

国寿安保尊盛双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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022 年 10 月 25 日

清算报告公告日期：2022 年 11 月 1 日

§ 1 重要提示

国寿安保尊盛双债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〔2019〕2497号文《关于准予国寿安保尊盛双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（简称“国寿安保”）于2020年2月24日至2020年3月13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2020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，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。本基金基金份额持有人大会于2022年10月11日表决通过了《关于终止国寿安保尊盛双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10月12日起进入基金财产清算程序，触发基金合同终止事由。

根据《国寿安保尊盛双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10月12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、基金托管人中国银行股份有限公司、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	国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金
基金简称	国寿安保尊盛双债债券
基金主代码	008740
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,517,335.59份

下属分级基金的基金简称:	国寿安保尊盛双债债券 A	国寿安保尊盛双债债券 C
下属分级基金的交易代码:	008740	008741
报告期末下属分级基金的份额总额	3, 413, 169. 60 份	2, 104, 165. 99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以信用债和可转债为主要投资对象，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率 趋势，判断证券市场对上述变量和政策的反应，并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价 值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素，采取积极投资策 略，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率×80% + 中证可转换债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，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

国寿安保尊盛双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〔2019〕2497号《关于准予国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金注册的批复》核准,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《国寿安保尊盛双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 541,409,410.86 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第 61090605_A01 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 03 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 541,561,270.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 151,859.52 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保尊盛双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国内依法发行上市交易的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、证券公司短期公司债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款以及定期存款等其他银行存款)、同业存单、现金等货币市场工具、国债期货等,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的相关规定。本基金不直接买入股票等权益类资产,但可持有因可转债、可交换债换股所形成的股票等。因上述原因持有的股票,本基金应在可交易之日起一个月内卖出。本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于

可转换债券(含可分离交易可转债)及信用债的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，可转换债券(含分离交易可转换债)及信用债的比例分别不低于非现金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或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*80%+中证可转换债券指数收益率*20%。

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。本基金基金份额持有人大会于 2022 年 10 月 11 日表决通过了《关于终止国寿安保尊盛双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 10 月 12 日起进入基金财产清算程序，触发基金合同终止事由。

根据《国寿安保尊盛双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 10 月 12 日起进入基金财产清算程序，故本基金清算起始日为 2022 年 10 月 12 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 10 月 11 日
资 产：	
银行存款	977,143.03
结算备付金	55,784.02
存出保证金	5,061.25
交易性金融资产	4,954,063.59
其中：债券投资	4,954,063.59
资产总计	5,992,051.89
负 债：	
应付管理人报酬	7,457.11
应付托管费	1,491.39
应付销售服务费	1,035.07
应交税费	786.18
其他负债	78,626.86
负债合计	89,396.61
所有者权益：	
实收基金	5,517,335.59
未分配利润	385,319.69
所有者权益合计	5,902,655.28
负债和所有者权益总计	5,992,051.89

注：报告截止日 2022 年 10 月 11 日(基金最后运作日)，国寿安保尊盛双债债券 A 基金份额总额 3,413,169.60 份，基金份额净值 1.0740 元；国寿安保尊盛双债债券 C 基金份额总额 2,104,165.99 份，基金份额净值 1.0630 元。

§ 5 清算情况

自 2022 年 10 月 12 日至 2022 年 10 月 17 日止为清算期间，本基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。

5.1 资产处置情况

(1) 自 2022 年 10 月 12 日本基金进入清算程序起至清算款划出日前一日的基金银行存款利息收入归基金份额持有人所有，由本基金的基金管理人以自有资金先行垫付，本基金的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。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

(2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 55,784.02 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 5,061.25 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。

(4) 清算期间，本基金卖出债券成交总额 4,995,764.09 元，对应债券成本总额 4,921,991.00 元，对应债券应收利息总额 54,082.89 元，对应交易费用总额 101.70 元，实现买卖债券差价收入 19,588.50 元。

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 7,457.11 元，该款项将于 2022 年 10 月 17 日后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,491.39 元，该款项将于 2022 年 10 月 17 日后支付。本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,226.86 元，其中应付海通证券佣金人民币 294.36 元将于 2022 年 10 月 17 日后支付；应付中债登结算手续费人民币 900.00 元和应付银行间债券交易手续费人民币 32.50 元已于 2022 年 10 月 21 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付税费为人民币 786.18 元，该款项将于 2022 年 10 月 17 日后支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 78,626.86 元，其中包括应付持有人大会和清算律师费人民币 35,000.00 元、审计费人民币 20,000.00 元、银行间账户维护费人民币 12,000.00 元、应付海通证券佣金人民币 294.36 元和其他费用（上清所查询费）人民币 100 元，以上费用将于 2022 年 10 月 17 日后支付；应付持有人大会公证费人民币 10,000.00 元已于 2022 年 10 月 14 日支付，应付中债登结算手续费人民币 900.00 元、应付银行间债券交易手续费人民币 32.50 元和其他费用（上清所查询费）人民币 300 元已于 2022 年 10 月 21 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 10 月 12 日至 2022 年 10 月 17 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）	218.99
2、清算期间投资收益	20,105.26
3、公允价值变动收益	21,484.30
清算收益小计	41,808.55
二、清算费用	
1、税金及附加	1.11
2、其他费用	25.00
清算费用小计	26.11
三、清算净收益（损失以“-”号填列）	41,782.44

注：存款利息收入系计提的自 2022 年 10 月 12 日至 2022 年 10 月 17 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。其中，银行存款利息人民币 202.55 元、结算备付金利息人民币 15.06 元和存出保证金利息人民币 1.38 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 2022 年 10 月 11 日基金净资产	5,902,655.28
加：清算期间净收益（损失以“-”号填列）	41,782.44
二、2022 年 10 月 17 日基金净资产	5,944,437.72

资产处置及负债清偿后，于 2022 年 10 月 17 日本基金剩余财产为人民币 5,944,437.72 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 国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于国寿安保尊盛双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。

国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金财产清算组

2022 年 11 月 1 日