

泰达宏利养老目标日期 2040 三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：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2023 年 3 月 24 日

清算报告公告日：2023 年 4 月 4 日

目录

重要提示.....	2
一、基金概况.....	2
二、基金运作情况.....	3
三、财务会计报告.....	4
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	7

重要提示

泰达宏利养老目标日期 2040 三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”）证监许可证监许可[2019]1190 号予以注册，于 2020 年 2 月 27 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《泰达宏利养老目标日期 2040 三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”）等有关规定：

“《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 2 亿元，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。”

截止 2023 年 2 月 27 日日终，本基金的基金规模低于 2 亿元人民币，触发基金合同约定的前述终止条件，因此本基金根据基金合同约定进入基金财产清算程序，而不需召开基金份额持有人大会。

本基金于 2023 年 2 月 28 日起进入清算期，由基金管理人泰达宏利基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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。

一、基金概况

基金名称	泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	泰达养老 2040 三年持有混合 FOF A/泰达养老 2040 三年持有混合 FOF C/泰达养老 2040 三年持有混合 FOF E
基金代码	007688/007694/007695
基金运作方式	开放式（其他开放式）
基金合同生效日	2020 年 2 月 27 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
最后运作日	2023 年 2 月 27 日
最后运作日基金份额总额	15,487,817.46

投资目标	通过借鉴海外成熟的目标日期策略，追求养老资产的长期稳健增值。			
投资策略	本基金主要投资于其他公开募集的基金，不参与被投资基金的投资管理。本基金为目标日期策略基金，基金将根据目标期限的临近和资本市场的变化情况，逐步适时调整基金资产在各类资产间的配置比例。			
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×A%+中证综合债指数收益率×B%。			
	序号	阶段	A	B
	1	基金合同生效日至 2022/12/31	55	45
	2	2023/1/1-2027/12/31	50	50
	3	2028/1/1-2032/12/31	45	55
	4	2033/1/1-2036/12/31	35	65
	5	2037/1/1-2040/12/31	20	80
6	目标日期（2040/12/31）以后	10	90	
风险收益特征	本基金为混合型目标日期 FOF，随着目标日期期限的接近，权益类投资比例逐渐下降，风险与收益水平会逐步降低。本基金风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金。			

二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2018】1669 号《关于准予泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》，证监许可【2019】1190 号《关于准予泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）变更注册的批复》注册，由泰达宏利基金管理有限公司于 2019 年 12 月 31 日起至 2020 年 2 月 24 日期间向社会公开发行人募集，基金合同于 2020 年 2 月 27 日生效，募集规模为 13,343,809.35 份基金份额。自 2020 年 2 月 27 日至 2023 年 2 月 27 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《泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》等有关规定：

“《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 2 亿元，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。”

截止 2023 年 2 月 27 日日终，本基金的基金规模低于 2 亿元人民币，触发基金合同约定的前述终止条件。

为更好维护基金份额持有人的利益，按照《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《泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定终止本基金《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2023 年 2 月 28 日起进入清算期。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 2 月 27 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日
	2023 年 2 月 27 日
资产：	
银行存款	14,082,721.23
结算备付金	2.80
存出保证金	256.11
应收申购款	166.82
其他应收款	98.10
应收证券清算款	2,770,777.41
资产总计	16,854,022.47
负债和所有者权益	最后运作日
	2023 年 2 月 27 日
负债：	
应付赎回款	
应付管理人报酬	8,447.15
应付托管费	1,597.75
应付销售服务费	542.49
应交税费	1,330.83
其他负债	36,356.22
负债合计	48,274.44
所有者权益：	
实收基金	15,487,817.46
未分配利润	1,317,930.57
所有者权益合计	16,805,748.03
负债和所有者权益总计	16,854,022.47

四、清算情况

自 2023 年 2 月 28 日至 2023 年 3 月 24 日止为本次清算期间，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。具体清算情况如下：

（一）清算费用

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，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用，分配基金剩余财产的手续费等，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（二）资产清算情况

截至本次清算期结束日（2023 年 3 月 24 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2023 年 2 月 28 日发布的《关于泰达宏利养老目标日期 2040 三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》，为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对未到账的应收利息进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、 本基金最后运作日银行存款为人民币 14,082,721.23 元，其中本金人民币 14,082,198.65 元，应计利息为人民币 522.58 元，该利息已于 2023 年 3 月 21 日划入托管账户。
- 2、 本基金最后运作日上海结算备付金应计利息为人民币 2.80 元，已于 2023 年 3 月 21 日划入托管账户。
- 3、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 256.11 元，其中上海存出保证金为人民币 112.62 元，应计利息为人民币 0.54 元，深圳存出保证金为人民币 142.27 元，应计利息为人民币 0.68 元，存出保证金已于 2023 年 3 月 2 日划入托管账户，保证金利息已于 2023 年 3 月 21 日划入托管账户。
- 4、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 166.82 元，该款分别于 2023 年 2 月 28 日、3 月 1 日、3 月 2 日划入托管账户。
- 5、 本基金最后运作日其他应收款为人民币 98.10 元，该款已于 2023 年 3 月 13 日划入托管账户。
- 6、 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 2,770,777.41 元，该款已于 2023 年 2 月 28 日划入托管账户。

（三）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 8,447.15 元，该款项已于 2023 年 3 月 3 日支付。
- 2、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,597.75 元，该款项已于 2023 年 3 月 3 日支付。
- 3、 本基金最后运作日应付 C 类基金份额销售服务费为人民币 542.49 元，该款项已于 2023 年 3 月 3 日支付。
- 4、 本基金最后运作日应付应交税费为人民币 1,330.83 元，该款项已于 2023 年 3 月 7 日支付。
- 5、 本基金最后运作日其他负债为预提审计费人民币 36,356.22 元，该款项已于 2023 年 3 月 13 日支付完毕。

（四）本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2023 年 2 月 28 至 2023 年 3 月 24 日止清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	3,739.19
清算期间收入小计	3,739.19
二、清算期间费用	
1、律师费	-10,000.00
2、其他费用（注 2）	-85.05
清算期间费用小计	-10,085.05
三、清算期间净收益	-6,345.86

注：

- （1） 利息收入为自 2023 年 2 月 28 日至 2023 年 3 月 24 日止清算期间的银行存款、结算备付金、保证金利息收入。
- （2） 其他费用为银行手续费。

（五）截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 2 月 27 日基金净资产	16,805,748.03
加：清算期间净收益	-6,345.86

加：基金申购金额（于 2023 年 2 月 28 日确认的投资者申购申请）	275.68
减：基金赎回金额（于 2023 年 2 月 28 日确认的投资者赎回申请）	1,952,560.31
二、2023 年 3 月 24 日基金净资产	14,847,117.54

截至本次清算期结束日 2023 年 3 月 24 日，本基金剩余财产为人民币 14,847,117.54 元。自本次清算期结束日次日 2023 年 3 月 25 日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。

本基金所有剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金清算报告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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于<泰达宏利养老目标日期 2040 三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》

（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

泰达宏利养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

基金财产清算小组

2023 年 3 月 24 日