

国寿安保稳恒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：2019年9月5日

清算报告公告日期：2019年9月23日

§ 1 重要提示

国寿安保稳恒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]1760号文《关于准予国寿安保稳定回报混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2015年9月14日至2015年9月24日向募集对象公开募集，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年9月29日正式生效。经中国证监会证监许可[2017]254号文《关于准予国寿安保稳定回报混合型证券投资基金变更注册的批复》的核准，国寿安保稳定回报混合型证券投资基金变更注册为国寿安保稳恒混合型证券投资基金。

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》、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，基金管理人履行监管报告和信息披露程序后，本基金合同终止：（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。本基金于2019年4月8日审议并通过了《关于终止国寿安保稳恒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2019年4月9日起进入基金财产清算程序，触发基金合同终止事由。

根据《国寿安保稳恒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2019年4月9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	国寿安保稳恒混合型证券投资基金
基金简称	国寿安保稳恒混合
基金主代码	001845
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月29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	65,749,001.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保稳恒混合 A	国寿安保稳恒混合 C
下属分级基金的交易代码:	001845	002309
报告期末下属分级基金的份额总额	65,630,614.73 份	118,386.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过分析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，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×75%+沪深300指数收益率×25%。
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

国寿安保稳恒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]1760号文《关于准予国寿安保稳定回报混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2015年9月14日至2015年9月24日向募集对象公开募集，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年9月29日正式生效。经中国证监会证监许可[2017]254号文《关于准予国寿安保稳定回报混合型证券投资基金变更注册的批复》的核准，国寿安保稳定回报混合型证券投资基金变更注册为国寿安保稳恒混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。首次募集规模为208,853,713.72份A类基金份额，本基金A类基金份额收到的实收基金合计人民币208,853,713.72元。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，投资人可自行选择认/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。基金管理人可在符合法律法规且不损害已有基金份额持有人权益的情况下，调整基金份额类别的设置、费率水平及其他具体规则，且无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须在开始调整之日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

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）、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、权证、股指期货、国债期货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%；每个交易日日终在

扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，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《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》、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，基金管理人履行监管报告和信息披露程序后，本基金合同终止：（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。本基金于 2019 年 4 月 8 日审议并通过了《关于终止国寿安保稳恒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 2019 年 4 月 9 日起进入基金财产清算程序，触发基金合同终止事由。

根据《国寿安保稳恒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 2019 年 4 月 9 日起进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为 2019 年 4 月 9 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 2019年4月8日
资产：	
银行存款	250,432,783.46
结算备付金	1,070,523.29
存出保证金	118,109.19
交易性金融资产	60,294,696.60
其中：债券投资	60,294,696.60
应收利息	2,091,371.75
应收证券清算款	30,001,577.05
资产总计	344,009,061.34
负债：	
应付赎回款	270,006,395.25
应付管理人报酬	45,211.42
应付托管费	13,563.42
应付交易费用	91,842.91
应付销售服务费	2.96
应交税费	2,240.95
其他负债	112,000.00
负债合计	270,271,256.91
所有者权益：	
实收基金	65,749,001.34
未分配利润	7,988,803.09
所有者权益合计	73,737,804.43
负债和所有者权益总计	344,009,061.34

§ 5 清算情况

自 2019 年 4 月 9 日至 2019 年 8 月 26 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) 本基金最后运作日结算备付金人民币 1,070,523.29 元，该款项已分别于 2019 年 5 月 7 日及 2019 年 6 月 4 日转入本基金托管账户。
- (2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 118,109.19 元，该款项已于 2019 年 5 月 7 日转入本基金托管账户。
- (3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 60,294,696.60 元，其明细如下表所示，均已在清算期间变现。

金额单位：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
110053	苏银转债	109.99	1,320.00	132,000.00	145,186.80
110054	通威转债	100.00	370.00	37,000.00	37,000.00
110055	伊力转债	127.09	620.00	62,000.00	78,795.80
113529	绝味转债	125.03	200.00	20,000.00	25,006.00
123022	长信转债	100.00	360.00	36,000.00	36,000.00
127011	中鼎转 2	120.36	280.00	28,000.00	33,700.80
128055	长青转 2	145.66	920.00	92,000.00	134,007.20
112533	17 海药 01	99.92	300,000.00	30,000,000.00	29,976,000.00
101653036	16 协鑫智慧 MTN002	99.43	300,000.00	29,592,648.50	29,829,000.00
合 计			604,070.00	59,999,648.50	60,294,696.60

- (4) 本基金最后运作日应收利息人民币 2,091,371.75 元，其中应收债券利息人民币 2,048,362.76 元，已于债券卖出、兑付或回售时收回；应收银行存款利息人民币 41,207.47 元、应收结算备付金利息人民币 1,691.39 元、应收存出保证金利息人民币 110.13 元，已于 2019 年 6 月 21 日收回。
- (5) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 30,001,577.05 元，该款项已于 2019 年 4 月 9 日收回并划入本基金托管账户。

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 270,006,395.25 元，该款项已分别于 2019 年 4 月 9 日及 2019 年 4 月 10 日支付。

- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币45,211.42元，该款项已于2019年5月8日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币13,563.42元，该款项已于2019年5月8日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币2.96元，该款项已于2019年5月8日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币91,842.91元，其中应付天风证券交易费用人民币82,776.10元已于2019年8月13日支付；应付上交所结算手续费人民币3,590.00元、应付中债登结算手续费人民币3,110.00元、应付外汇中心交易手续费人民币2,366.81元已于2019年4月15日和2019年7月12日支付。
- (6) 本基金最后运作日应交税费为人民币2,240.95元，该款项已于2019年5月8日支付。
- (7) 本基金最后运作日其他负债为人民币112,000.00元，其中其他应付款人民币10,000.00元已于2019年4月10日支付；应付中债登账户服务费人民币6,000.00元、应付上交所账户服务费人民币6,000.00元已于2019年4月15日和2019年7月12日支付；应付证券时报信息披露费人民币30,000.00元、应付律师费用人民币30,000.00元及应付审计费用人民币30,000.00元将于2019年8月26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 2019 年 4 月 9 日至 2019 年 8 月 26 日止清算期间
一、清算收益	
1、存款利息收入（注 1）	180,494.68
2、债券利息收入	1,442,658.38
3、处置交易性金融资产产生的净收益	453,679.15
4、公允价值变动损益	-295,048.10
5、赎回费收入	0.71
清算收入小计	1,781,784.82
二、清算费用	
1、律师费	15,000.00
2、账户维护费	15,000.00
3、税金及附加	4,894.49

4、其他费用	847.34
清算费用小计（注2）	35,741.83
三、清算净收益	1,746,042.99

注1：存款利息收入系计提的自2019年4月9日至2019年8月26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178,636.93元、结算备付金利息人民币1,708.82元及存出保证金利息人民币148.93元。

注2：根据《国寿安保稳恒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 2019 年 4 月 8 日基金净资产	73,737,804.43
加：清算期间净收益	1,746,042.99
减：清算期间基金净赎回金额（注1）	-1,809.13
二、2019 年 8 月 26 日基金净资产	75,485,656.55

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和应收申购款，已于清算期间全部结算。

资产处置及负债清偿后，于2019年8月26日本基金剩余财产为人民币75,485,656.55元。根据本基金的基金合同约定及《国寿安保稳恒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 国寿安保稳恒混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 关于国寿安保稳恒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。

国寿安保稳恒混合型证券投资基金基金财产清算组

2019年9月23日