

浦银安盛养老目标日期 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：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

清算报告出具日：2024 年 1 月 15 日

清算报告送出日：2024 年 1 月 25 日

## § 1 重要提示

浦银安盛养老目标日期 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”），系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〔2020〕512 号《关于准予浦银安盛养老目标日期 2040 三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，于 2020 年 12 月 16 日成立并正式运作。

根据《浦银安盛养老目标日期 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》”）“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”项下的约定：“《基金合同》生效之日起满三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续本《基金合同》期限。”

本基金《基金合同》生效日为 2020 年 12 月 16 日，《基金合同》生效之日起满三年后的对应日为 2023 年 12 月 16 日，由于该日为非工作日，顺延至下一工作日 2023 年 12 月 18 日。截至 2023 年 12 月 18 日日终，本基金的基金资产规模低于 2 亿元人民币，已触发上述《基金合同》约定的基金合同终止事由，《基金合同》自动终止，且无需召开基金份额持有人大会。

本基金的最后运作日为 2023 年 12 月 18 日，并已于 2023 年 12 月 19 日（含）起进入基金财产清算程序。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见 2023 年 12 月 19 日刊登在规定报刊和基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)）的《关于浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、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于 2023 年 12 月 19 日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，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## § 2 基金产品概况

基金名称	浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	浦银安盛养老 2040 三年持有混合（FOF）
基金代码	009626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日
报告期末(2023 年 12 月 18 日) 基金份额总额	16,433,799.56 份
投资目标	本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，随着所设定目标日期的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据浦银安盛养老目标日期基金下滑曲线模型进行动态大类资产配置，随着投资人生命周期的延续和目标日期的临近，权益类资产投资比例逐步下降，而非权益类资产投资比例逐步上升。同时，通过独创的量化基金优选模型来筛选基金，优先选择低波动率的标的基金，降低整体基金组合的波动率，并获取大类资产内部的 Alpha，最终实现基金资产在长时间内保值增值的目的。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×48%+中债综合指数收益率×52%
风险收益特征	本基金是采用目标日期策略的混合型基金中基金，风险与收益水平会随着所设定目标日期的临近而逐步降低。本基金平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

### § 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可〔2020〕512 号文准予注册，由基金管理人浦银安盛基金管理有限公司依照法律法规的规定和《浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》的约定于 2020 年 9 月 24 日至 2020 年 12 月 11 日向社会公开发行募集，《基金合同》于 2020 年 12 月 16 日生效。《基金合同》生效日的基金总份额为 14,983,618.13 份。

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。

根据《浦银安盛养老目标日期 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》”）“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”项下的约定：“《基金合同》生效之日起满三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续本《基金合同》期限。”本基金《基金合同》生效日为 2020 年 12 月 16 日，《基金合同》生效之日起满三年后的对应日为 2023 年 12 月 16 日，由于该日为非工作日，顺延至下一工作日 2023 年 12 月 18 日。截至 2023 年 12 月 18 日日终，本基金的基金资产规模低于 2 亿元人民币，已触发上述《基金合同》约定的基金合同终止事由，《基金合同》自动终止，且无需召开基金份额持有人大会。

根据《关于浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金最后运作日为 2023 年 12 月 18 日，自 2023 年 12 月 19 日（含）起进入基金财产清算程序。

## § 4 财务报告

### 4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：浦银安盛养老目标日期 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 12 月 18 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2023 年 12 月 18 日
<b>资产：</b>	
货币资金	12,702,190.24
结算备付金	4,427.01
存出保证金	499.57
应收清算款	2,063,754.94
应收申购款	323.12
其他资产	50.32
<b>资产总计</b>	<b>14,771,245.20</b>
负债和净资产	最后运作日 2023 年 12 月 18 日
<b>负债：</b>	
应付清算款	5,940.00
应付管理人报酬	5,746.67
应付托管费	1,153.04
其他负债	42,459.20
<b>负债合计</b>	<b>55,298.91</b>
<b>净资产：</b>	
实收基金	16,433,799.56
未分配利润	-1,717,853.27
<b>净资产合计</b>	<b>14,715,946.29</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>14,771,245.20</b>

