

万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券 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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2023 年 4 月 4 日

清算报告公告日：2023 年 4 月 12 日

一、重要提示

万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金转型而来，经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]452 号文准予变更注册，《万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 18 日生效，基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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》《万家 3-5 年政策性金融债纯债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，万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会已于 2023 年 2 月 28 日起，至 2023 年 3 月 26 日通过通讯方式召开。本次基金份额持有人大会于 2023 年 3 月 27 日表决通过了《关于终止万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

本基金自 2023 年 3 月 28 日（含）起进入清算期，由基金管理人万家基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、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 2023 年 3 月 28 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 3-5 年政策性金融债纯债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：2019 年 6 月 18 日
- 4、基金管理人：万家基金管理有限公司
- 5、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 6、2023 年 3 月 27 日基金份额总额：10,055,314.12 份（其中万家 3-5 年政金债 A 份额：8,145,548.44 份，其中万家 3-5 年政金债 C 份额：1,909,765.68 份）
- 7、投资目标：在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
- 8、投资策略：（1）资产配置策略；（2）利率预期策略；（3）期限结构配置策略；（4）属类配置策略；（5）债券品种选择策略；（6）其他。
- 9、业绩比较基准：中证政策性金融债 3-5 年指数收益率
- 10、风险收益特征：本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

三、基金运作情况概述

本基金由万家年年恒祥定期开放债券型证券投资基金转型而来，经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]452 号文准予变更注册，《基金合同》于 2019 年 6 月 18 日生效。自 2019 年 6 月 18 日至 2023 年 3 月 27 日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

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》、《基金合同》的有关规定，本基金基金份额持有人大会已于2023年2月28日起，至2023年3月26日通过通讯方式召开。本次基金份额持有人大会于2023年3月27日表决通过了《关于终止万家3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金从2023年3月28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3-5年政策性金融债纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023年3月27日

单位：人民币元

最后运作日：2023年3月27日	
资 产：	
银行存款	590,968.97
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	10,705,044.09
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	10,705,044.09
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	11,296,013.06
负债和净资产：	
负 债：	
短期借款	-

交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	2,507.51
应付托管费	835.83
应付销售服务费	312.71
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	33,942.07
负债合计	37,598.12
净资产：	
实收基金	10,055,314.12
其他综合收益	-
未分配利润	1,203,100.82
净资产合计	11,258,414.94
负债和净资产总计	11,296,013.06

注：截至 2023 年 3 月 27 日（基金最后运作日），万家 3-5 年政金债 A 份额总额 8,145,548.44 份，基金份额净值 1.1222 元，基金资产净值 9,141,178.56 元；万家 3-5 年政金债 C 份额总额 1,909,765.68 份，基金份额净值 1.1086 元，基金资产净值 2,117,236.38 元。

五、基金财产分配

自 2023 年 3 月 28 日至 2023 年 4 月 3 日止的清算期间，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《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”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剩余财产中支付。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，本基金的律师费将由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 590,968.97 元。其中银行活期存款为人民币 590,926.98 元，该部分款项存放于托管账户。其中应计银行存款利息为人民币 41.99 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，供清盘分配使用，待清算期后将返还给基金管理人，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2) 本基金最后运作日交易型金融资产余额为 10,705,044.09 元。其中上交所债券投资公允价值为 2,040,534.25 元，已于 3 月 28 日全部卖出；其中银行间债券投资公允价值为 8,664,509.84 元，已于 3 月 29 日全部卖出，合计清算金额为人民币 10,704,664.01

元，已全部划入托管账户。

3、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 2,507.51 元，该款项已于 2023 年 4 月 3 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 835.83 元，该款项已于 2023 年 4 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 312.71 元，该款项已于 2023 年 4 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 33,942.07 元，其中债券结算服务费人民币 300.00 元已于 2023 年 4 月 3 日支付，交易手续费人民币 43.75 元在收到外汇交易中心费用单后支付；应付审计费共计为人民币 24,711.94 元，在收到审计发票后支付；应付上清所、中债账户维护费共计为人民币 8,886.38 元，该款项已于 2023 年 4 月 3 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自2023年3月28日至2023年4月3日的清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注1）	664.54
2、投资收益（注2）	-3,419.83
3、公允价值变动收益（注3）	2,868.50
清算收入小计	113.21
二、清算期间费用	
1、其他费用（注4）	438.62
清算费用小计	438.62
三、清算净收益	-325.41

注：（1）利息收入系计提自 2023 年 3 月 28 日至 2023 年 4 月 3 日止清算期间的银行存款利息。

（2）投资收益系清算期间债券利息收入及债券卖出产生的差价收入合计-3,248.58 元扣除卖出交易费用 171.25 元后的净额。

（3）公允价值变动收益系清算期间卖出债券时转出的公允价值变动累计金额。

（4）其他费用系清算期间的计提中债上清账户维护费 413.62 元，以及汇划费 25.00 元。

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2023年3月27日基金净资产	11,258,414.94
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-325.41
减：基金净赎回转出金额	11.15
二、清算结束日2023年4月3日基金净资产	11,258,078.38

截至 2023 年 4 月 3 日，万家 3-5 年政金债 A 基金资产净值 9,140,903.21 元，万家 3-5 年政金债 C 基金资产净值 2,117,175.17 元。

资产处置及负债清偿后,于 2023 年 4 月 3 日本基金剩余净资产为人民币 11,258,078.38 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。

2023 年 4 月 4 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息归基金份额持有人所有。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。基金管理人垫付的资金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。

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 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《上海市通力律师事务所关于〈万家 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

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 3-5 年政策性金融债纯债债券型证券投资基金
基金财产清算小组
2023 年 4 月 4 日(清算报告出具日期)