

国寿安保尊盈一年定期开放 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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2018年11月23日

清算报告公告日期：2018年12月29日

§ 1 重要提示

国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金（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[2014]1344号文的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2015年10月12日至2015年10月30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3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》、《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，基金管理人按照基金合同的约定进行清算，而无需召开基金份额持有人大会：（1）、基金合同生效后，任一封闭运作期内，连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元；（2）、基金合同生效后，任一开放期最后一日日终，基金份额持有人数量不满200人；（3）、基金合同生效后，任一开放期最后一日日终，基金资产净值低于5000万元。（4）、法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

截至2018年11月9日（本基金第三个开放期最后一日）日终，本基金的基金资产净值低于5000万元，触发《基金合同》终止事由。

根据《国寿安保尊盈一年定期开放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2018年11月10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、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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，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	国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国寿安保尊盈一年定期开放债券
基金主代码	001847
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月3日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额	23,834,848.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码:	001847	001848
报告期末下属分级基金的份额总额	21,459,671.19 份	2,375,177.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，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	本基金在投资策略上兼顾投资原则以及定期开放基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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、期限配置策略、回购套利策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债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	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

§ 3 基金运作情况说明

国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金（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[2014]1344号文《关于准予国寿安保尊盈一年定期开放债券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10月12日至2015年10月30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3日正式生效。本基金为契约型、定期开放式，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，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。首次募集规模为647,523,154.16份A类基金份额，47,817,034.12份C类基金份额。国寿安保尊盈一年定期开放债券A类及C类收到的实收基金合计人民币695,340,188.28元，分别折合成A类和C类基金份额，合计折合695,340,188.28份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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和监管规定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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调整实施前依照《信息披露办法》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、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、证券公司短期公司债券、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），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）。本基金不直接参与股票投资，但可持有因可转换债券转股所形成的股票（包括因持有该股票所派发的权证）以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起30个交易日内卖出。

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%。在每个开放期的前 1 个月和后 1 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

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，基金管理人按照基金合同的约定进行清算，而无需召开基金份额持有人大会：（1）、基金合同生效后，任一封闭运作期内，连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元；（2）、基金合同生效后，任一开放期最后一日日终，基金份额持有人数量不满 200 人；（3）、基金合同生效后，任一开放期最后一日日终，基金资产净值低于 5000 万元。（4）、法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

截至 2018 年 11 月 9 日（本基金第三个开放期最后一日）日终，本基金的基金资产净值低于 5000 万元，触发《基金合同》终止事由。

根据《国寿安保尊盈一年定期开放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 2018 年 11 月 10 日起进入清算程序，故本基金清算起始日为 2018 年 11 月 10 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11月9日
资产：	
银行存款	30,375,417.77
结算备付金	3,798,814.35
存出保证金	26,063.87
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
应收利息	63,942.77
应收申购款	-
资产总计	34,264,238.76
负债：	
应付赎回款	9,521,397.53
应付管理人报酬	47,004.36
应付托管费	13,429.81
应付交易费用	6,629.05
应付销售服务费	737.35
应交税费	10,165.42
其他负债	407,504.59
负债合计	10,006,868.11
所有者权益：	
实收基金	23,834,848.67
未分配利润	422,521.98
所有者权益合计	24,257,370.65
负债和所有者权益总计	34,264,238.76

§ 5 清算情况

自 2018 年 11 月 10 日至 2018 年 11 月 23 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 3,798,814.35 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。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 26,063.87 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。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息人民币 63,942.77 元，其中应收银行存款利息人民币 44,700.61 元、应收结算备付金利息人民币 19,201.64 元及应收存出保证金利息人民币 40.52 元，截止清算款划出日前的应收利息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，基金管理人垫付的资金将于清算期后的银行结息日后返还给基金管理人。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 9,521,397.53 元，该款项已分别于 2018 年 11 月 12 日及 2018 年 11 月 13 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 47,004.36 元，该款项已于 2018 年 11 月 15 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 13,429.81 元，该款项已于 2018 年 11 月 15 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 737.35 元，该款项已于 2018 年 11 月 15 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 6,629.05 元，其中应付中债登结算手续费人民币 1,920 元及应付上清所结算手续费人民币 3,440 元已于 2018 年 11 月 21 日支付；应付外汇中心交易手续费人民币 1,269.05 元将于 2018 年 11 月 23 日后支

付。

5.2.6 本基金最后运作日应交税费为人民币 10,165.42 元，该款项已于 2018 年 11 月 15 日支付。

5.2.7 本基金最后运作日其他负债为人民币 407,504.59 元，其中应付赎回费人民币 504.59 元已分别于 2018 年 11 月 12 日及 2018 年 11 月 13 日支付；其他应付款人民币 6,000.00 元已于 2018 年 11 月 21 日支付；应付中国证券报信息披露费人民币 201,000.00 元、应付上海证券报信息披露费人民币 85,000.00 元、应付证券时报信息披露费人民币 85,000.00 元及应付审计费用人民币 30,000.00 元将于 2018 年 11 月 23 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 2018 年 11 月 10 日至 2018 年 11 月 23 日止清算期间
一、清算收入	
1、利息收入（注 1）	7,163.12
2、赎回费收入	199.14
清算收入小计	7,362.26
二、清算费用	
1、律师费	20,000.00
2、其他费用	671.78
清算费用小计（注 2）	20,671.78

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 11 月 10 日至 2018 年 11 月 23 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 4,753.30 元、结算备付金利息人民币 2,393.30 元及存出保证金利息人民币 16.52 元。

注 2：根据《国寿安保尊盈一年定期开放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》，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 11 月 9 日基金净资产	24,257,370.65
加：清算收入	7,362.26

减：清算费用	20,671.78
减：2018年11月9日赎回款（注1）	7,802,606.90
二、2018年11月23日基金净资产	16,441,454.23

注1：该赎回款系2018年11月9日当日的赎回申请，于2018年11月12日确认为应付赎回款并已于2018年11月14日支付。

资产处置及负债清偿后，于2018年11月23日本基金剩余财产为人民币16,441,454.23元。根据本基金的基金合同约定及《国寿安保尊盈一年定期开放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》，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 国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 关于国寿安保尊盈一年定期开放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。

国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算组

2018 年 12 月 29 日