

# 万家家泰债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：万家基金管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

基金主代码：003908

信息披露日期：2017 年 12 月 2 日

## 一、重要提示

万家家泰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证监许可【2016】1171 号文准予注册，于 2017 年 3 月 3 日成立并正式运作，基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

万家家泰债券型证券投资基金份额持有人大会于 2017 年 10 月 16 日表决通过了《关于终止万家家泰债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见 2017 年 10 月 17 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站上的《万家家泰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》。

根据持有人大会的决议，本基金从 2017 年 10 月 18 日起进入清算期，由基金管理人万家基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2017 年 10 月 18 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，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、基金名称：万家家泰债券型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同生效日：2017 年 3 月 3 日
- 4、基金管理人：万家基金管理有限公司
- 5、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
- 6、2017 年 10 月 17 日基金份额总额：3,749,309.07 份（其中万家家泰 A 份额：3,507,497.49 份，其中万家家泰 C 份额：241,811.58 份）
- 7、投资目标：在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的收益。
- 8、投资策略：本基金在构建债券投资组合时合理评估收益性、流动性和信用风险，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金采取积极的债券投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测；在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例；以此为框架，通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。针对可转换债券、含权债券、资产证券化品种及其它固定收益类衍生品种，本基金区别对待，制定专门的投资

策略。

9、业绩比较基准：中债总全价指数（总值）收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%

10、风险收益特征：本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于中低风险/收益的产品。

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1171 号文准予注册，由基金管理人万家基金管理有限公司于 2016 年 11 月 29 日至 2017 年 2 月 28 日向社会公开发行人募集，基金合同于 2017 年 3 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 222,548,952.84 份基金份额，其中万家家泰 A 份额 125,721,489.92 份，万家家泰 C 份额 96,827,462.92 份。自 2017 年 3 月 3 日至 2017 年 10 月 17 日期间，本基金按基金合同正常运作。

万家家泰债券型证券投资基金基金份额持有人大会于 2017 年 10 月 16 日表决通过了《关于终止万家家泰债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，根据持有人大会通过的议案及方案说明，本基金从 2017 年 10 月 18 日起进入清算期。

### 四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：万家家泰债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 10 月 17 日

单位：人民币元

最后运作日：2017 年 10 月 17 日			
资 产：		负 债：	
银行存款	41,335.13	短期借款	
结算备付金	247,626.51	交易性金融负债	
存出保证金	1,142.36	衍生金融负债	
交易性金融资产	128,638.00	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	128,638.00	应付赎回款	100.09
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,231.24
基金投资		应付托管费	351.77
衍生金融资产		应付销售服务费	45.94
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款	3,449,595.71	应付税费	
应收利息	6,078.24	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		应付信息披露费	96,709.20
其他资产		负债合计	98,438.24
		所有者权益：	

		实收基金	3,749,309.07
		未分配利润	26,668.64
		所有者权益合计	3,775,977.71
资产合计:	3,874,415.95	负债与持有人权益总计:	3,874,415.95

注：截至 2017 年 10 月 17 日（基金最后运作日），万家家泰 A 份额总额 3,507,497.49 份，基金份额净值 1.0074 元，基金资产净值 3,533,380.84 元；万家家泰 C 份额总额 241,811.58 份，基金份额净值 1.0032 元，基金资产净值 242,596.87 元。

## 五、基金财产分配

自 2017 年 10 月 18 日至 2017 年 10 月 27 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《万家家泰债券型证券投资基金》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算费用中的律师费、审计费由基金管理人承担。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 41,335.13 元，该部分款项存放于托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 247,626.51 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管，该笔资金由基金管理人万家基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金待结算公司返还后再归还基金管理人。

(3) 本基金最后运作日结算保证金为人民币 1,142.36 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管，该笔资金由基金管理人万家基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金待结算公司返还后再归还基金管理人。

(4) 本基金最后运作日持有证券资产人民币 128,638.00 元，于 2017 年 10 月 18 日卖出，于 10 月 19 日划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为 3,449,595.71 元，于 10 月 18 日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收利息人民币 6,078.24 元，其中人民币 5,708.12 元系持有债券利息，已于 2017 年 10 月 19 日划入托管账户，其余人民币 370.12 元由基金管理人万家基金管理有限公司以自有资金先行垫付，待结息日返还给基金管理人。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 100.09 元, 已于 2017 年 10 月 18 日支付。2017 年 10 月 17 日基金赎回申请应付赎回款人民币 3,427.44 元, 已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,231.24 元, 该款项已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 351.77 元, 该款项已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 45.94 元, 该款项已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付信息披露费为人民币 96,709.20 元, 该款项已于 2017 年 10 月 27 日支付。

#### 4、清算期间的剩余资产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2017 年 10 月 17 日基金净资产	3,775,977.71
加: 清算期间 (2017-10-18至2017-10-27) 收入	1,810.48
利息收入-银行存款利息收入 (注1)	829.85
利息收入-债券利息收入 (注 2)	18.05
债券变现损益 (注 3)	962.58
减: 清算期间 (2017-10-18至2017-10-27) 费用	12,325.00
中债上清账户维护费 (注4)	12,300.00
银行手续费 (注5)	25.00
减: 清算期间 (2017-10-18至2017-10-27) 权益变动	3,427.44
基金赎回 (注6)	3,427.44
二、2017年10月27日基金净资产	3,762,035.75

注: 截至 2017 年 10 月 27 日, 万家家泰 A 基金资产净值 3,520,315.57 元, 万家家泰 C 基金资产净值 241,720.18 元。

注: (1) 利息收入系计提自 2017 年 10 月 18 日至 2017 年 10 月 27 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金以及存出保证金利息。

(2) 债券利息收入系计提 2017 年 10 月 18 日的债券利息。

(3) 债券变现损益为本次清算期间债券资产变现金额扣除清算期间债券利息后, 与最后运作日估值金额相减的差额。

(4) 清算期间中债上清维护费人民币 12,300.00 元, 其中人民币 9,300.00 元已于 10 月 18 日支付, 尚未支付金额为人民币 3,000.00 元, 将于销户时支付。

(5) 清算期间的银行汇划费, 由本基金份额持有人承担, 从基金财产中支付。

(6) 2017 年 10 月 17 日的基金赎回申请, 确认赎回金额为人民币 3,427.44 元, 已于 10 月 20 日支付。

资产处置及负债清偿后, 于 2017 年 10 月 27 日本基金剩余资产为人民币 3,762,035.75 元, 将根据本基金的《基金合同》约定, 依据基金财产清算的分配方案, 按基金份额持有

人持有的基金份额比例进行分配。

2017年10月18日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及结算保证金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人万家基金管理有限公司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。待结息日回款后再返还给基金管理人。

#### 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

### 1、备查文件目录

(1)《万家家泰债券型证券投资基金基金 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 10 月 17 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

(2)《万家家泰债券型证券投资基金清算报告》的法律意见书

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 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。

万家家泰债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2017 年 10 月 27 日