

# 摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混 合型发起式基金中基金(FOF) 清算报告

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年六月八日

报告公告日期：二〇二三年六月十四日

## 目录

1、重要提示 .....	3
2、基金概况 .....	3
2.1 基金基本情况.....	3
2.2 基金产品说明.....	4
3、基金运作情况概述 .....	5
4、财务会计报告 .....	6
5、清盘事项说明 .....	7
5.1 基金基本情况.....	7
5.2 清算原因.....	8
5.3 清算报表编制基础.....	8
6、清算情况 .....	9
6.1 清算费用.....	9
6.2 资产处置情况.....	9
6.3 负债清偿情况.....	10
6.4 清算期的清算损益情况.....	10
6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	11
6.6 基金财产清算报告的告知安排.....	11
7、备查文件目录 .....	11
7.1 备查文件目录.....	11
7.2 存放地点.....	12
7.3 查阅方式.....	12

## 1、重要提示

摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)（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]583号、证监许可[2019]1804号文准予募集注册，于2020年4月29日成立并正式运作，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）以及摩根基金管理（中国）有限公司于2023年4月30日发布的《关于摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为2023年4月29日，并于2023年4月30日进入基金财产清算程序。

本基金从2023年4月30日起进入清算期，由基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，上海源泰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	摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
基金简称	摩根锦程积极养老五年持有混合(FOF)
基金代码	009161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年4月29日
基金管理人名称	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

基金最后运作日（2023年4月29日）基金份额总额	25,624,977.98
---------------------------	---------------

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将资产分别配置于高风险类资产和其他资产，控制投资组合的风险收益水平，并自下而上精选基金，力求实现基金资产持续稳健增值，为投资者提供适应其风险承受水平的养老理财工具。
投资策略	<p>1、目标风险投资策略：</p> <p>（1）大类资产配置策略：本基金属于养老目标风险基金，本基金的目标风险指通过将基金所投资的高风险类资产和其他资产长期保持在相对恒定的比例，以使基金在投资组合层面达到目标的风险水平。</p> <p>管理人根据对各类资产的中长期预期假设和策略观点以及目标客户的风险收益偏好进行自上而下的资产配置，设定本基金在高风险类资产和其他资产之间的基准配置比例为 75%:25%；高风险类资产指股票型基金、应计入高风险类资产的混合型基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种（均包含 QDII）及股票；其他资产指债券型基金、货币市场基金和不计入高风险类资产的混合型基金（均包含 QDII）、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款及同业存单等；本基金高风险类资产的向上、向下的调整幅度分别不得超过基准配置比例的 5%、10%。</p> <p>（2）细分资产类别配置策略：管理人根据长期资本市场观点评估各细分资产类别的风险收益特征，形成对不同资产类别的预期。在此基础上，确定基金资产在各细分资产类别间的配置比例。本基金定期结合策略观点，修正资产配置。</p> <p>2、主动管理型基金投资策略：通过自下而上的方式优选基金，研究过程中综合运用定量分析和定性分析，优选符合要求且能在中长期创造超额收益的基金。</p> <p>3、指数基金投资策略：优选中长期景气向好的指数基金进行配置，</p>

	<p>增厚组合收益，并把握阶段性投资机会，获取超额收益。</p> <p>4、其他投资策略：包括股票投资策略、债券投资策略、证券公司短期公司债投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略等。</p>
业绩比较基准	<p>中证800指数收益率*75%+中证综合债指数收益率*20%+活期存款利率（税后）*5%</p>
风险收益特性	<p>基金管理人将养老目标风险基金根据不同风险程度进行划分。本基金的高风险类资产和其他资产的基准配置比例为75%：25%，在基金管理人管理的养老目标风险基金中，属于高风险类资产的配置比例较高的。</p> <p>本基金属于混合型基金中基金，预期风险和收益水平低于股票型基金中基金，高于债券型基金中基金和货币型基金中基金。</p> <p>根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>

### 3、基金运作情况概述

根据中国证监会关于准予本基金注册的文件（证监许可[2019]583号文及证监许可[2019]1804号文），自2020年3月27日起向全社会公开募集，并于2020年4月24日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为13,111,142.42元人民币，折合基金份额13,111,142.42份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计1,340.36元人民币，折合基金份额1,340.36份。

经中国证券监督管理委员会书面确认，本基金的基金合同于2020年4月29日生效。本基金为契约型开放式混合型基金中基金（FOF），存续期限为不定期。

自2020年4月29日至2023年4月29日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2023年4月30日起，本基金进入清算程序。

#### 4、财务会计报告

##### 资产负债表（已经审计）

会计主体：摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

报告截止日：2023年4月29日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023年4月29日 (基金最后运作日)
<b>资 产：</b>	
货币资金	1,719,683.05
结算备付金	29,372.06
存出保证金	3,625.36
交易性金融资产	16,503,761.34
其中：股票投资	-
债券投资	-
基金投资	16,503,761.34
买入返售金融资产	-
应收清算款	10,810,563.55
应收申购款	5,406.12
<b>资产总计</b>	<b>29,072,411.48</b>

