

国寿安保中证养老产业指数增强型 证券投资基金 清算报告

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

清算报告出具日期：2021年5月31日

清算报告公告日期：2021年6月11日

§ 1 重要提示

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金经中国证监会《关于准予国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】763号）准予募集注册，基金管理人为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金自2015年6月8日至2015年6月19日进行公开募集，募集总额为276,524,524.25元，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》于2015年6月26日生效。

2019年2月18日，国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金修改基金运作方式等事项的议案》，内容包括对本基金基金名称、基金的上市交易、基金的申购与赎回、基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征、基金资产估值、基金的费用、基金的收益分配原则、基金份额的分级、折算、配对转换等条款以及因法律法规变更的部分条款进行修改。

自2019年4月1日起，《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》失效且《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》同时生效。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同的有关规定，基金合同生效后，若出现下列情形之一，基金管理人履行监管报告和信息披露程序后，本基金合同终止：（1）、基金份额持有人大会决定终止的；（2）、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；（3）、基金合同约定的其他情形；（4）、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。本基金于2021年5月20日审议并通过了《关于终止国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并自基金份额持有人大会决议生效公告之日起即2021年5月21日起进入基金财产清算程序，触发基金合同终止事由。

根据《国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金于2021年5月21日起进入基金财产清算程序，由本基金管理人国寿安保基金管理有限公司、基金托管人招商证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组

成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金
基金简称	国寿安保中证养老产业指数增强
基金主代码	168001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月1日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,299,210.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证养老产业指数有效跟踪的基础上，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证养老产业指数为标的指数。本基金主要策略为跟踪标的指数，在跟踪标的指数的基础上一定程度的调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 本基金主要采用量化多因子投资策略实现指数增强，通过对标的指数成分股及其他股票基本面的深入研究，运用多因子模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力争实现超额收益。
业绩比较基准	95%×中证养老产业指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§ 3 基金运作情况

国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），由国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金转型而来，原国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2015]763号文《关于准予国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金注册的批复》的注册，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2015年6月8日至2015年6月19日向社会公开发行募集，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（2015）验字第61090605_A05号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同于2015年6月26日正式生效。国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为276,524,524.25份基金份额。国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金于2019年2月18日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会审议并通过《关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》。《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》自2019年4月1日起生效，原《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。本基金的基金管理人为国寿安保，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司（简称“招商证券”）。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于其他股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等、权证、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股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股指期货和国债期货合约需交纳的交易保证金后，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运

作管理办法》、基金合同的有关规定，基金合同生效后，若出现下列情形之一，基金管理人履行监管报告和信息披露程序后，本基金合同终止：（1）、基金份额持有人大会决定终止的；（2）、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；（3）、基金合同约定的其他情形；（4）、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。本基金于2021年5月20日审议并通过了《关于终止国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并自基金份额持有人大会决议生效公告之日即2021年5月21日起进入基金财产清算程序，触发基金合同终止事由。

根据《国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金于2021年5月21日起进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为2021年5月21日。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表(已经审计)

单位：人民币元

项目	最后运作日 2021 年 5 月 20 日
资产：	
银行存款	1,358,801.42
结算备付金	75,803.29
存出保证金	34,799.82
交易性金融资产	10,522,931.04
其中：债券投资	10,522,931.04
应收利息	8,186.49
资产总计	12,000,522.06
负债：	
应付赎回款	196,545.81
应付管理人报酬	8,981.87
应付托管费	1,796.37
应付交易费用	14,227.19
其他负债	148,181.80
负债合计	369,733.04
所有者权益：	
实收基金	10,778,085.56
未分配利润	852,703.46
所有者权益合计	11,630,789.02
负债和所有者权益总计	12,000,522.06

注：报告截止日 2021 年 5 月 20 日（基金最后运作日），基金份额总额为 8,299,210.11 份，基金份额净值为 1.4014 元。

§ 5 清算情况

自 2021 年 5 月 21 日至 2021 年 5 月 24 日止的清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 75,803.29 元，该款项预期将于清算款划出日前收至托管账户，若于清算款划出日前尚未收至托管账户，将由基金管理人国寿安保基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 34,799.82 元，该款项将于清算款划出日前由基金管理人国寿安保基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 10,522,931.04 元，均已在清算期间变现。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 8,186.49 元，其中应收银行存款利息人民币 8,046.96 元、应收结算备付金利息人民币 47.74 元、应收存出保证金利息人民币 91.79 元，截止清算款划出日前的应收利息由本基金管理人国寿安保基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付的资金将于清算期后的银行结息日后返还给基金管理人。

