

大成惠益纯债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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年11月11日

清算报告公告日：2021年11月12日

一、重要提示

大成惠益纯债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[2016]第1816号《关于准予大成惠益纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册,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《大成惠益纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。于2016年11月2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”),基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

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”;第八十条的规定,“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《大成惠益纯债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”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定,“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”。2021年9月23日,我司发布了《大成基金管理有限公司关于召开大成惠益纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的公告》,并于2021年9月24日和2021年9月27日分别发布了《大成基金管理有限公司关于召开大成惠益纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的第一次提示性公告》和《大成基金管理有限公司关于召开大成惠益纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的第二次提示性公告》。本次持有人大会审议事项为《关于终止大成惠益纯债债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》,会议权益登记日为2021年9月27日,大会表决投票时间为2021年9月28日起至2021年10月25日17:00止(以公告列明的表决票收件人收到表决票的时间为准)。我司于2021年10月27日发布了《大成基金管理有限公司关于大成惠益纯债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》。具体详见公司相关公告。

本基金自2021年10月28日起进入清算期,由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2021年10月28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,上海源泰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	大成惠益纯债债券型证券投资基金
基金简称	大成惠益纯债债券
基金主代码	003575
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金最后运作日（2021年10月27日）基金份额总额	11,965.34份

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，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。

三、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：大成惠益纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年10月27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	648.30	短期借款	
结算备付金	10.26	交易性金融负债	
存出保证金	24.45	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	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	
基金投资		应付托管费	0.84
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	
应收证券清算款	12,331.89	应付税费	
应收利息	0.61	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	507.74
其他资产		负债合计：	508.58
		所有者权益：	
		实收基金	11,965.34
		未分配利润	541.59
		所有者权益合计：	12,506.93
资产合计：	13,015.51	负债与持有人权益总计：	13,015.51

注：基金最后运作日2021年10月27日，大成惠益纯债债券型证券投资基金份额单位净值为1.0453元，份额为11,965.34份，资产净值为12,506.93元。

四、基金财产分配

自 2021 年 10 月 28 日至 2021 年 11 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 648.30 元。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 10.26 元。该款项已于 2021 年 11 月 2 日转入本基金托管户。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 24.45 元。该款项已于 2021 年 11 月 2 日转入本基金托管户。
- (4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 12,331.89 元。该款项已于 2021 年 10 月 28 日转入本基金托管户。
- (5) 本基金最后运作日应收利息为人民币 0.61 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托管费为人民币 0.84 元,该款项已于 2021 年 11 月 2 日支付。
- (2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 507.74 元,该款项包含 2021 年度预提审计费 437.74 元,其他费用 70.00 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)		3.75
清算期间收入小计①		3.75
二、清算期间费用		
预提审计费(注 2)		-437.74
清算期间费用小计②		-437.74
三、清算期间净收益①-②		441.49

注 1: 存款利息收入为自 2021 年 10 月 28 日至 2021 年 11 月 11 日期间的银行存款利息。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: 预提审计费已与会计师事务所核实确认减免。

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	
一、最后运作日 2021 年 10 月 27 日基金净资产	12,506.93
加: 清算期间净收益	441.49
最后运作日申购款	12,427.80
减: 最后运作日赎回款、转出款	-
二、清算期结束日 2021 年 11 月 11 日基金净资产	25,376.22

注: (1) 资产处置及负债清偿后, 于 2021 年 11 月 11 日本基金剩余财产为人民币 25,376.22 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 11 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 (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。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《大成惠益纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于大成惠益纯债债券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。

大成惠益纯债债券型证券投资基金财产清算小组

2021 年 11 月 11 日