

大成景沛灵活配置混合型证券投资基金 第二次清算报告

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年9月2日

公告日期：2019年10月8日

一、重要提示

大成景沛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 2197 号《关于准予大成景沛灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《大成景沛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 11 月 24 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”),基金托管人为中国光大银行股份有限公司(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 10 月 30 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 10 月 31 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沛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》。

基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人中国光大银行股份有限公司、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 10 月 31 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,本基金第一次清算已经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。

本基金首次清算期间为 2018 年 10 月 31 日至 2018 年 11 月 6 日。本基金的基金管理人于 2018 年 11 月 30 日对《大成景沛灵活配置混合型证券投资基金清算报告》进行了公告,并于 2018 年 11 月 30 日支付了第一次清算款。

本次清算为本基金第二次清算,清算期间为 2018 年 11 月 7 日至 2019 年 9 月 2 日。本清算报告已经基金托管人复核,在经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、北京市金杜律师事务所出具法律意见书后,已报中国证券监督管理委员会备案。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	大成景沛灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	大成景沛灵活配置混合	
基金主代码	002081	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月24日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
第二次清算结束日（2019年9月2日）基金份额总额	323,805.50份	
下属分级基金的基金简称：	大成景沛灵活配置混合A	大成景沛灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码：	002081	002237
第二次清算结束日（2019年9月2日）下属分级基金的份额总额	323,805.50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	本基金将有采用“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：大成景沛灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

资产	2019年9月2日 (二次清算结束日)	2018年10月30日(基金 最后运作日)
资产:		
银行存款	146,880.26	6,784,480.61
结算备付金		-
存出保证金		47,669.25
交易性金融资产		341,395.10
其中: 股票投资		341,395.10
债券投资		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息	83.97	5,519.77
应收股利		-
应收申购款		-
资产总计	146,964.23	7,179,064.73
负债:		
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,553.78
应付托管费		592.3
应付销售服务费		-
应付交易费用	54,717.37	54,634.02
应付税费		-
其他负债	600.00	204,300.00
负债合计	55,317.37	263,080.10
所有者权益:		
实收基金	323,805.50	6,574,134.06
未分配利润	-232,158.64	341,850.57
所有者权益合计	91,646.86	6,915,984.63
负债和所有者权益总计	146,964.23	7,179,064.73

注：报表截止日2019年9月2日，大成景沛灵活配置混合A单位净值为0.283元，份额为323,805.50份，资产净值为91,646.86元；大成景沛灵活配置混合C单位净值为0.283元，份额为0份，资产净值为0元。

四、基金财产分配

由于本基金于 2018 年 11 月 6 日（第一次清算结束日）仍持有限售股票导致部分资产尚未变现，故需进行第二次清算。

本次清算为第二次清算，清算期间为 2018 年 11 月 7 日至 2019 年 9 月 2 日，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：

截至本次清算期结束日（2019 年 9 月 2 日）各项资产负债清算情况如下：

1、资产处置情况

- (1) 本基金清算期结束日银行存款为人民币 146,880.26 元。
- (2) 本基金清算期结束日应收利息为人民币 83.97 元，为银行存款利息；应收银行存款利息由托管银行于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清。
- (3) 本基金持有的流通受限股票*ST 信威(600485)分别于 2019 年 8 月 29 日、2019 年 8 月 30 日卖出，并于 2019 年 8 月 30 日、2019 年 9 月 2 日变现 12.14 元和 91,376.38 元。

2、负债清偿情况

- (1) 本基金清算期结束日应付交易费用为人民币 54,717.37 元，该款项为交易所产生的佣金费用。
- (2) 本基金清算期结束日其他负债为 600.00 元，该款项将用于划款手续费。

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	
1. 利息收入（注 1）	3,890.43
2. 公允价值变动损益（注 2）	251,512.75
3. 投资收益（注 2）	-501,419.70
清算期间收入小计①	-246,016.52
二、清算期间费用	
1. 交易费用（注 2）	182.98
2. 其他费用（注 3）	-3,100.00

清算期间费用小计②	-2,917.02
三、清算期间净收益①-②	-243,099.50

注1：存款利息收入为自2018年11月7日至2019年9月2日期间的活期存款利息、结算保证金利息和最低备付金利息。

注2：公允价值变动损益、投资收益以及交易费用均由持有的流通受限的交易性金融资产持有期间和变现时产生。

注3：其他费用为冲销中债登账户维护费、上清所账户维护费以及上清所查询费。

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、第一次清算结束日2018年11月6日基金净资产	6,916,240.98	-
加：清算期间净收益	-243,099.50	-
减：第一次清算支付金额	6,581,494.62	-
二、2019年9月2日基金净资产	91,646.86	-

资产处置及负债清偿后，于2019年9月2日本基金剩余财产为人民币91,646.86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9月2日至最后一次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)《大成景沛灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《大成景沛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。

大成景沛灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2019年10月8日