

# 国寿安保稳悦混合型证券投资基金

## 清算报告

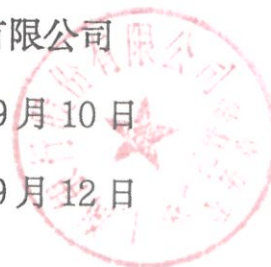


基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日期：2024年9月10日

清算报告公告日期：2024年9月12日



## § 1 重要提示

国寿安保稳悦混合型证券投资基金(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[2020]3097号《关于准予国寿安保稳悦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(以下简称“国寿安保”)于2021年1月11日至2021年3月17日公开募集。经向中国证监会报送基金备案材料,基金合同于2021年3月18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。本基金份额持有人大会于2024年8月19日表决通过了《关于终止国寿安保稳悦混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并自2024年8月23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稳悦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2024年8月23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 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保稳悦混合型证券投资基金	
基金简称	国寿安保稳悦混合	
基金主代码	010828	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年3月18日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
基金最后运作日(2024年8月22日) 基金份额总额	66,215,173.30份	
下属分级基金的基金简称	国寿安保稳悦混合 A	国寿安保稳悦混合 C
下属分级基金的交易代码	010828	010829
基金最后运作日(2024年8月22日) 下属分级基金的份额总额	66,202,915.55份	12,257.75份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，同时通过精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。除主要的股票及债券投资外，本基金还可通过投资衍生工具等，进一步为基金组合规避风险、增强收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*75%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

## § 3 基金运作情况说明

国寿安保稳悦混合型证券投资基金(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[2020]3097号《关于准予国寿安保稳悦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《国寿安保稳悦混合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201,086,735.53元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天

---

验字(2021)第 0304 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保稳悦混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 03 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 201,205,450.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 118,714.67 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,基金托管人为上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保稳悦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,包括国内依法发行和上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、企业债、公司债(含可续期公司债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债、公开发行的二级资本债、可转换债券、可交换债券)、资产支持证券、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)、同业存单、债券回购、货币市场工具、国债期货、股指期货、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它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0-40%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 45%),本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%,本基金投资于可转换债券的比例不超过基金资产的 20%。本基金投资的信用债券中,其经国内信用评级机构认定的主体评级须在 AA+(含 AA+)以上。主体评级为 AAA 的信用债投资占信用债资产的比例为 50%-100%;主体评级为 AA+的信用债投资占信用债资产的比例为 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其

中，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的投资范围包括港股通标的股票，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*75%+沪深 300 指数收益率\*15%+恒生指数收益率\*10%。

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。本基金份额持有人大会于 2024 年 8 月 19 日表决通过了《关于终止国寿安保稳悦混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并自 2024 年 8 月 23 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稳悦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 2024 年 8 月 23 日进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为 2024 年 8 月 23 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 2024 年 8 月 22 日
资产：	

货币资金	46,552,994.53
结算备付金	2,029,631.60
存出保证金	127,447.64
交易性金融资产	9,043,656.99
其中：股票投资	4,015,020.00
债券投资	5,028,636.99
买入返售金融资产	
应收清算款	2,123,122.55
资产总计	59,876,853.31
<b>负 债：</b>	
应付清算款	0.01
应付赎回款	5,254.81
应付管理人报酬	21,631.61
应付托管费	3,605.26
应付销售服务费	0.66
应交税费	18.84
其他负债	212,389.63
负债合计	242,900.82
<b>净资产：</b>	
实收基金	66,215,173.30
未分配利润	-6,581,220.81
所有者权益合计	59,633,952.49
负债和所有者权益总计	59,876,853.31

注：报告截止日 2024 年 8 月 22 日（基金最后运作日），基金份额总额 66,215,173.30 份，其中国寿安保稳悦混合 A 基金份额总额 66,202,915.55 份，基金份额净值 0.9006 元；国寿安保稳悦混合 C 基金份额总额 12,257.75 份，基金份额净值 0.8993 元。

## § 5 清算情况

自 2024 年 8 月 23 日至 2024 年 9 月 4 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 46,552,994.53 元, 其中应计利息为 8,835.63 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 2,029,631.60 元(其中应计利息为 5,140.06 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。

(3) 本基金最后运作日存出保证金人民币 127,447.64 元(其中应计利息为 369.58 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 9,043,656.99 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 2,123,122.55 元, 该款项已于 2024 年 8 月 23 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 5,254.81 元, 该款项已于 2024 年 8 月 23 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 21,631.61 元, 该款项已于 2024 年 9 月 4 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,605.26 元, 该款项已于 2024 年 9 月 4 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.66 元, 该款项已于 2024 年 9 月 4 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付清算款为人民币 0.01 元, 该款项已于 2024 年 8 月

23日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 18.84 元，该款项已于 2024 年 9 月 4 日支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币 212,389.63 元，其中应付律师费 30,000.00 元，已于 2024 年 8 月 29 日支付，应付交易费用人民币 163,089.63 元将于 2024 年 9 月 4 日后支付；预提审计费 10,000.00 元将于 2024 年 9 月 4 日后支付；预提银行间账户维护费 9,300.00 元将于 2024 年 9 月 4 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2024年8月23日至 2024年9月4日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	15,622.19
2、处置交易性金融资产产生的净收益	-111,343.34
3、公允价值变动损益	20,784.76
清算收入小计	-74,936.39
减：二、清算费用	
清算费用小计（注2）	41.00
三、清算净收益	-74,977.39

注1：利息收入系计提的自2024年8月23日至2024年9月4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14,366.89元、结算备付金利息人民币1,181.31元、存出保证金利息人民币73.99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，支付划款手续费人民币41.00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2024年8月22日基金净资产	59,633,952.49
加：清算期间净收益	-74,977.39
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）	-86.96
二、2024年9月4日基金净资产	59,558,888.14



---

资产处置及负债清偿后,于 2024 年 9 月 4 日本基金剩余财产为人民币 59,558,888.14 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 国寿安保稳悦混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于国寿安保稳悦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。

---

国寿安保稳悦混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年9月10日



二一