5.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 196,545.81 元，该款项已分别于 2021 年 5 月 21 日及 2021 年 5 月 24 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 8,981.87 元，该款项将于 2021 年 5 月 24 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,796.37 元，该款项将于 2021 年 5 月 24 日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 14,227.19 元，其中应付银河证券佣金人民币 14,227.19 元将于 2021 年 5 月 24 日后支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 148,181.80 元，其中应付公证费人民币

10,000.00 元已于 2021 年 5 月 21 日支付；应付赎回费人民币 709.30 元已分别于 2021 年 5 月 21 日及 2021 年 5 月 24 日支付；应付律师费人民币 30,000.00 元、应付指数使用费人民币 77,472.50 元及预提审计费人民币 30,000.00 元将于 2021 年 5 月 24 日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年5月21日至2021年5月24日止清算期间
一、清算收益	
1、存款利息收入（注1）	698.18
2、处置交易性金融资产产生的净收益	2,144,752.38
3、公允价值变动损益	-2,266,820.34
4、补缴红利税款	-3,304.67
5、赎回费收入	29.22
清算收入小计	-124,645.23
二、清算费用	
1、交易费用	18,930.34
清算费用小计（注2）	18,930.34
三、清算净收益	-143,575.57

注1：存款利息收入系计提的自2021年5月21日至2021年5月24日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。其中，银行存款利息人民币678.26元、结算备付金利息人民币13.64元及存出保证金利息人民币6.28元。

注2：根据《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2021年5月20日基金净资产	11,630,789.02
加：清算期间净收益	-143,575.57
减：清算期间基金净赎回金额（注1）	23,373.77
二、2021年5月24日基金净资产	11,463,839.68

注1：清算期间基金净赎回金额系清算期间确认的应付赎回款，将于2021年5月24日后支付。

注2：清算期间产生了应付交易费用人民币7,606.25元，其他负债人民币87.63元，应付证券清算款人民币3,304.67元，该部分款项将于2021年5月24日后支付。

资产处置及负债清偿后，于 2021 年 5 月 24 日本基金剩余财产为人民币

11,463,839.68 元。根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体份额持有人所有，将与清算结束日净资产合计并扣除银行汇款手续费后按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

§ 6 其他重要提示

本基金清算结束后，尚未按照本基金管理人于 2019 年 7 月 1 日公告的《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金（原国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金）基金份额确权登记指引》（以下简称《确权登记指引》）办理确权的场内基金份额持有人的清算资金将由本基金管理人暂为保管，投资者需联系本基金管理人提交相关材料，并由本基金管理人确认无误后将相应清算资金划转至投资者指定的银行账户。

未确权的投资者办理清算资金收取所需流程如下：

一、开立国寿安保基金/中国登记结算公司账户：

投资者需在有效代销渠道开立国寿安保基金开放式基金账户或中国登记结算公司深圳分公司开放式基金账户，开通账户证件号码需与原场内所用证件号码保持一致。

二、投资者向本基金管理人提交申请资料：

1、个人投资者

1) 投资者本人签名的有效身份证明文件正反面复印件（备注“确权”，需与场内购买本基金所用证件一致）；

2) 本人签名的股东账户卡或证券投资基金账户卡复印件；

3) 本人签名的有效银行卡正反面复印件；

4) 银行开具的银行卡证明；

5) 填妥的确权申请表（申请表请见《确权登记指引》件）；

6) 若由代办人为办理确权业务的，需同时提供《确权业务授权委托书》，及被授权人正反两面签字的身份证复印件；

7) 为办理确权所需的其他资料。

2、机构/产品投资者

- 1) 机构投资者加盖公章的有效证件复印件（如营业执照、社会信用代码证等，需与场内购买本基金所用证件一致，并备注“确权”）；
- 2) 深圳证券交易所 A 股账户卡或证券投资基金账户卡复印件（加盖单位公章）；
- 3) 银行账户证明文件（加盖单位公章）；
- 4) 经办人（被授权人）身份证件正反面复印件（加盖单位公章）；
- 5) 填妥的机构确权申请表（申请表请见《确权登记指引》）；
- 6) 为办理确权所需的其他资料。

三、投资者可通过以下方式将申请资料发送至本基金管理人：

- 1) 电子传真：010-50850777
 - 2) 电子邮箱：service@gsfunds.com.cn（主题：国寿养老基金确权+姓名）
 - 3) 邮寄地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 10 层客服中心收，邮政编码：100033，电话：010-50850723（请注明“确权”）
- 咨询电话：4009-258-258

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 7.1.1 国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 7.1.2 关于国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金清算报告的法律意见书

7.2 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

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 6 月 11 日