

国寿安保稳健回报混合型证券投资基金清算报告

国寿安保稳健回报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：上海浦东发展银行股份有限公司
清算报告出具日期：2018年12月17日
清算报告公告日期：2019年1月24日

§ 1 重要提示

国寿安保稳健回报混合型证券投资基金（简称“本基金”），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]1689号文《关于准予国寿安保稳健回报混合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（简称“国寿安保”）于2015年11月23日至2015年11月25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2015年11月26日正式生效。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：《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人民币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60个工作日出现前述情形的，基金管理人在履行适当程序后，本基金合同将终止并根据约定清算，而无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

截至2018年9月26日日终，本基金基金份额持有人数已连续60个工作日低于200人，已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。

根据《国寿安保稳健回报混合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2018年9月27日起进入清算程序，由本基金管理人国寿安保基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、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 国寿安保稳健回报混合型证券投资基金
基金简称 国寿安保稳健回报混合
基金主代码 001846
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2015年11月26日

基金管理人 国寿安保基金管理有限公司

基金托管人 上海浦东发展银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 299,611,155.34 份

基金合同存续期 不定期

下属分级基金的基金简称： 国寿安保稳健回报混合 A 国寿安保稳健回报混合 C

下属分级基金的交易代码： 001846 002312

报告期末下属分级基金的份额总额 299,610,997.97 份 157.37 份

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，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，力争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 中债综合（全价）指数收益率×80%+ 沪深 300 指数收益率×20%

风险收益特征 本基金为混合型基金，股票资产占基金资产的比例为 0%-40%。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

国寿安保稳健回报混合型证券投资基金（简称“本基金”），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]1689 号文《关于准予国寿安保稳健回报混合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（简称“国寿安保”）于 2015 年 11 月 23 日至 2015 年 11 月 25 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 2015 年 11 月 26 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金根据收费方式的不同划分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额收取申购费和赎回费，不收取销售服务费；C 类基金份额收取销售服务费和赎回费，不收取申购费。首次募集规模为 200,403,550.87 份 A 类基金份额，有效认购户数为 223 户。本基金自 2016 年 1 月 4 日起新增 C 类份额，C 类份额不设募集期。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算和公告基金份额净值，投资者在申购时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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）、权证等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（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、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款等）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）。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-40%。本基金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。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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人民币 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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人履行适当程序后，本基金合同将终止并根据约定清算，而无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

截至 2018 年 9 月 26 日日终，本基金基金份额持有人数已连续 60 个工作日低于 200 人，已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。

根据《国寿安保稳健回报混合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 2018 年 9 月 27 日起进入清算程序，故本基金清算起始日为 2018 年 9 月 27 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

2018 年 9 月 26 日

资 产：

银行存款 20,701,381.96

结算备付金 22,184.65

存出保证金 118,096.65

交易性金融资产 326,044,110.00

其中：债券投资 326,044,110.00

应收利息 6,596,004.57

应收申购款 -

资产总计 353,481,777.83

负 债：

应付证券清算款 18,201,585.72

应付赎回款 3,378.42

应付管理人报酬 143,027.01

应付托管费 42,908.12

应付交易费用 5,535.08

应付销售服务费 0.19

应交税费 29,846.77

其他负债 103,697.93

负债合计 18,529,979.24

所有者权益：

实收基金 299,611,155.34

未分配利润 35,340,643.25

所有者权益合计 334,951,798.59

负债和所有者权益总计 353,481,777.83

§ 5 清算情况

自 2018 年 9 月 27 日至 2018 年 12 月 10 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

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金人民币 22,184.65 元，该款项已于 2018 年 11 月 2 日划入本基金托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 118,096.65 元，该款项已于 2018 年 10 月 9 日划入本基金托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 326,044,110.00 元，全部为债券投资，除如下债券外，其余债券均已在清算期间变现。如下债券虽尚未到期，但其发行人发行的“15 华阳经贸 MTN001”于本基金清算期间发生实质性违约，导致该发行人发行的其他债券评级下调，估值大幅度降低，且无法进行转让或交易，存在本金及利息到期无法收回的风险。

单位：人民币元

债券

代码 债券

名称 最后运作日

估值单价 数量

(单位:份) 最后运作日

成本总额 最后运作日

估值总额

136794 16 华阳 01 96.15 300,000.00 30,000,000.00 28,845,000.00

待发行人违约事项处置完毕且如上债券恢复流动性后，基金管理人将及时变现该债券，并向基金份额持有人分配。于 2018 年 12 月 17 日，本基金持有流动性受限债券尚未处置完毕。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息人民币 6,596,004.57 元，其中应收银行存款利息人民币 1,295.85 元、应收结算备付金利息人民币 6.00 元、应收存出保证金利息人民币 31.92 元及应收债券利息人民币

6,594,670.80 元。其中应收债券利息已于清算期间全部收回，应收银行存款利息、应收结算备付金利息及应收存出保证金利息预计将于清算款划出前的银行结息日收回并届时向基金份额持有人分配。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 18,201,585.72 元，该款项已于 2018 年 9 月 27 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 3,378.42 元，该款项已分别于 2018 年 9 月 27 日及 2018 年 9 月 28 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 143,027.01 元、应付托管费人民币 42,908.12 元、应付销售服务费人民币 0.19 元、应交税费人民币 29,846.77 元，以上款项已于 2018 年 10 月 10 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 5,535.08 元，该款项已于 2018 年 10 月 15 日及 2018 年 10 月 17 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 103,697.93 元，其中应付上海证券报信息披露费人民币 73,697.93 元及应付审计费用人民币 30,000.00 元计划于清算款划出前支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2018 年 9 月 27 日至

2018 年 12 月 10 日止清算期间

一、清算收益

1、存款利息收入（注 1） 212,866.13

2、债券利息收入 2,877,205.14

3、处置交易性金融资产产生的净损失 -1,096,343.08

4、公允价值变动损失（注 2） -14,953,958.97

清算损失小计 -12,960,230.78

二、清算费用

1、律师费 30,000.00

2、税金及附加 8,398.49
3、其他费用 16,965.94
清算费用小计（注 3） 55,364.43
三、清算净损失 -13,015,595.21

注 1：存款利息收入系计提的自 2018 年 9 月 27 日至 2018 年 12 月 10 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。

注 2：其中“16 华阳 01”清盘期间公允价值变动损益为-15,903,000.00 元。

注 3：根据《国寿安保稳健回报混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，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 2018 年 9 月 26 日基金净资产 334,951,798.59
加：清算期间净损失 -13,015,595.21
减：清算期间基金净赎回金额（注 1） 553.50
二、2018 年 12 月 10 日基金净资产 321,935,649.88

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，已于清算期间全部支付。

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 12 月 10 日本基金剩余财产为人民币 321,935,649.88 元。其中现金资产 308,871,840.66 元，流动性受限债券资产 12,942,000.00 元，应收利息 276,665.65 元，负债合计 154,856.43 元。根据本基金的基金合同约定及《国寿安保稳健回报混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，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 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 6.1.1 国寿安保稳健回报混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于国寿安保稳健回报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。

国寿安保稳健回报混合型证券投资基金基金财产清算组

2019 年 1 月 24 日