

大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 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：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2021 年 4 月 15 日

清算报告公告日：2021 年 4 月 16 日

一、重要提示

大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金(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[2020]399 号《关于核准大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数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《大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。于 2020 年 6 月 8 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”或“我司”),基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中的约定“《基金合同》生效后,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,基金合同自动终止,无需召开基金份额持有人大会。”本基金管理人已于 2021 年 2 月 19 日、3 月 5 日、3 月 12 日发布了《关于大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》。

截至 2021 年 3 月 18 日日终,本基金的基金资产净值持续低于 5000 万元,本基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。自 2021 年 3 月 19 日起,本基金进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日刊登了《关于大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金触发基金合同终止情形及进入基金财产清算程序的公告》。

本基金自 2021 年 3 月 19 日起进入清算期,由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于 2021 年 3 月 19 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,上海市通力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	大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金
------	------------------------------

基金简称	大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数	
基金主代码	009221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 8 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
基金最后运作日（2021 年 3 月 18 日）基金份额总额	656,571.72 份	
各份额类别基金简称：	大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 A	大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 C
各份额类别基金交易代码：	009221	009222
基金最后运作日（2021 年 3 月 18 日）各份额类别基金的份额总额	135,096.95 份	521,474.77 份

2、基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	在正常市场情况下，基金管理人力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

三、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 3 月 18 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	944,374.93	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		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	59,923.62
资产支持证券投资		应付管理人报酬	68.38
基金投资		应付托管费	22.78
衍生金融资产		应付销售服务费	37.24
买入返售金融资产		应付交易费用	305.00
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	32,299.55	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	237,678.22
其他资产		负债合计：	298,035.24
		所有者权益：	
		实收基金	656,571.72
		未分配利润	22,067.52
		所有者权益合计：	678,639.24
资产合计：	976,674.48	负债与持有人权益总计：	976,674.48

注：基金最后运作日2021年3月18日，大成彭博巴克莱政策性银行债券3-5年指数A类基金份额单位净值为1.0361元，份额为135,096.95份，资产净值为139,973.67元；大成彭博巴克莱政策性银行债券3-5年指数C类基金份额单位净值为1.0330元，份额为521,474.77份，资产净值为538,665.57元。

四、基金财产分配

自 2021 年 3 月 19 日至 2021 年 4 月 15 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 944,374.93 元。
- (2) 本基金最后运作日应收利息为人民币 32,299.55 元。

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 68.38 元,该款项已于 2021 年 4 月 2 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 22.78 元,该款项已于 2021 年 4 月 2 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 37.24 元,该款项已于 2021 年 4 月 2 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 305.00 元,该款项包括应付中债登结算服务费 300.00 元已于 2021 年 3 月 29 日支付,应付交易手续费 5.00 元于 2021 年 4 月 15 日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 59,923.62 元,该款项已于 2021 年 3 月 19 日支付。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 237,678.22 元,该款项包含应付指数使用费 101,024.85 元,预提审计费 123,451.98 元,预提证券时报信披费 2,301.39 元,预提中债登及上清所账户维护费 10,900.00 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)		508.15
基金赎回费收入		0.05
清算期间收入小计①		508.20
二、清算期间费用		
银行手续费(注 2)		95.00

审计费（注 3）	48.02
冲回证券时报信息披露费	-2,301.39
冲回账户维护费	-1,600.00
清算期间费用小计②	-3,758.37
三、清算期间净收益①-②	4,266.57

注 1：存款利息收入为自 2021 年 3 月 19 日至 2021 年 4 月 15 日期间的银行存款利息。

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，费用以实际发生为准，差额计入基金资产。

注 3：根据与普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)清算审计业务约定书，本基金 2021 年审计费为 8,000.00 元，其中由本基金承担 3,500.00 元，管理人承担 4,500.00 元。

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 类基金份额	C 类基金份额
一、最后运作日 2021 年 3 月 18 日基金净资产	139,973.67	538,665.57
加：清算期间净收益	880.00	3,386.57
减：最后运作日赎回款、转出款	49.93	197.82
二、清算期结束日 2021 年 4 月 15 日基金净资产	140,803.74	541,854.32

注：（1）基金最后运作日 2021 年 3 月 18 日为本基金集中赎回选择期最后一日，于 2021 年 3 月 19 日确认大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 A 赎回份额为 48.19 份，于 2021 年 3 月 22 日支付大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 A 赎回款 49.88 元；于 2021 年 3 月 19 日确认大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 C 赎回份额为 191.50 份，于 2021 年 3 月 22 日支付大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数 C 赎回款 197.82 元。

（2）资产处置及负债清偿后，于 2021 年 4 月 15 日本基金剩余财产为人民币 682,658.06 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。

（3）2021 年 4 月 15 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（如有）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)《大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金清算审计报告》
- (2)关于《大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金清算报告》之法律意见

2、存放地点

基金管理人的住所。

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。

大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 4 月 15 日