

国寿安保裕祥混合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:浙商银行股份有限公司
清算报告出具日期:2023年4月20日
清算报告公告日期:2023年4月25日

§1 重要提示

国寿安保裕祥混合型证券投资基金(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[2021]1830号《关于准予国寿安保裕祥混合型证券投资基金注册的批复》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《国寿安保裕祥混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期为2021年11月24日至2022年2月23日,共募集200,639,368.28份,其中,国寿安保裕祥混合型证券投资基金A类基金份额募集32,534,312.71份,国寿安保裕祥混合型证券投资基金C类基金份额募集168,105,055.57份,有效认购户数为260户。经向中国证监会备案,《国寿安保裕祥混合型证券投资基金基金合同》于2022年2月24日正式生效。

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》以及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,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:(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。本基金基金份额持有人大会于2023年3月27日表决通过了《关于终止国寿安保裕祥混合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2023年3月28日起进入基金财产清算程序,已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裕祥混合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2023年3月28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、基金托管人浙商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(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,并由普华永道中天会计师事务所(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	国寿安保裕祥混合型证券投资基金	
基金简称	国寿安保裕祥混合	
基金代码	012665	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2022年3月24日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,639,478.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基本名称	国寿安保裕祥混合A	国寿安保裕祥混合C
下属分级基金的代码	012665	012666
报告期末下属分级基金的份额总额	10,639,478.87份	7,981.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	以追求稳健收益作为基金的投资目标,通过严格的风险控制,力争实现基金资产的稳健增值。	
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,动态调整资产配置,在符合各项投资限制的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。在本类资产配置上,本基金将优先考虑债券类资产配置,剩余资产配置于股票类资产。除主要的股票及债券类资产外,本基金还可适当配置于商品、货币、权证、股指期货、国债期货、期权等金融衍生品。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+恒生指数收益率*5%+上证国债指数收益率*75%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。本基金将投资于港股通标的股票,需承担汇率风险和境外市场的风险。	

§3 基金运作情况说明

国寿安保裕祥混合型证券投资基金(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[2021]1830号《关于准予国寿安保裕祥混合型证券投资基金注册的批复》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《国寿安保裕祥混合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200,635,508.31元,业经普华永道中

天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0181号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保裕祥混合型证券投资基金基金合同》于2022年2月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,639,368.28份基金份额,其中认购资金利息折合3,859.97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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《国寿安保裕祥混合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,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基金份额类别称为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,在赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额类别称为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《国寿安保裕祥混合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金融工具,包括国内依法发行上市股票(包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、公开发行的次级债券、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、证券公司短期公司债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、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)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品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相关规定)。本基金可以参与融资交易。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为5%-50%,其中,投资于港股通标的股票占股票资产的比例为0-45%;本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%;本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资的信用债券,经国内信用评级机构认定的主体评级须在AA+(含AA+)以上。主体评级为AAA的信用债投资占信用债资产的比例为50%-100%;主体评级为AA+的信用债投资占信用债资产的比例为0-50%。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级(具体评级机构名单以基金管理人确认为准)。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券,基金管理人将结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定,以基金管理人的判断结果为准。本基金的投资范围包括港股通标的股票,基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*20%+恒生指数收益率*5%+上证国债指数收益率*75%。

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》以及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,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:(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。本基金基金份额持有人大会于2023年3月27日表决通过了《关于终止国寿安保裕祥混合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2023年3月28日起进入基金财产清算程序,已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裕祥混合型证券投资基金基金份额持有

股东大会决议结果暨决议生效公告》,本基金于2023年3月28日起进入基金财产清算程序,故本基金清算起始日为2023年3月28日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表(已经审计)

单位:人民币元

	最后运作日 2023年3月27日
资产:	
银行存款	7,021,008.31
结算备付金	55,325.26
存出保证金	12,396.73
交易性金融资产	2,160,691.94
其中:股票投资	2,160,691.94
应收清算款	73,593.54
资产总计	9,323,015.78
负债:	
应付赎回款	924.79
应付管理人报酬	4,825.24
应付托管费	689.29
应付销售服务费	0.27
其他负债	106,946.83
负债合计	113,386.42
所有者权益:	
实收基金	10,043,659.38
未分配利润	-834,030.02
所有者权益合计	9,209,629.36
负债和所有者权益总计	9,323,015.78

注:报告截止日2023年3月27日(基金最后运作日),基金份额总额10,043,659.38份,其中国寿安保裕祥混合A基金份额总额10,036,078.07份,基金份额净值0.9170元;国寿安保裕祥混合C基金份额总额7,581.31份,基金份额净值0.9191元。

§5 清算情况

自2023年3月28日至2023年4月7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)本基金最后运作日银行存款为人民币7,021,008.31元,其中应计利息为475.54元。
- (2)本基金最后运作日结算备付金人民币55,325.26元(其中应计利息为17.36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。
- (3)本基金最后运作日出保证金人民币12,396.73元(其中应计利息为3.92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。
- (4)本基金最后运作日交易性金融资产人民币2,160,691.94元,均已在清算期间变现。
- (5)本基金最后运作日应收清算款人民币73,593.54元,该款项已于2023年3月28日划入基金托管账户。

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924.79元,该款项已分别于2023年3月28日及2023年3月29日支付。
- (2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币4,825.24元,该款项已于2023年4月6日支付。
- (3)本基金最后运作日应付托管费为人民币689.29元,该款项已于2023年4月6日支付。
- (4)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币0.27元,该款项已于2023年4月6日支付。

- (5)本基金最后运作日其他负债为人民币106,946.83元,其中应付持有人大会公证费人民币10,000.00元已于2023年3月28日支付;应付交易费用人民币16,946.83元,其中8,569.52元已于2023年3月31日支付,剩余部分将于2023年4月7日后支付;应付持有人大会和清算律师费人民币40,000.00元,应付2022年审计费人民币30,000.00元及预提清盘审计费人民币10,000.00元将于2023年4月7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2023年3月28日至 2023年4月7日止清算期间
一、清算收益	
1.存款利息收入(注1)	939.56
2.处置交易性金融资产产生的净收益	-101,416.11
3.公允价值变动损益	157,726.19
4.赎回费收入	0.00
清算收入小计	37,249.64
二、清算费用	
清算费用小计(注2)	0.00
三、清算净收益	37,249.64

注1:存款利息收入系计提的自2023年3月28日至2023年4月7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906.20元、结算备付金利息人民币27.28元及存出保证金利息人民币6.08元。

注2: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,根据基金合同的规定,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2023年3月27日基金净资产	9,209,629.36
加:清算期间的净收益	37,249.64
减:清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数(净增减以“-”号填列)	0.00
二、2023年4月7日基金净资产	9,246,879.00

资产处置及负债清偿后,于2023年4月7日本基金剩余财产为人民币9,246,879.00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。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核,在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§6 备查文件目录

- 6.1 备查文件目录
- 6.1.1 国寿安保裕祥混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于国寿安保裕祥混合型证券投资基金清算报告的法律意见书
- 6.2 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

6.3 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。
国寿安保裕祥混合型证券投资基金基金财产清算小组
2023年4月20日