

申万菱信基金管理有限公司

申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金

清算报告

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

基金主代码：004007

信息披露日期：2018年08月24日

一、重要提示

申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2016年11月23日证监许可【2016】2789号文注册募集，于2017年6月27日成立并正式运作，基金托管人为广州农村商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《申万菱信安泰添利纯债一年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，《基金合同》生效后，在每个开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，基金合同应当终止并履行清算程序：

（1）基金资产净值加上当日交易申请确认的净申购金额（申购确认净金额及基金转换中转入确认净金额扣除赎回确认金额及基金转换中转出确认金额）后的余额低于5000万元；

（2）基金份额持有人人数少于200人。

截止本基金第一个开放期最后一日（即2018年7月3日）日终，本基金基金资产净值加上当日交易申请确认的净申购金额（申购确认净金额及基金转换中转入确认净金额扣除赎回确认金额及基金转换中转出确认金额）后的余额低于5000万元，已触发基金合同中约定的基金合同终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》有关约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金基金合同将终止并依法履行基金财产清算程序。

本基金自2018年7月5日起进入清算期，由基金管理人申万菱信基金管理有限公司、基金托管人广州农村商业银行股份有限公司、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2018年7月5日组成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：申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金
- 2、基金简称：申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券
- 3、基金主代码：004007
- 4、基金运作方式：契约型开放式

本基金以定期开放方式运作。基金合同生效后，采取封闭期与开放期滚动的方式运作。

- 5、基金合同生效日：2017年6月27日

- 6、2018年7月4日（最后运作日）基金份额总额：**22,617,501.93份**

7、投资目标：本基金在严格控制风险的前提下，努力追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

8、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，在严格控制流动性风险和信用风险等风险的基础上，实施积极的债券投资组合管理，以期获取较高的债券组合投资收益。

- 9、业绩比较基准：中国债券总指数（全价）收益率。

10、风险收益特征：本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

- 11、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

- 12、基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会2016年11月23日证监许可【2016】2789号文注册募集，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币219,469,676.57元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2017)第653号验资

报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于2017年6月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为219,493,900.09份基金份额，其中认购资金利息折合24,223.52份基金份额。自2017年6月27日至2018年7月4日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》约定，《基金合同》生效后，在每个开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，基金合同应当终止并履行清算程序：（1）基金资产净值加上当日交易申请确认的净申购金额（申购确认净金额及基金转换中转入确认净金额扣除赎回确认金额及基金转换中转出确认金额）后的余额低于5000万元；（2）基金份额持有人人数少于200人。

2017年6月27日至2018年6月26日为本基金第一个封闭期，2018年6月27日（含该日）至2018年7月3日（含该日），本基金进入第一个开放期，投资者可以在前述开放期内办理基金份额的申购、赎回业务。截止本开放期最后一日（即2018年7月3日）日终，本基金基金资产净值加上当日交易申请确认的净申购金额（申购确认净金额及基金转换中转入确认净金额扣除赎回确认金额及基金转换中转出确认金额）后的余额低于5000万元，已触发基金合同中约定的基金合同终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》有关约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金基金合同将终止并依法履行基金财产清算程序。本基金自2018年7月5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：申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年7月4日（基金最后运作日）

资产	本期末 2018年7月4日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	79,209,210.20	1,008,973.56
结算备付金	1,398,776.16	4,060,096.24
存出保证金	29,141.17	18,662.07
交易性金融资产	-	367,044,980.00
其中：债券投资	-	367,044,980.00

应收利息	12,201.77	6,345,249.35
应收申购款	100,239.86	-
资产总计	80,749,569.16	378,477,961.22
负债和所有者权益		
负债：		
卖出回购金融资产款	-	155,435,467.95
应付证券清算款	-	32,384.75
应付赎回款	56,894,395.71	-
应付管理人报酬	2,608.77	56,674.79
应付托管费	869.60	18,891.60
应付交易费用	9,378.27	14,755.58
应付税费	5,559.46	-
应付利息	-	153,857.16
其他负债	215,000.00	210,000.00
负债合计	57,127,811.81	155,922,031.83
所有者权益：		
实收基金	22,617,501.93	219,493,900.09
未分配利润	1,004,255.42	3,062,029.30
所有者权益合计	23,621,757.35	222,555,929.39
负债和所有者权益总计	80,749,569.16	378,477,961.22

注：1. 报告截止日 2018 年 7 月 4 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0444 元，基金份额总额 22,617,501.93 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 7 月 4 日(基金最后运作日)止期间。

3. 本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和《基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于 2018 年 7 月 4 日(基金最后运作日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

五、清算事项说明

自2018年7月4日至2018年7月24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，本次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、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财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 **1,398,776.16** 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司收取并保管，截至本次清算期结束日（2018 年 7 月 24 日）尚未划入托管账户。

(2) 根据中国证券登记结算有限责任公司结算保证金计算规则，本基金最后运作日结算保证金人民币 **29,141.17** 元，截至本次清算期结束日（2018 年 7 月 24 日）尚未划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币 **12,201.77** 元，至本基金最后一笔清算款划出日前一日的银行存款、清算备付金及结算保证金将按规定继续计提利息并归基金份额持有人所有。

(3) 本基金最后运作日应收申购款人民币 **100,239.86** 元，已于 2018 年 7 月 5 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（含应付转出款）为人民币 **56,894,395.71** 元，其中人民币 34,510,429.65 元，已于 2018 年 7 月 5 日支付，人民币 22,383,966.06 元已于 2018 年 7 月 6 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 **2,608.77** 元，已于 2018 年 7 月 24 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 **869.60** 元，已于 2018 年 7 月 24 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 **9,378.27** 元，其中应付银行间交易手续费为人民币 1,998.27 元，已于 2018 年 7 月 11 日支付；应付银行间结算服务费为人民币 7,380.00 元，已于 2018 年 7 月 13 日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税金为人民币 **5,559.46** 元，已于 2018 年 7 月 6 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 215,000.00 元，其中应付审计费为人民币 33,000.00 元，已于 2018 年 7 月 24 日支付；应付银行间账户维护费

12,000.00元,已于2018年7月13日支付人民币9,000.00元,剩余款项将于收到银行间收费通知单后支付;应付信息披露费为人民币150,000.00元,将于收到信息披露机构发票后支付。应付律师费为人民币20,000.00元,将于收到律师事务所发票后支付。

4、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2018年7月4日基金净资产	23,621,757.35
加:清算期间清算净收益	10,391.34
减:清算费用	-
三、2018年7月24日基金净资产	23,632,148.69

资产处置及负债清偿后,于2018年7月24日本基金剩余财产为人民币23,632,148.69元。根据《关于申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,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。

2018年7月5日至本基金最后一笔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,基金管理人申万菱信基金管理有限公司将于最后一次清算款划出日以自有资金垫付该笔款项(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,基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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) 申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金2018年7月4日

资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信安泰添利纯债一年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。

申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2018 年 08 月 24 日