
国寿安保灵活优选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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2023年9月8日

清算报告公告日期：2023年9月13日



§ 1 重要提示

国寿安保灵活优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),是由国寿安保保本混合型证券投资基金转型而来,国寿安保保本混合型证券投资基金系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[2015]2250号《关于准予国寿安保保本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《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币620,933,422.78元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第61090605_A02号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年04月06日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为621,158,608.70份基金份额,其中认购资金利息折合225,185.92份基金份额。国寿安保保本混合型证券投资基金每3年为一个保本周期,第一个保本周期自2016年4月6日起至2019年4月8日止。根据《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,国寿安保保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后,未能符合存续条件,于2019年4月12日国寿安保保本混合型证券投资基金变更为国寿安保灵活优选混合型证券投资基金。原《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》失效,《国寿安保灵活优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)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8月21日表决通过了《关于终止国寿安保灵活优选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并自2023年8月24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灵活优选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8月24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、基金托管人中国银行股份有限公司、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	国寿安保灵活优选混合型证券投资基金
基金简称	国寿安保灵活优选混合
基金主代码	001932
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月12日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过对宏观经济和资本市场的深入分析，采用主动的投资管理策略，把握不同时期各金融市场的收益水平，在约定的投资比例下，灵活配置股票、债券、货币市场工具等各类资产，在有效控制下行风险的前提下，为投资人获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略注重将定性资产配置和定量资产配置进行有机的结合，根据经济情景、类别资产收益风险预期等因素，确定不同阶段基金资产中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求绝对收益，回避市场风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数*20%+中证全债指数*80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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和债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险收益的投资品种。

§ 3 基金运作情况说明

国寿安保灵活优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，是由国寿安保保本混合型证券投资基金转型而来，国寿安保保本混合型证券投资基金系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[2015]2250号《关于准予国寿安保保本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《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 620,933,422.78 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第 61090605_A02 号予以验证。经向中国证监会备案，《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 04 月 06 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 621,158,608.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 225,185.92 份基金份额。国寿安保保本混合型证券投资基金每 3 年为一个保本周期，第

一个保本周期自 2016 年 4 月 6 日起至 2019 年 4 月 8 日止。根据《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，国寿安保保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后，未能符合存续条件，于 2019 年 4 月 12 日国寿安保保本混合型证券投资基金变更为国寿安保灵活优选混合型证券投资基金。原《国寿安保保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《国寿安保灵活优选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）生效。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为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保灵活优选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的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、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、证券公司短期公司债、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、权证、债券回购、银行存款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）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-40%，其余资产占基金资产的比例为 60%-100%；持有不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：20%*沪深 300 指数+80%*中证全债指数。

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 8 月 21 日表决通过了《关于终止国寿安保灵活优选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并自 2023 年 8 月 24 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灵活优选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 8 月 24 日起进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为 2023 年 8 月 24 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8月23日
资产：	
银行存款	637,493.16
结算备付金	142,607.84
存出保证金	3,121.50
交易性金融资产	8,987,257.93
其中：债券投资	8,987,257.93
买入返售金融资产	2,100,331.27
应收清算款	1,013,450.14
资产总计	12,884,261.84
负债：	
应付清算款	57.50
应付赎回款	194,133.98
应付管理人报酬	6,682.36
应付托管费	2,088.21
其他负债	96,803.61
负债合计	299,765.66
所有者权益：	
实收基金	10,690,269.28
未分配利润	1,894,226.90
所有者权益合计	12,584,496.18
负债和所有者权益总计	12,884,261.84

注：报告截止日 2023 年 8 月 23 日（基金最后运作日），基金份额总额 10,690,269.28 份，基金份额净值 1.1772 元。

§ 5 清算情况

自 2023 年 8 月 24 日至 2023 年 8 月 28 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 637,493.16 元，其中应计利息为 832.40 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 142,607.84 元（其中应计利息为 217.15 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) 本基金最后运作日存出保证金人民币 3,121.50 元（其中应计利息为 6.63 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 8,987,257.93 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 1,013,450.14 元，该款项已于 2023 年 8 月 24 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 194,133.98 元，该款项已于 2023 年 8 月 24 日及 2023 年 8 月 25 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 6,682.36 元，该款项将于 2023 年 8 月 28 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,088.21 元，该款项将于 2023 年 8 月 28 日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付清算款为人民币 57.50 元，该款项已于 2023 年 8 月 24 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 96,803.61 元，其中应付交易费用人民币 228.01 元将于 2023 年 8 月 28 日后支付；预提审计费 19,314.65 元将于 2023 年 8 月

28 日后支付；预提信披费 77,260.95 元已于 2023 年 8 月 24 日冲回。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年8月24日至 2023年8月28日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	922.48
2、处置交易性金融资产产生的净收益	-5,833.43
3、公允价值变动损益	-3,068.59
清算收入小计	-7,979.54
二、清算费用	
清算费用小计（注2）	-39,035.60
三、清算净收益	31,056.06

注1：利息收入系计提的自2023年8月24日至2023年8月28日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及买入返售金融资产利息收入。其中，银行存款利息人民币440.91元、结算备付金利息人民币32.05元、存出保证金利息人民币0.70元及买入返售金融资产利息收入448.82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。其中，冲回信披费人民币77,260.95元、预提审计费人民币685.35元、预提律师费人民币30,000元，支付公证费人民币7,500元、支付划款手续费人民币40.00元

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8月23日基金净资产	12,584,496.18
加：清算期间净收益	31,056.06
加：清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-99,227.31
二、2023年8月28日基金净资产	12,516,324.93

资产处置及负债清偿后，于 2023 年 8 月 28 日本基金剩余财产为人民币 12,516,324.93 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 国寿安保灵活优选混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 关于国寿安保灵活优选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。

国寿安保灵活优选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年9月8日