

# 国寿安保安享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：南京银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年11月29日

清算报告公告日期：2022年12月8日



## § 1 重要提示

国寿安保安享纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），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〔2016〕2279号文《关于准予国寿安保安享纯债债券型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（以下简称“国寿安保”）于2016年10月17日至2016年10月18日向社会公开募集，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年10月19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，《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2022年11月15日表决通过了《关于终止国寿安保安享纯债债券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2022年11月16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《国寿安保安享纯债债券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2022年11月16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、基金托管人南京银行股份有限公司、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	国寿安保安享纯债债券型证券投资基金
基金简称	国寿安保安享纯债债券
基金主代码	003514
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月19日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,014,966.14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
------	-----------------------------------



	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、回购套利策略投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债综合（全价）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于证券投资基金中的中低预期收益/风险品种。





### § 3 基金运作情况说明

国寿安保安享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〔2016〕2279号《关于准予国寿安保安享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《国寿安保安享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200,043,485.38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\_A06号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金合同》于2016年10月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,043,485.46份基金份额,其中认购资金利息折合0.08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,基金托管人为南京银行股份有限公司(以下简称“南京银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保安享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,包括国家债券、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、资产支持证券、证券公司短期公司债券、同业存单、债券回购、可分离交易可转债的纯债部分、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),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、权证等权益类资产,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。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金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,《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



---

于 2022 年 11 月 15 日表决通过了《关于终止国寿安保安享纯债债券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 2022 年 11 月 16 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《国寿安保安享纯债债券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 2022 年 11 月 16 日起进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为 2022 年 11 月 16 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 2022年11月15日
<b>资产：</b>	
银行存款	194,108.79
结算备付金	9.46
存出保证金	2,800.69
交易性金融资产	1,919,372.19
其中：债券投资	1,919,372.19
应收申购款	1,738.61
资产总计	2,118,029.74
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	248.99
应付托管费	82.99
其他负债	40,000.00
负债合计	40,331.98
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	2,014,966.14
未分配利润	62,731.62
所有者权益合计	2,077,697.76
负债和所有者权益总计	2,118,029.74

注：报告截止日 2022 年 11 月 15 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0311 元，基金份额总额 2,014,966.14 份。





## § 5 清算情况

自 2022 年 11 月 16 日至 2022 年 11 月 21 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 194,108.79 元，其中应计利息为 73.00 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 9.46 元（其中应计利息为 9.46 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 2,800.69 元（其中应计利息为 7.08 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 1,919,372.19 元，均已在清算期间变现。

(5) 本基金最后运作日应收申购款 1,738.61 元，该款项已于 2022 年 11 月 16 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管理人报酬为人民币 248.99 元，该款项已于 2022 年 11 月 17 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 82.99 元，该款项已于 2022 年 11 月 17 日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币 40,000.00 元，为应付持有人大会费和清算费用合计人民币 40,000.00 元；其中应付持有人大会公证费人民币 10,000.00 元已于 2022 年 11 月 17 日支付，其他应付持有人大会费和清算费用将于 2022 年 11 月 21 日后支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币



项目	自 2022 年 11 月 16 日至 2022 年 11 月 21 日止清算期间
一、清算收益（损失以“-”号填列）	
1、存款利息收入（注 1）	26.59
2、处置交易性金融资产产生的净收益	-5,853.04
3、公允价值变动收益	6,156.00
4、赎回费收入	118.32
清算收益小计	447.87
二、清算费用	
清算费用小计（注 2）	0.00
三、清算净收益（损失以“-”号填列）	447.87

注 1: 存款利息收入系计提的自 2022 年 11 月 16 日至 2022 年 11 月 21 日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。其中, 银行存款利息人民币 25.81 元, 存出保证金利息人民币 0.78 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 2022 年 11 月 15 日基金净资产	2,077,697.76
加: 清算期间净收益（损失以“-”号填列）	447.87
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）	-101,594.68
二、2022 年 11 月 21 日基金净资产	1,976,550.95

资产处置及负债清偿后, 于 2022 年 11 月 21 日本基金剩余财产为人民币 1,976,550.95 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 国寿安保安享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 关于国寿安保安享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。

国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 12 月 8 日



陆希希