注：1、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》、《浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》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。于本基金最后运作日，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。

2、报告截止日 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日），基金份额净值 0.8955

元，基金份额总额 16,433,799.56 份。

3、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师赵钰、沈俐签字出具了普华永道中天特审字(2024)第 0098 号标准无保留意见的审计报告。

## § 5 清算情况

自 2023 年 12 月 19 日至 2024 年 1 月 15 日止（即清算期间），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：

### 5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日）确认的应计银行存款利息 1,154.17 元、应计结算备付金利息 27.43 元和应计存出保证金利息 2.52 元以及自 2023 年 12 月 19 日本基金进入清算程序起至 2023 年 12 月 20 日止期间银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息收入，已经于 2023 年 12 月 21 日划入本基金托管账户。自 2023 年 12 月 21 日起至基金财产返还投资人前一日止期间，本基金银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息收入中未结息的部分将由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司先行垫付，待实际结息资金到账后再归还本基金的基金管理人，与之前预估数所产生的差异也由本基金的基金管理人承担，本基金的基金管理人垫付资金孳生的利息归本基金的基金管理人所有。

5.1.2 本基金 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日）存放于上海证券交易所的结算备付金为 4,427.01 元（含应计备付金利息 27.43 元），其中应计备付金利息 27.43 元已于 2023 年 12 月 21 日收回，剩余结算备付金 4,399.58 元将于本清算报告出具日（2024 年 1 月 15 日）后收回。

5.1.3 本基金 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日）存放于上海证券交易所的存出保证金为 475.57 元（含应计存出保证金利息 2.52 元）及存放于深圳证券交易所的存出保证金为 24.00 元，已于 2024 年 1 月 3 日前收回。

5.1.4 于 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日），本基金已计提的应收场外证券清算款 2,063,754.94 元，已于 2023 年 12 月 20 日前收回。

5.1.5 于 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日），本基金已计提的应收申购款 323.12 元，已于 2023 年 12 月 21 日前收回。

5.1.6 本基金 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日）确认的其他资产均为应收销售服务费返还，金额为 50.32 元，已于 2024 年 1 月 3 日收回。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 于 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日），本基金已计提的应付上海证券交易所清算款 5,940.00 元，已于 2023 年 12 月 19 日支付。

5.2.2 于 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日），本基金已计提的应付管理人报酬 5,746.67 元及应付托管费 1,153.04 元，已于 2024 年 1 月 4 日支付。

5.2.3 本基金 2023 年 12 月 18 日（基金最后运作日）确认的其他负债为 42,459.20 元，包括预提审计费 20,000.00 元，预提律师费 20,000.00 元及应付交易费用 2,459.20 元。其中，交易费用 2,459.20 元已于 2024 年 1 月 15 日支付。剩余款项将于本清算报告出具日（2024 年 1 月 15 日）后支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2023 年 12 月 19 日 至 2024 年 1 月 15 日 止清算期间
一、收入	7,784.42
1、利息收入	7,746.88
其中：银行存款、结算备付金和存 出保证金产生的利息收入	7,746.88
2、投资收益	37.54
二、费用	-
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	7,784.42

## 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 2023 年 12 月 18 日基金净资产	14,715,946.29
加：清算期间净收益	7,784.42
加：清算期间收到申购款	273.79
减：清算期间支付赎回、转出款（含费用）	1,176,516.66
二、2024 年 1 月 15 日基金净资产	13,547,487.84

根据本基金的《基金合同》及《关于浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》，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。

### 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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规的规定及《基金合同》的约定及时分配。

## §6 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- 1、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算财务报表及审计报告
- 2、上海源泰律师事务所关于浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算事宜之法律意见

### 6.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 基金管理人的办公场所。

### 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

清算报告出具日：2024 年 1 月 15 日

清算报告公告日：2024 年 1 月 25 日