

大成强化收益定期开放债券型 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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年2月11日

清算报告公告日：2019年3月9日

一、重要提示

大成强化收益定期开放债券型证券投资基金(原大成强化收益债券型证券投资基金)(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[2008]第 523 号《关于核准大成强化收益债券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《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。于 2008 年 8 月 6 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”),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

2015 年 6 月 5 日,根据《准予大成强化收益债券型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2015]1148 号),中国证监会准予“大成强化收益债券型证券投资基金”变更注册为“大成强化收益定期开放债券型证券投资基金”。2015 年 6 月 12 日,大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,并于 2015 年 7 月 14 日审议通过了《关于大成强化收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案》。根据前述议案内容,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,基金管理人大成基金管理有限公司将《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》、《大成强化收益债券型证券投资基金托管协议》修订为《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金托管协议》,修订后的基金合同及托管协议于基金份额持有人大会表决通过之日(即 2015 年 7 月 14 日)起生效,原基金合同自同一起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:(二)决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”;第八十条规定,“有下列情形之一的,基金合同终止:(二)基金份额持有人大会决定终止”。根据《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定,“有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的”。基金管理人于 2018 年 12 月 8 日发布了《大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,以通讯

方式审议《关于终止大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于2018年12月10日、2018年12月11日陆续发布了提示性公告。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，本次基金份额持有人大会于2019年1月8日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。基金管理人于2019年1月9日刊登了《大成基金管理有限公司关于大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》

。

本基金自2019年1月17日起进入清算期，由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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2019年1月17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	大成强化收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	大成强化收益定期开放债券
基金主代码	090008
前端交易代码	090008
后端交易代码	091008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月6日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金最后运作日（2019年1月16日） 基金份额总额	8,724,692.85份

2、基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性基础上通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金将在严格控制组合风险的前提下，基于收益的要求，在资产配置、个券选择和交易策略层面上实施积极管理策略，以期在承担有限风险的前提下获得较高投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金定位于满足追求较高稳定回报的基金持有人的投资需求，风险收益水平高于货币市场基金，低于混合基金和股票基金。

三、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：大成强化收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年1月16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	11,123,282.86	短期借款	-
结算备付金	399,000.00	交易性金融负债	-
存出保证金	2,548.75	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	491,071.13
资产支持 证券投资	-	应付管理人报酬	29,697.65
基金投资	-	应付托管费	1,853.17
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融 资产	-	应付交易费用	1,880.74
应收证券清算款		应付税费	-
应收利息	4,062.77	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	159,643.65
其他资产	-	负债合计	684,146.34
		所有者权益：	
		实收基金	8,724,692.85
		未分配利润	2,120,055.19
		所有者权益合计	10,844,748.04
资产总计	11,528,894.38	负债和所有者权益总 计	11,528,894.38

注：基金最后运作日2019年1月16日，大成强化收益定期开放债券单位净值为1.243元，份额为8,724,692.85份，资产净值为10,844,748.04元。

四、基金财产分配

自 2019 年 1 月 17 日至 2019 年 2 月 11 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 11,123,282.86 元。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 399,000.00 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) 本基金最后运作日结算保证金为人民币 2,548.75 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。
- (4) 本基金最后运作日应收利息为人民币 4,062.77 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赎回款为人民币 491,071.13 元，该款项已于 2019 年 1 月 17 日支付。
- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 29,697.65 元。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,853.17 元。
- (3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,880.74 元。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 159,643.65 元，该款项包含截至合同终止日本基金应付的银行汇划费 343.65 元，预提审计费 40,000.00 元，预提信息披露费 110,000.00 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）	5,907.03
债券利息收入	0.00
投资收益	0.00
其他收入	0.00

清算期间收入小计①	5,907.03
二、清算期间费用	
交易费用	0.00
银行手续费（注2）	500.00
增值税附加税费	0.00
清算期间费用小计②	500.00
三、清算期间净收益①-②	5,407.03

注1：存款利息收入为自2019年1月17日至2019年2月11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	金额
一、最后运作日2019年1月16日基金净资产	10,844,748.04
加：清算期间净收益	5,407.03
减：基金申购赎回净额（于2019年1月17日确认的投资者申购赎回申请）	182,728.86
二、清算期结束日2019年2月11日基金净资产	10,667,426.21

注：资产处置及负债清偿后，于2019年2月11日本基金剩余财产为人民币10,667,426.21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。

2019年2月11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。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金清算报告之法律意见书》

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。

大成强化收益定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

2019年3月9日