

大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型 发起式基金中基金(FOF) 清算报告

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年7月13日

清算报告公告日：2023年7月14日

一、重要提示

大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(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[2019]2545号《关于准予大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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《大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。于2020年6月17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”、“我司”或“公司”),基金托管人为中国银行股份有限公司(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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金已触发基金合同终止情形,基金管理人应当在上述终止情形出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序,此事项不需召开基金份额持有人大会。根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:“基金合同生效之日起3年后的对应日,若基金资产净值低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”本基金基金合同生效日为2020年6月17日,基金合同生效之日起满三年后的对应日为2023年6月17日,由于该日为非工作日,顺延至下一工作日2023年6月19日。截至2023年6月19日日终,本基金的基金规模低于2亿元人民币,触发《基金合同》约定的前述终止条件,因此本基金根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序,而不需召开基金份额持有人大会。

本基金自2023年06月20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2023年06月20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	大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
基金简称	大成兴享平衡养老三年持有混合(FOF)
基金主代码	008753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年6月17日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金最后运作日(2023年06月19日)基金份额总额	50,535,576.42份

2、基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上,通过资产配置和基金优选,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金属于平衡型的养老目标风险基金,将根据基金合同约定的权益类、非权益类资产的目标配置比重进行资产配置。同时,基金经理将根据市场实际表现及预期判断,在基金合同约定的范围内对各大类资产配置比例进行动态调整。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×45%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×5%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。 本基金还可投资港股通标的股票,还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

报告截止日：2023年06月19日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2023年06月19日
资产：	
银行存款	4,527,847.62
结算备付金	20,213.94
存出保证金	1,255.30
交易性金融资产	46,239,768.21
其中：基金投资	46,239,768.21
应收清算款	788,088.60
应收股利	29,780.30
应收申购款	689.03
其他资产	331.35
资产合计	51,607,974.35
负债：	
应付管理人报酬	23,532.94
应付托管费	3,741.07
应交税费	982.51
其他负债	58,000.00
负债合计	86,256.52
所有者权益：	
实收基金	50,535,576.42
未分配利润	986,141.41
所有者权益合计	51,521,717.83

负债和所有者权益总计	51,607,974.35
------------	---------------

注：基金最后运作日2023年06月19日，大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)份额单位净值为1.0195元，份额50,535,576.42份。

四、基金财产分配

自 2023 年 06 月 20 日至 2023 年 07 月 13 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 4,527,847.62 元,其中银行托管户余额 4,523,757.66 元,应计利息 4,089.96 元。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 20,213.94 元。其中上交所最低结算备付金余额 17,905.29 元,上交所最低备付金应计利息 10.59 元,深交所最低结算备付金余额 2,293.60 元,深交所最低备付金应计利息 4.46 元。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,255.30 元。其中上交所存出保证金账户余额 16.26 元,上交所存出保证金应计利息 3.26 元,深交所存出保证金账户余额 1,229.65 元,深交所存出保证金应计利息 6.13 元。
- (4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 46,239,768.21 元,全部为基金投资。该基金投资已于 6 月 27 日全部处置变现,总计变现金额为人民币 46,259,553.63 元。
- (5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 788,088.60 元,已于 2023 年 06 月 20 日划入本基金托管账户。
- (6) 本基金最后运作日应收股利为人民币 29,780.30 元,已于 2023 年 06 月 20 日分红转投。
- (7) 本基金最后运作日已确认的应收申购款为人民币 689.03 元,分为两笔,均已于 2023 年 6 月 20 日和 2023 年 6 月 21 日划入本基金托管账户。
- (8) 本基金最后运作日其他资产为人民币 331.35 元,均为销售服务费返还收入,该款项将于 2023 年 07 月 14 日划入本基金托管账户。

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 23,532.94 元,该款项将于清算期间结束后支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,741.07 元,该款项将于清算期间结束后支付。
- (3) 本基金最后运作日应交税费为人民币 982.51 元,该款项将于清算期间结束后支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 58,000.00 元,其中应付审计费 23,000.00 元,应付信息披露费 35,000.00 元,该款项将于清算期间结束后支付。

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（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	5,705.11
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	22,485.48
其他收入（注3）	105.42
清算期间收入小计①	28,296.01
二、清算期间费用	
税费（注4）	304.27
交易费用（注5）	35,015.91
汇划费（注6）	200.00
预估汇划费（注7）	1,000.00
清算期间费用小计②	36,520.18
三、清算期间净收益①-②	-8,224.17

注1：利息收入系计提的自2023年06月20日起至2023年07月13日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出交易性金融资产的成交金额减去交易性金融资产最后运作日的估值总额后的差额。

注3：其他收入系自2023年06月20日起至2023年07月13日止清算期间销售服务费返还收入。

注4：处置交易性金融资产产生的税务费用，该款项将于清算期间结束后支付。

注5：处置交易性金融资产产生的交易费用，清算期间已支付。

注6：汇划费系自2023年06月20日起至2023年07月13日止清算期间支付的划款费用。

注7：预估汇划费系预计清算期结束后需要支付的划款费用。

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 2023 年 06 月 19 日基金净资产	51,521,717.83
加：清算期间净收益	-8,224.17
加：最后运作日申请的申购款	70.92
减：最后运作日申请的赎回款	25,436,060.44
二、清算期结束日 2023 年 07 月 13 日基金净资产	26,077,504.14

注：（1）资产处置及负债清偿后，于 2023 年 07 月 13 日本基金剩余财产为人民币 26,077,504.14 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。

（2）2023 年 07 月 13 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）《大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)清算审计报告》

（2）《关于〈大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)清算报告〉的法律意见》

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。

大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金财产清算小组

2023 年 07 月 13 日