
国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2026年4月17日

清算报告公告日期：2026年4月21日

§ 1 重要提示

国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金（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[2025]335号《关于准予国寿安保尊悦纯债债券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（以下简称“国寿安保”）于2025年8月1日至2025年9月29日向社会公开募集。经向中国证监会报送基金备案材料，基金合同于2025年10月9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。根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。”截至2026年3月30日终，本基金基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由。根据《基金合同》的有关约定，本基金将进入基金财产清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。

根据《国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2026年3月31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、基金托管人招商银行股份有限公司、容诚会计师事务所（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，并由容诚会计师事务所（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	国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金
基金简称	国寿安保尊悦纯债债券
基金主代码	023694

基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年10月9日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
基金最后运作日（2026年3月30日）基金份额总额	4,889,545.78份	
下属分级基金的基金简称	国寿安保尊悦纯债债券A	国寿安保尊悦纯债债券C
下属分级基金的交易代码	023694	023695
基金最后运作日（2026年3月30日） 下属分级基金的份额总额	1,115,583.10份	3,773,962.68份

2.2 基金产品说明

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创造高于业绩比较基准的投资收益。
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投资策略，主要包括：类属资产配置策略、利率预期策略、利率品种投资策略、信用债投资策略、分散投资策略、回购套利策略、国债期货交易策略、信用衍生品投资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。

§ 3 基金运作情况说明

国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金(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[2025]335号《关于准予国寿安保尊悦纯债债券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《国寿安保尊悦纯债债券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261,221,070.12元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字(2025)第100Z0064号予以验证。经向中国证监会备案，《国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金基金合同》于2025年10月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为261,358,636.39份基金份额，其中认购资金利息折合137,566.27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(以下简称“国寿安保”),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《国寿安保尊悦纯债债券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,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,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《国寿安保尊悦纯债债券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债券(包括国债、中央银行票据、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、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、同业存单、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)、货币市场工具、国债期货、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的相关规定)。本基金不投资于股票,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。本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%,每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值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:中债综合(全价)指数收益率。

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。根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定:“《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金

管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。”截至 2026 年 3 月 30 日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由。根据《基金合同》的有关约定，本基金将进入基金财产清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。

根据《国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2026 年 3 月 31 日起进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为 2026 年 3 月 31 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 2026年3月30日
资产：	
货币资金	930,874.55
交易性金融资产	5,045,046.58
其中：债券投资	5,045,046.58
资产总计	5,975,921.13
负债：	
卖出回购金融资产款	1,000,040.27
应付管理人报酬	1,833.03
应付托管费	458.27
应付销售服务费	1,369.53
应交税费	162.56
其他负债	57,802.92
负债合计	1,061,666.58
净资产：	
实收资金	4,889,545.78
未分配利润	24,708.77
净资产合计	4,914,254.55
负债和净资产总计	5,975,921.13

注：报告截止日 2026 年 3 月 30 日（基金最后运作日），基金份额总额 4,889,545.78 份，其中国寿安保尊悦纯债债券 A 基金份额总额 1,115,583.10 份，基金份额净值 1.0059 元；国寿安保尊悦纯债债券 C 基金份额总额 3,773,962.68 份，基金份额净值 1.0048 元。

§ 5 清算情况

自 2026 年 3 月 31 日至 2026 年 4 月 1 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 930,874.55 元，其中应计利息为 58.69 元。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 5,045,046.58 元，均已在清算期间变现。

5.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日卖出回购金融资产为人民币 1,000,040.27 元，已于 2026 年 3 月 31 日到期。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,833.03 元，该款项将于 2026 年 4 月 1 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 458.27 元，该款项将于 2026 年 4 月 1 日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,369.53 元，该款项将于 2026 年 4 月 1 日后支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 162.56 元，该款项该款项将于 2026 年 4 月 1 日后支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 57,802.92 元，其中应付交易费用人民币 7,230.54 元，其他应付款人民币 400.00 元，银行汇划费人民币 372.38 元，应付律师费人民币 12,000.00 元，预提审计费 25,800.00 元，预提银行间账户维护费 12,000.00 元，上述款项将于取得发票及缴费单据后按实际金额支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2026年3月31日至 2026年4月1日止清算期间
----	--------------------------------

一、清算收益	
1、存款利息收入	43.30
2、处置交易性金融资产产生的净收益	522.90
3、公允价值变动损益	-1,100.00
清算收入小计	-533.80
二、清算费用	
1、税金及附加	0.30
2、其他费用	34.79
清算费用小计	35.09
三、清算净收益	-568.89

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2026年3月30日基金净资产	4,914,254.55
加：清算期间净收益	-568.89
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）	-1,739,491.95
二、2026年4月1日基金净资产	3,174,193.71

资产处置及负债清偿后，于2026年4月1日本基金剩余财产为人民币3,174,193.71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 国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于国寿安保尊悦纯债债券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。



国寿安保尊悦纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2026年4月21日