	0.20
9	123259	锦浪转 02	6,130,189.90	0.19
10	113691	和邦转债	6,064,981.77	0.19
11	113661	福 22 转债	5,974,007.05	0.19
12	123149	通裕转债	5,784,379.19	0.18
13	123091	长海转债	5,572,681.90	0.18
14	123165	回天转债	5,428,857.55	0.17
15	118034	晶能转债	5,111,147.89	0.16
16	132026	G 三峡 EB2	5,052,599.37	0.16
17	111021	奥锐转债	4,486,396.06	0.14
18	127111	金威转债	3,823,754.56	0.12
19	123183	海顺转债	3,728,290.12	0.12
20	113066	平煤转债	3,548,962.68	0.11
21	113692	保隆转债	3,501,676.61	0.11
22	127108	太能转债	3,306,350.01	0.10
23	110099	福能转债	3,166,624.80	0.10
24	113067	燃 23 转债	3,058,400.22	0.10
25	118065	艾为转债	2,926,702.41	0.09
26	110098	南药转债	2,880,618.77	0.09
27	123257	安克转债	2,825,647.65	0.09

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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	国寿安保尊诚纯债债券 A	国寿安保尊诚纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	2,827,160,381.41	2,158,866.37
报告期期间基金总申购份额	290,811,296.01	-
减：报告期期间基金总赎回份额	441,463,932.52	14,661.69
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	2,676,507,744.90	2,144,204.68

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金基金管理人本报告期未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金交易本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260701~20260930	690,647,738.44	-	-	690,647,738.44	25.78
	2	20260701~20260930	1,521,757,489.56	-	-	1,521,757,489.56	56.81
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。							

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诚纯债债券型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保尊诚纯债债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保尊诚纯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诚纯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

2026 年 10 月 27 日