

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年9月5日

清算报告公告日：2018年10月20日

一、重要提示

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]第 681 号《关于核准大成景穗灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由大成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《大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。于 2015 年 5 月 4 日成立并正式运作,本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《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”中第二条“《基金合同》的终止事由”的约定:“基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元,基金合同自动终止(不需召开基金份额持有人大会审议)”。截至 2018 年 8 月 22 日,本基金已出现基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形,已触发基金合同终止条款。本基金将根据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止,无须召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人于 2018 年 8 月 23 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.dcfund.com.cn)发布了《大成基金管理有限公司关于大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2018 年 8 月 23 日起进入清算期,由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和北京市金杜律师事务所于 2018 年 8 月 27 日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,北京市金杜律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	大成景穗灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	大成景穗灵活配置混合	
基金主代码	001263	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月4日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
基金最后运作日（2018年8月22日） 基金份额总额	1,322,887.20份	
下属分级基金的基金简称：	大成景穗灵活配置混合 A	大成景穗灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码：	001263	002372
基金最后运作日（2018年8月22日） 下属分级基金的份额总额	1,240,498.04份	82,389.16份

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。
业绩比较基准	三年期定期存款税后利率+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

三、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：大成景穗灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年8月22日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	1,777,869.94	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金	34,564.8	衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	29,995.38
资产支持证券投资		应付管理人报酬	824.45
基金投资		应付托管费	164.88
衍生金融资产		应付销售服务费	30.85
买入返售金融资产		应付交易费用	1,721.77
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	3,545.46	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	161,497.34
其他资产		负债合计	194,234.67
		所有者权益：	
		实收基金	1,322,887.2
		未分配利润	298,858.33
		所有者权益合计	1,621,745.53
资产总计	1,815,980.20	负债和所有者权益总计	1,815,980.20

注：基金最后运作日2018年8月22日，大成景穗灵活配置混合A单位净值为1.226元，份额为1,240,498.04份，资产净值为1,520,860.16元；大成景穗灵活配置混合C单位净值为1.224元，份额为82,389.16份，资产净值为100,885.37元。

四、基金财产分配

自 2018 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 5 日止为清算期间，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：

1、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 1,777,869.94 元。
- (2) 本基金最后运作日结算保证金为人民币 34,564.8 元。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。
- (3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 3,545.46 元。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。

2、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 824.45 元，该款项已于 2018 年 9 月 4 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 164.88 元，该款项已于 2018 年 9 月 4 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 30.85 元，该款项已于 2018 年 9 月 4 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 29,995.38 元，该款项已于 2018 年 8 月 23 日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1721.77 元。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 161,497.34 元，该款项包含截至合同终止日本基金应付的银行汇划费 197.34 元，预提审计费 32,000.00 元，预提信息披露费 120,000.00 元，预提上清所、中债登账户维护费 9,300.00 元。

3、清算期间损益情况

清算期间损益情况		单位：人民币元
项目		
一、清算期间收入		
存款利息收入（注 1）		508.18
债券利息收入		0

投资收益	0
其他收入	87.53
清算期间收入小计①	595.71
二、清算期间费用	
交易费用	0
银行手续费（注 2）	120
增值税附加税费	0
清算期间费用小计②	120
三、清算期间净收益①-②	475.71

注 1：存款利息收入为自 2018 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 5 日期间的银行存款利息、结算备付金和结算保证金利息。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。

注 2：银行手续费为清算期间本基金托管账户的银行汇划费。

4、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	A 类份额	C 类份额
一、最后运作日 2018 年 8 月 22 日基金净资产	1,520,860.16	100,885.37
加：清算期间净收益	445.94	29.77
减：基金申购赎回净额 （于 2018 年 8 月 23 日确认的投资者申购赎回申请）	11,670.24	
二、清算期结束日 2018 年 9 月 5 日基金净资产	1,509,635.86	100,915.14

注：资产处置及负债清偿后，于 2018 年 9 月 5 日本基金剩余财产为人民币

1,610,551.00 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。

2018 年 9 月 5 日至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。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、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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《大成景穗灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《大成景穗灵活配置混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公住所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2018年9月5日