负债和净资产	
<b>负 债:</b>	
应付清算款	-
应付管理人报酬	13,464.50
应付托管费	3,440.32
应交税费	1,036.27
其他负债	113,862.34
<b>负债合计</b>	<b>131,803.43</b>
<b>净资产:</b>	
实收基金	25,624,977.98
未分配利润	3,315,630.07
<b>净资产合计</b>	<b>28,940,608.05</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>29,072,411.48</b>

注:

1. 报告截止日 2023 年 4 月 29 日(基金最后运作日), 本基金的基金份额净值 1.1294 元, 基金份额总额 25,624,977.98 份。

2. 财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 29 日(基金最后运作日)止期间。

## 5、清盘事项说明

### 5.1 基金基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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, 包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金(含 QDII 基金、香港互认基金及其他经中国证监会核准或注册的基金)、国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭

证、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、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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（须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金将不低于 80%的基金资产投资于其他基金份额；投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种（均包含 QDII）的比例合计原则上不超过 80%。

基金资产投资于高风险类资产，如股票型基金、应计入高风险类资产的混合型基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种（均包含 QDII）及股票占基金资产净值的比例合计不低于 65%且不超过 80%；其他资产，如债券型基金、货币市场基金和不计入高风险类资产的混合型基金（均包含 QDII）、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款及同业存单等占基金资产净值的比例合计不低于 20%。

应计入高风险类资产的混合型基金应符合以下两种情况之一：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。

本基金每个交易日日终应保持现金或到期日在一年期以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*75%+中证综合债指数收益率\*20%+活期存款利率（税后）\*5%

## 5.2 清算原因

根据《基金合同》以及摩根基金管理（中国）有限公司于 2023 年 4 月 30 日发布的《关于摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金触发了《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，本基金的最后运作日为 2023 年 4 月 29 日，并于 2023 年 4 月 30 日进入基金财产清算程序。

## 5.3 清算报表编制基础

本基金的清算报表是参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》



的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 6、清算情况

自 2023 年 4 月 30 日至 2023 年 6 月 8 日止清算期间，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：

### 6.1 清算费用

按照《基金合同》中“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

### 6.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金为人民币 1,719,683.05 元，其中活期存款本金人民币 1,719,447.00 元，应计活期存款利息人民币 236.05 元，截至 2023 年 6 月 8 日（清算截止日）货币资金为人民币 28,906,562.47 元，其中活期存款本金人民币 28,896,704.80 元，应计活期存款利息人民币 9,857.67 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 29,372.06 元，其中交易所最低备付金人民币 29,321.36 元，应计结算备付金利息人民币 50.70 元，截至 2023 年 6 月 8 日（清算截止日）结算备付金为人民币 0.00 元，其中交易所最低备付金人民币 0.00 元，应计结算备付金利息人民币 84.26 元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 3,625.36 元，其中交易所结算保证金人民币 3,618.42 元，应计存出保证金利息人民币 6.94 元，截至 2023 年 6 月 8 日（清算截止日）存出保证金为人民币 0.00 元，其中应计存出保证金利息人民币 13.67 元。

(4) 本基金最后运作日确认的交易性金融资产的基金投资为人民币 16,503,761.34 元，已于 2023 年 4 月 28 日提出赎回申请，2023 年 5 月 4 日赎回确认，截至 2023 年 5 月 9 日所有款项收回完毕。

(5) 本基金最后运作日确认的应收清算款为人民币 10,810,563.55 元，已于 2023 年 5 月 4 日收回完毕。

(6) 本基金最后运作日确认的基金申购款人民币 5,406.12 元, 已于 2023 年 5 月 4 日收回完毕。

### 6.3 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 13,464.50 元, 该款项已于 2023 年 5 月 10 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,440.32 元, 该款项已于 2023 年 5 月 10 日支付。

(3) 本基金最后运作日应交税费为人民币 1,036.27 元, 该款项已于 2023 年 5 月 10 日支付。

(4) 本基金最后运作日确认的其他负债为人民币 113,862.34 元, 包括应付审计费 40,000.00 元, 应付信息披露费 50,000.00 元, 应付律师费 20,000.00 元, 应付交易费用 3,862.34 元, 均已支付完毕。

### 6.4 清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	自2023年4月30日至2023年6月8日止清算期间
一、资产处置收入	-45,232.65
1. 利息收入-存款利息收入(注1)	9,661.91
2. 其他收入(注2)	-54,894.56
二、清算费用	415.00
1. 银行划款手续费	415.00
2. 股利红利税	-
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	-45,647.65

注1: 利息收入以当前适用的利率预估计提的自2023年4月30日至2023年6月8日止清算

期间的货币资金利息、存出保证金利息、结算备付金利息。

注2：其他收入为2023年4月28日提出赎回申请，2023年5月4日赎回确认的交易性金融资产的基金投资净损益。

## 6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

截至本次清算期结束日2023年6月8日，本基金剩余财产为人民币28,894,960.40元，自本次清算结束日次日2023年6月9日至本次清算款划出前一日的货币资金、存出保证金、结算备付金产生的利息亦归基金份额持有人所有。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。

为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

本基金的货币资金、结算备付金、存出保证金应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

## 6.6 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。

## 7、备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- (1) 摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)清算财

## 务报表及审计报告

(2) 关于《摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)清算报告》的法律意见

## 7.2 存放地点

基金管理人处

## 7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根锦程积极成长养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)财产清  
算组

2023年6月14日