

嘉实养老目标日期2045五年持有期混合
型发起式基金中基金（FOF）
清算报告

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年七月十七日

报告公告日期：二〇二四年七月三十日

目 录

1、重要提示	2
2、基金概况	2
3、基金运作情况说明	5
4、财务报告	6
5、清算事项说明	8
6、备查文件目录	10

1、重要提示

嘉实养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2021]1689号予以注册，于2021年6月25日成立并正式运作。

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》和《嘉实养老目标日期2045五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”）的有关规定，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金的基金合同生效日为2021年6月25日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年6月25日。截至2024年6月25日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2024年6月25日。本基金管理人自2024年6月26日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见2024年6月26日刊登在《上海证券报》及公司网站上的《关于嘉实养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同终止及财产清算的公告》。

本基金的最后运作日为2024年6月25日，并于2024年6月26日进入清算程序，由本基金管理人嘉实基金管理有限公司、基金托管人招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）对清算报告进行审计，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	嘉实养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	嘉实养老目标日期2045五年持有期混合（FOF）

嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算报告

基金主代码	012512
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年6月25日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金最后运作日（2024年6月25日）基金份额总额	11,476,544.43份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为满足养老资金理财需求，通过大类资产配置，随着目标日期临近逐渐降低权益资产的比重，力争实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>目标日期后，本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。</p>
投资范围	<p>本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、QDII 基金、香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证以及其他依法发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等资产，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</p>

	<p>中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金不投资于分级基金份额、股指期货、国债期货和股票期权。</p> <p>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</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>除第1、7条另有约定外，本基金的投资策略适用于基金的转型前及转型后：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、目标日期策略 2、资产配置策略 3、基金筛选策略 4、股票投资策略 5、债券投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、风险管理策略
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债总财富指数收益率*（1-X*0.85） +中证 800 指数收益率*X*0.85</p> <p>其中X为基于基金管理人开发的下滑曲线模型推导出的权益类资产年度目标配置比例；可以合理假设，本基金所投资的权益类资产平均股票仓位为 85%，故将“X*0.85”设定为权益类资产部分的业绩比较基准权重，“1-X*0.85”设定为非权益类资产部分的业绩比较基准权重。本基金 X 值详见招募说明书及相关公告。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金中基金（FOF），本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。</p>

3、基金运作情况说明

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[2021]1689号《关于准予嘉实养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由嘉实基金管理有限公司依照法律法规、基金合同等规定于2021年6月21日向社会公开发行人募集，基金合同于2021年6月25日正式生效，募集规模为10,415,998.09份基金份额。

自2021年6月25日至2024年6月25日期间，本基金按基金合同正常运作。

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》和《基金合同》的有关规定，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金的基金合同生效日为2021年6月25日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年6月25日。截至2024年6月25日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2024年6月25日。本基金管理人自2024年6月26日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

4、财务报告

4.1 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 25 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024 年 6 月 25 日
资产：	
货币资金	1,467,134.35
结算备付金	16,672.79
存出保证金	2,546.83
交易性金融资产	7,541,198.64
其中：股票投资	-
债券投资	202,092.44
基金投资	7,339,106.20
买入返售金融资产	-
应收清算款	-
应收申购款	0.12
资产合计	9,027,552.73
负债和净资产	最后运作日 2024 年 6 月 25 日
负债：	
应付赎回款	-
应付管理人报酬	4,504.72
应付托管费	1,159.82
应付销售服务费	-
应交税费	-
其他负债	67,500.00
负债合计	73,164.54
净资产：	
实收基金	11,476,544.43
未分配利润	-2,522,156.24
净资产合计	8,954,388.19
负债和净资产总计	9,027,552.73

注 1：报告截止日 2024 年 6 月 25 日（基金最后运作日），基金净值 8,954,388.19 元，基金份额总额 11,476,544.43 份。

注 2: 本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于 2024 年 6 月 25 日(基金最后运作日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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。

5、清算事项说明

本基金的清算期间为自2024年6月26日至2024年7月17日止。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 清算费用

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。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

本基金最后运作日结算备付金金额16,672.79元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金本金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第6个工作日对结算备付金进行调整，存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金应计利息预计于2024年9月23日收回。

本基金最后运作日存出保证金金额2,546.83元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金本金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第2个工作日对存出保证金进行调整，存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金应计利息预计于2024年9月23日收回。

本基金最后运作日应收活期存款利息为54.34元，预计于2024年9月23日收回。

本基金最后运作日应收申购款利息金额0.12元，已于2024年6月26日收回并划入托管账户。

本基金最后运作日交易性金融资产为债券投资和基金投资。其中，债券投资金额为202,092.44元人民币（最后运作日估值市值），其中应计债券利息1,632.44元人民币，卖出债券成交金额共计202,203.18元人民币，证券清算款截至2024年6月27日全部划入托管账户。基金投资金额为7,339,106.20元人民币，截止2024年7月17日已变现7,367,186.58元人民币划入托管账户。清算期间销售服务费转投基金份额，于2024年7月17日变现55.22元人民币，剩余款项83.89元人民币将于清算结束后划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付管理人报酬为4,504.72元，该款项已于2024年7月5日支

付。

本基金最后运作日应付托管费为 1,159.82 元，该款项已于 2024 年 7 月 5 日支付。

本基金最后运作日其他负债为 67,500.00 元，为预提审计费、应付银行手续费、应付律师费。其中，预提审计费为 52,000.00 元，该款项已于 2024 年 7 月 10 日支付；预提银行手续费为 500.00 元，该款项于 2024 年 7 月 5 日支付 90.00 元，剩余款项尚未支付；应付律师费为 15,000.00 元，该款项尚未支付。

5.4 清算期间的损益情况

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 6 月 25 日基金净资产	8,954,388.19
加：清算期间（2024 年 6 月 26 日至 2024 年 7 月 17 日）收入	
1、存款利息收入（注 1）	1,686.18
2、债券利息收入	-
3、投资收益（注 2）	-396,258.11
4、公允价值变动损益	425,206.73
5、其他收入	139.92
减：清算期间（2024 年 6 月 26 日至 2024 年 7 月 17 日）费用	
1、交易费用（注 3）	704.70
2、其他费用（注 4）	-
减：期间基金份额交易产生的基金净值变动数	-
1、基金赎回款	-
二、2024 年 7 月 17 日（清算报告出具日）基金净资产	8,984,458.21

单位：人民币元

注 1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2024 年 6 月 26 日至 2024 年 7 月 17 日止银行存款、结算备付金、存出保证金的利息。

注 2：投资收益系最后运作日未变现股票、债券等自 2024 年 6 月 26 日至 2024 年 7 月 17 日止处置取得的投资收益。

注 3：交易费用系最后运作日未变现股票、债券等自 2024 年 6 月 26 日至 2024 年 7 月 17 日止处置过程中发生的交易费用。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2024 年 7 月 17 日，本基金剩余财产为 8,984,458.21 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。

自本次清算期结束日次日 2024 年 7 月 18 日至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人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。

5.5 基金资产清算的告知及剩余财产分配安排

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。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 嘉实养老目标日期2045五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

6.1.2 关于《嘉实养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算报告》的法律意见书

6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

6.3 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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司

嘉实基金管理有限公司客服电话：400-600-8800

二〇二四年七月十七日