

平安盈丰积极配置三个月持有期混合型
发起式基金中基金（FOF）
清算报告

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二三年一月十八日

清算报告公告日：二〇二三年一月三十一日

目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	4
四、清算情况.....	6
五、备查文件.....	9

重要提示

平安盈丰积极配置三个月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]1864号《关于准予平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》核准,由平安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《平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金基金合同于2019年12月27日正式生效。本基金基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《平安盈丰积极配置三个月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》”)的有关规定,《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金规模低于2亿元人民币的,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金已于2022年12月27日日终触发《基金合同》约定的终止事由,平安基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序,此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日定为2022年12月27日,并于2022年12月28日进入清算程序。

本基金的基金管理人、基金托管人、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成立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事宜出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
基金简称	平安盈丰积极配置三个月持有期混合(FOF)
基金主代码	008461
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年12月27日

基金管理人名称	平安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
公告依据	《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》等相关法律法规以及《平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》和《平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》

二、基金运作情况

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]1864号文准予募集注册。由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自2019年12月9日至2019年12月25日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2019年12月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为105,956,632.60份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合19,953.25份基金份额）。

根据本基金《基金合同》约定：“《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金规模低于2亿元人民币的，基金合同自动终止，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2019年12月27日，基金合同生效满3年之日为2022年12月27日。因截至2022年12月27日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元人民币，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，无需召开基金份额持有人大会。

本基金管理人在上述事由出现后依法履行了基金财产清算程序。本基金的最后运作日为2022年12月27日，并于2022年12月28日进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

三、财务会计报告

（1）基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2022年12月27日

单位：人民币元

资产	本期末 2022年12月27日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	7,099,955.92
交易性金融资产	50,335,708.53
应收证券清算款	6,104,033.12
资产总计	63,539,697.57
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	4,605,640.42
应付管理人报酬	36,994.86
应付托管费	9,843.35
应付销售服务费	14,101.13
其他负债	36,721.99
负债合计	4,703,301.75
所有者权益：	
实收基金	47,999,020.95
未分配利润	10,837,374.87
所有者权益合计	58,836,395.82
负债和所有者权益总计	63,539,697.57

注：1. 报告截止日2022年12月27日(基金最后运作日)，基金份额总额47,999,020.95份，其中平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）A基金份额总额24,207,801.21份，基金份额净值1.2349元。平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）C基金份额总额23,791,219.74份，基金份额净值1.2165元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2022年1月1日至2022年12月27日(基金最后运作日)。

(2) 基金最后运作日利润表（经审计）

会计主体：平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2022年1月1日至2022年12月27日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期金额
	2022年1月1日至2022年12月27日（基金最后运作日）
一、营业总收入	-21,017,042.77
1、利息收入	19,951.39
2、投资收益（损失以“-”填列）	-16,108,497.85
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-4,931,040.37
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	
5、其他业务收入	2,544.06
二、营业总支出	1,083,904.28
1、管理人报酬	579,266.86
2、托管费	152,097.95
3、销售服务费	234,315.39
4、投资顾问费	
5、利息支出	
其中：卖出回购金融资产利息支出	
6、信用减值损失	
7、税金及附加	
8、其他费用	118,224.08
三、利润总额	-22,100,947.05
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-22,100,947.05
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	-22,100,947.05

四、清算情况

自2022年12月28日至2023年1月11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，具体清算情况如下：

(一) 清算费用

按照《平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》“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。

（二）资产处置情况

（1） 本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 7,099,955.92 元，其中包含应收银行活期存款利息 711.51 元，该款项由基金托管人负责保管。应计活期银行存款利息于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清。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尚未收讫的利息。

（2） 本基金最后运作日的交易性金融资产余额为人民币 50,335,708.53 元。所有交易性金融资产均为交易性基金投资，均于清算期间处置变现。

（3） 本基金最后运作日的应收证券清算款余额为人民币 6,104,033.12 元。该款项为本基金于 2022 年 12 月 26 日-2022 年 12 月 27 日发起的持仓基金赎回申请形成的应收证券清算款，按照各持仓基金的资金交收规则，该款项于 2022 年 12 月 29 日前先后划回基金托管户，由基金托管人负责保管。

（三）负债清偿情况

（1） 本基金最后运作日的应付赎回款余额为人民币 4,605,640.42 元，已于清算期间支付。

（2） 本基金最后运作日的应付管理人报酬余额为人民币 36,994.86 元，该款项已于 2023 年 1 月 6 日支付。

（3） 本基金最后运作日的应付托管费余额为人民币 9,843.35 元，该款项已于 2023 年 1 月 6 日支付。

（4） 本基金最后运作日的应付销售服务费余额为人民币 14,101.13 元，该款项已于 2023 年 1 月 6 日支付。

（5） 本基金最后运作日的其他负债余额为人民币 36,721.99 元，由预提费用 35,000.00 元和应付赎回费 1,721.99 元构成。

预提费用为预提审计费。截至 2022 年 12 月 27 日(最后运作日)本基金预提基金清算审计费 35,000.00 元，该款项按照付款通知书已于 2023 年 1 月 11 日支付给普华永道中

天会计师事务所（特殊普通合伙）。应付赎回费 1,721.99 元已按照本基金赎回交收时效随应付赎回款于清算期间支付。

（四）资产负债表日后事项处理

（1）清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2022 年 12 月 28 日(基金清算起始日)至 2023 年 1 月 11 日(基金清算截止日)止期间
一、资产处置损益	-111,919.52
1. 利息收入	5,147.90
其中：存款利息收入（注 1）	5,147.90
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-9,576,806.90
其中：基金投资收益	-9,576,806.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,459,737.64
4. 其他收入（损失以“-”号填列）（注 2）	1.84
二、清算费用	179,368.05
1. 交易费用	178,966.62
2. 其他费用（注 2）	401.43
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-291,287.57

注：1. 存款利息收入为暂以当前适用的利率预估计提的自 2022 年 12 月 28 日至 2023 年 1 月 11 日止清算期间的银行存款利息。

2. 此处的其他收入为赎回费中归入基金资产的部分，其他费用为银行汇划手续费。

（五）清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项 目	金 额
一、2022 年 12 月 27 日(基金最后运作日)基金净资产	58,836,395.82
加：清算期间净损益	-291,287.57
减：清算期间确认的基金份额产生的净值变动（注 1）	1,096,003.38
二、2023 年 1 月 11 日(清算截止日)基金净资产	57,449,104.87

注：1、净值变动为投资者 2022 年 12 月 27 日提出申请并经本管理人登记系统确认的赎回交易与转出交易，其中赎回交易确认赎回金额 911,951.45 元，转出交易确认转出金额 184,051.93 元，合计 1,096,003.38 元。

资产处置及负债清偿后，于 2023 年 1 月 11 日本基金剩余财产为人民币 57,449,104.87 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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期截止日次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，后续产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担。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。

（六）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。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分配。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算审计报告
- 2、关于《平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算报告》的法律意见

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

财产清算小组

二〇二三年一月三十一日