

万家市政纯债定期开放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

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

基金主代码：519192

信息披露日期：2015 年 2 月 10 日

一、重要提示

万家市政纯债定期开放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【2013】1022 号文核准募集，于 2013 年 11 月 27 日成立并正式运作，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》和《万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金在每个开放期最后一个开放日日终，基金份额持有人人数低于 200 人，或者基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额减去当日有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元，或者 10 大基金份额持有人持有 90%以上基金份额，基金合同应当终止。

截止本基金开放期最后一个开放日（即 2014 年 12 月 17 日）日终，本基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额减去当日有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额为 2536.48 万元。因此根据基金合同约定，本基金合同经向中国证监会报告后将终止，并依法履行基金财产清算程序。

本基金从 2014 年 12 月 19 日起进入清算期，由基金管理人万家基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京大成（上海）律师事务所于 2014 年 12 月 19 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，北京大成（上海）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：万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型定期开放式
- 3、基金合同生效日：2013 年 11 月 27 日
- 4、2014 年 12 月 18 日基金份额总额：24,877,176.60 份
- 5、投资目标：本基金以市政建设主题相关的债券作为主要投资对象，通过严格的信用风险控制和流动性管理，力争实现超越业绩比较基准的收益。
- 6、投资策略：本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期投资策略：基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响固定收益投资品价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
- 7、业绩比较基准：中债总全价指数（总值）
- 8、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低风险品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

9、基金管理人：万家基金管理有限公司

10、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

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【2013】1022 号文核准，由基金管理人万家基金管理有限公司于 2013 年 11 月 1 日至 2013 年 11 月 22 日向社会公开发行人募集，基金合同于 2013 年 11 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 381,465,178.90 份基金份额。自 2013 年 11 月 27 日至 2014 年 12 月 18 日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金在每个开放期最后一个开放日日终，基金份额持有人人数低于 200 人，或者基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额减去当日有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元，或者 10 大基金份额持有人持有 90%以上基金份额，基金合同应当终止。

本基金在封闭运作一年后，于 2014 年 11 月 27 日至 12 月 17 日开放申购赎回，截止本基金开放期最后一个开放日（即 2014 年 12 月 17 日）日终，本基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额减去当日有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额为 2536.48 万元。因此根据基金合同约定，本基金合同经向中国证监会报告后将终止，并依法履行基金财产清算程序，本基金从 12 月 19 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：万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 18 日

单位：人民币元

	最后运作日 2014 年 12 月 18 日
资 产：	
银行存款	15,320,967.48
结算备付金	5,558,590.49
存出保证金	29,458.69
买入返售金融资产	21,780,130.89
应收利息	39,554.19
资产总计	42,728,701.74
负 债：	
应付赎回款	16,484,637.66
应付管理人报酬	32,437.57
应付托管费	9,267.87
应付交易费用	9,373.25
应交税费	479,982.00
其他负债	348,478.75
负债合计	17,364,177.10
所有者权益：	
实收基金	24,877,176.60
未分配利润	487,348.04

所有者权益合计	25,364,524.64
负债和所有者权益总计	42,728,701.74

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《万家市政纯债定期开放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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日买入返售金融资产人民币21,780,130.89元，已于2014年12月19日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息人民币39,554.19元，其中人民币1,808.43元系应收买入返售金融资产利息，已于2014年12月19日划入托管账户，其余人民币37,745.76元已分别于2014年12月22日和2014年12月23日划入托管账户。

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 16,484,637.66 元，其中人民币 11,760,138.68 元已于 2014 年 12 月 19 日支付，其中人民币 4,724,498.98 元已于 2014 年 12 月 22 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 32,437.57 元，该款项已于 2014 年 12 月 26 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 9,267.87 元，该款项已于 2014 年 12 月 26 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 9,373.25 元，该款项已于 2014 年 12 月 26 日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 479,982.00 元，该款项已于 2014 年 12 月 26 日划至基金管理人账户，将由基金管理人代付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 348,478.75 元，该款项已于 2014 年 12 月 26 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

项目	自2014年12月19日 至2014年12月31日 止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	8,810.19
清算收入小计	<u>8,810.19</u>
二、清算费用	
1、清算审计费（注2）	10,833.57
2、清算信息披露费（注3）	10,687.68
3、银行手续费（注4）	4,092.12
4、账户维护费（注5）	12,200.00
5、律师费（注6）	15,000.00
清算费用小计	<u>52,813.37</u>
三、清算净收益	<u>-44,003.18</u>

注1：利息收入系计提的自2014年12月19日至2014年12月31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。

注2：与基金清算相关的审计费已于2014年12月26日支付。

注3：与基金清算相关的信息披露费已于2014年12月26日支付。

注4：与基金清算相关的银行手续费人民币4,092.12元，其中人民币3,937.12元已于2014年12月24日支付，人民币30.00元已于2014年12月25日支付，尚未支付金额为人民币125.00元，将于销户时支付。

注5：与基金清算相关的账户维护费已于2014年12月26日支付。

注6：与基金清算相关的律师费已于2014年12月26日支付。

5、资产处置及负债清偿后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2014年12月18日基金净资产	25,364,524.64
加：清算期间净收益	-44,003.18
二、2014年12月31日基金净资产	25,320,521.46

资产处置及负债清偿后，于2014年12月31日本基金剩余财产为人民币25,320,521.46元。2015年1月30日，基金清算款已由托管账户划出，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2014年12月19日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。截至2014年12月20日止的应收活期存款利息共计人民币29,078.31元已于2014年12月22日划入托管账户，截至2014年12月20日止的应收备付金以及存出保证金利息共计人民币10,185.23元已于2014年12月23日划入托管账户。自2014年12月21日起至清算款划出日前一日止期间的应收利息共计人民币22,688.15元，已由基金管理人以自有资金垫付并于2015年1月30日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

截至清算款划出日前一日止，本基金托管账户结算备付金人民币5,558,590.49元以及存出保证金人民币3,773.98元已于2015年1月6日划入托管账户，剩余存出保证金人民币25,684.71元尚未退回本基金托管账户，已由基金管理人以自有资金垫付并于2015年1月30日划入托管账户。垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

6、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) 万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金 2014 年 12 月 18 日资产负债表及审计报告

(2) 《万家市政纯债定期开放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。

万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2015 年 2 月 10 日