

新华恒稳添利债券型证券投资基金

清算报告

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2019年7月12日

清算报告公告日期：2019年10月17日

一、 基金简介

1、基本情况

新华恒稳添利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系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[2016]1143号文件批准,由新华基金管理股份有限公司作为管理人,于2016年7月25日至8月5日向社会公开募集,首次募集资金总额234,261,487.16元,其中募集资金产生利息13,621.99元,并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2016]01360059号验资报告予以验证。2016年8月9日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华恒稳添利债券型证券投资基金招募说明书》及《新华恒稳添利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数。 本基金从2019年7月8日起进入清算期,基金清算期自2019年7月8日起至2019年7月12日止,并由瑞华会计师事务所(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。

2、清算原因

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》的相关规定及《新华恒稳添利债券型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

截至 2019 年 7 月 2 日，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发本基金合同中约定的基金合同终止条款。根据基金合同有关约定，本基金将依据基金财产清算程序进行财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会审议。

3、清算起始日

根据《新华基金管理股份有限公司关于新华恒稳添利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》，本基金于 2019 年 7 月 8 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2019 年 7 月 8 日。

二、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金报告截止日起，资产负债按清算价格计价，停牌股票的清算价格按报告截止日的公允价值计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：新华恒稳添利债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 7 月 7 日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2019年7月7日
资产：	
银行存款	14,889,966.19
结算备付金	17,604.77
存出保证金	1,114.82
应收利息	45,245.67
应收申购款	
交易性金融资产	4,764,000.00
其中：债券投资	4,764,000.00
买入返售金融资产	
证券清算款	2,326,088.37
资产总计	22,044,019.82
负债：	
应付管理人报酬	1,570.70
应付托管费	392.68
应付销售服务费	392.70
应付交易费用	5,063.17
应付税费	1,278.28
预提费用	70,085.89
应付赎回款	10,713,004.66
应付赎回费	
其他负债	
负债合计：	10,791,788.08
所有者权益：	
实收基金	10,408,039.25
未分配利润	844,192.49
所有者权益合计	11,252,231.74

注：报告截止日2019年7月7日，基金B类份额净值1.064元，基金份额总额20.00份。

基金C类份额净值1.081元，基金份额总额10,408,019.25份。

四、清算情况

1、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2019 年 7 月 8 日起至 2019 年 7 月 12 日止清算期间
一、清算收入	1,934.63
利息收入（注 1）	973.84
投资收益	18,936.95
公允价值变动损益	-17,976.16
清算收入小计	1,934.63
二、清算费用	12,900.13
汇划手续费	418.17
交易费用	12,478.46
税金及附加	3.50
三、清算净收益	-10,965.50

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2019 年 7 月 8 日起至 2019 年 7 月 12 日止清算期间的银行存款、结算备付金及交易保证金的利息及债券的利息。

2、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、2019 年 7 月 7 日基金净资产	11,252,231.74
加：清算期间净收益	-10,965.50
减：应付赎回款和应付赎回费	7,841,335.59
二、2019 年 7 月 12 日基金净资产	3,399,930.65

3、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2019 年 7 月 8 日起进入清算期，截至 2019 年 7 月 12 日，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 724,087.25 元，备付金 17,604.77 元，保证金 1,114.82 元，应收利息 2,444.39 元，债券投资 2,731,000.00 元。管理费、托管费、交易费用、预提费用（信息披露费用、审计费用）等负债 76,320.58 元，基金净资产 3,399,930.65 元。

其中债券投资-银行间短期融资券 2,731,000.00 元,该金额为本基金持有的报告截止日因债券违约而无法变现的债券“18 康得新 SCP001 (011800757)”,18 康得新 SCP001 (011800757) 因截至 2019 年 1 月 15 日终,该发行主体未将足额本息兑付资金划付至银行间市场清算所,构成实质违约,本基金报告截止日(2019 年 7 月 12 日)持有的违约债券明细如下:

债券代码	债券名称	到期日期	原因	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
011800757	18 康得新 SCP001	2019-1-15	债券违约	54.62	50,000	5,000,000.00	2,731,000.00	

截至本次清算期结束日(2019 年 7 月 12 日),本基金所持上述违约债券无法兑付。因此待本基金所持该违约债券主体公司发布确定性公告后,将实际变现金额按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。因上述债券变现金额存在不确定性,因而最终有可能无法按照清盘报告中净值予以清盘,实际清盘净值以所持债券实际变现金额为准。

根据本基金的《基金合同》约定以及《新华基金管理股份有限公司关于新华恒稳添利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。因持有暂时无法变现的证券,本基金将先以已变现基金资产为限进行分配,待全部变现后进行再次分配。考虑到本基金清算的实际情况,在清算期间产生的律师费等清算费用,均由基金管理人承担。

本基金的银行存款应收利息均为预计金额,可能与实际发生或支付金额存在差异,支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

五、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 新华恒稳添利债券型证券投资基金清算审计报告
- (2) 关于《新华恒稳添利债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公住所

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人新华基金管理股份有限公司

客服电话：400-819-8866

新华恒稳添利债券型证券投资基金财产清算小组

2019年7月12日