

平安富时中国国企开放共赢交易型开放 式指数证券投资基金联接基金 清算报告

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二六年九月十六日

清算报告公告日：二〇二六年九月二十三日

目录

一、重要提示 1

二、基金概况 2

三、基金运作情况 2

四、财务会计报告 3

五、清算情况 4

六、备查文件 7

一、重要提示

平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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[2024]171号文《关于准予平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》准予注册，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《平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集，本基金基金合同于2024年3月26日生效。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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》和《平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2026年8月24日表决通过了《关于终止平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。于2026年8月25日发布了《平安基金管理有限公司关于平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金的最后运作日定为2026年8月25日，并于2026年8月26日进入清算程序。本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，并由安永华明会计师事务所（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事宜出具法律意见。

平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告

二、基金概况

基金名称	平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	平安富时中国国企开放共赢 ETF 联接		
基金主代码	020781		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024 年 3 月 26 日		
基金管理人	平安基金管理有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
基金最后运作日 (2026 年 8 月 25 日) 基金份额总额	11,463,317.35 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	平安富时中国国企开放共赢 ETF 联接 A	平安富时中国国企开放共赢 ETF 联接 C	平安富时中国国企开放共赢 ETF 联接 E
下属分级基金的交易代码	020781	020782	024545
基金最后运作日(2026 年 8 月 25 日) 下属分级基金的份额总额	3,303,710.82 份	8,028,454.78 份	131,151.75 份

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2024]171 号文《关于准予平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》核准，由平安基金管理有限公司依照法律法规、基金合同等规定向社会公开募集，本基金基金合同于 2024 年 3 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额为 213,353,173.62 份基金份额。

根据基金管理人于 2026 年 8 月 25 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决

平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告
 议生效的公告》，本基金最后运作日为 2026 年 8 月 25 日，自 2026 年 8 月 26 日起进入清算
 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。

四、财务会计报告

（一）基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2026 年 8 月 25 日

单位：人民币元

	最后运作日 2026 年 8 月 25 日
资产：	
货币资金	91,937.99
结算备付金	36,675.72
存出保证金	7,732.62
交易性金融资产	11,865,132.38
其中：基金投资	11,159,379.20
债券投资	705,753.18
应收清算款	109,981.13
应收申购款	1,987.80
资产总计	12,113,447.64
负债：	
应付赎回款	93,245.65
应付管理人报酬	147.88
应付托管费	29.58
应付销售服务费	1,178.28
应付税费	19.33
负债合计	94,620.72
净资产：	
实收基金	11,463,317.35
未分配利润	555,509.57
净资产合计	12,018,826.92
负债和净资产总计	12,113,447.64

注：基金最后运作日 2026 年 8 月 25 日，基金份额总额 11,463,317.35 份。其中，下属 A 类

基金份额净值 1.0520 元，基金份额总额 3,303,710.82 份；下属 C 类基金份额净值 1.0469

平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告元，基金份额总额 8,028,454.78 份；下属 E 类基金份额净值 1.0511 元，基金份额总额 131,151.75 份。

五、清算情况

自 2026 年 8 月 26 日至 2026 年 9 月 10 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

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，《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剩余财产中支付。

（二）资产处置情况

- （1） 本基金最后运作日银行存款为人民币 91,937.99 元，其中本金人民币 91,772.60 元，应计利息人民币 165.39 元。于清算期间计提应计利息人民币 837.51 元。截止至清算结束日银行存款为人民币 11,807,055.47 元，其中本金人民币 11,806,052.57 元，应计利息人民币 1,002.90 元。基金管理人于清算结束日后以自有资金垫付银行存款应计利息款项。
- （2） 本基金最后运作日结算备付金为人民币 36,675.72 元，其中本金人民币 36,666.39 元，应计利息人民币 9.33 元。于清算期间计提应计利息人民币 5.12 元，收到结算备付金结息人民币 4.57 元，其中 0.31 元计入利息收入。于清算期间自结算备付金划出至银行存款人民币 36,670.96 元。截止至清算结束日结算备付金为人民币 10.19 元，均为应计利息。基金管理人于清算结束日后以自有资金垫付结算备付金应计利息款项。
- （3） 本基金最后运作日存出保证金为人民币 7,732.62 元，其中本金人民币 7,726.42 元，应计利息人民币 6.20 元。于清算期间自存出保证金划出至银行存款人民币 7,726.42 元。于清算期间计提应计利息人民币 0.56 元。截止至清算结束日存出保证金为人民币 6.76 元，均为应计利息。基金管理人于清算结束日后以自有资金垫付存出保证金应计利息款项。
- （4） 本基金最后运作日应收清算款为人民币 109,981.13 元。于清算期间处置基金投资形成的应收清算款为人民币 11,138,869.37 元，处置债券投资形成的应收清算款为人民币 705,889.05 元，上述款项已于 2026 年 9 月 3 日前（含当日）划入本基金托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币1,987.80元。于最后运作日当日投资者提交的申购申请已于2026年8月26日确认,形成的应收申购款为人民币5,756.20元。上述款项已于2026年8月27日前(含当日)划入本基金托管账户。

(6) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币11,865,132.38元,为可流通的基金及债券投资。截至清算结束日,基金及债券投资均已处置变现,实际变现金额为人民币11,844,758.42元。

(三) 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币93,245.65元,该款项已于2026年8月28日前(含当日)支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币147.88元。该款项已于2026年9月3日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币29.58元。该款项已于2026年9月3日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1,178.28元。该款项已于2026年9月3日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币19.33元。于清算期间产生的应交税费为人民币8,099.57元。上述款项已于2026年9月7日前(含当日)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	自2026年8月26日至 2026年9月10日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	843.50
2、投资收益(注2)	254,204.76
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)(注3)	-281,810.49
4、其他业务收入(注4)	0.05
清算收益小计(损失以“-”填列)	-26,762.18
二、清算支出	
1、税金及附加	867.80
清算支出小计	867.80
三、清算净收益(损失以“-”填列)	-27,629.98

平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告
 注1：利息收入为清算期间计提的银行存款利息收入、结算备付金利息收入及存出保证金利息收入。

注2：投资收益为清算期间处置基金及债券投资产生的投资收益。

注3：公允价值变动损益为清算期间基金及债券投资处置结转的公允价值变动损益。

注4：其他业务收入为清算期间基金赎回费收入。

（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、最后运作日2026年8月25日基金净资产	12,018,826.92
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-27,629.98
清算期间转入持有人权益（注1）	5,756.20
清算期间从持有人权益转出（注2）	-189,880.72
二、清算结束日2026年9月10日基金净资产	11,807,072.42

注1：清算期间转入持有人权益系本基金份额持有人于最后运作日2026年8月25日提交的申购申请，已于2026年8月27日收到基金申购款。

注2：清算期间从持有人权益转出系本基金份额持有人于最后运作日2026年8月25日提交的赎回申请，已于2026年8月28日支付基金赎回款。

根据本基金《基金合同》的约定，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，按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的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，待结息日回款后再返还给基金管理人。

（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，在经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。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析。

六、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算审计报告
- 2、关于《平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告》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。

平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金财产清算小组

二〇二六年九月十六日