

申万菱信基金管理有限公司

申万菱信定期开放债券型发起式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：中国工商银行股份有限公司

基金主代码：163112

信息披露日期：2015 年 6 月 26 日

一、重要提示

申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2012 年 12 月 26 日证监许可【2012】1744 号文核准募集，于 2013 年 3 月 29 日成立并正式运作，基金托管人为中国工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》和《申万菱信定期开放债券型发起式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，在开放期的最后一日日终，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，或者基金份额持有人人数少于 200 人，或者前 10 大基金份额持有人持有基金份额总和占基金总份额的比例大于 90%，无须召开基金份额持有人大会，本基金终止或与其他基金合并。

截止本基金开放期最后一日（即 2015 年 5 月 6 日）日终，本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）后的余额为 47,989,457.77 元，已触发基金合同中约定的本基金终止或与其他基金合并的条款。因我司旗下无其他同类基金可与本基金合并，为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金将终止并依法履行基金财产清算程序。基金管理人向深圳证券交易所申请并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2015]184号）同意，本基金于 2015 年 5 月 13 日终止上市交易。

本基金自 2015 年 5 月 8 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、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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2015年5月8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，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：申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金

2、基金简称：申万菱信定期开放债（LOF）（基金场内简称：申万债券）

3、基金主代码：163112

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2013年3月29日

6、2015年5月7日（最后运作日）基金份额总额：42,425,049.83份

7、投资目标：本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为投资者获取高于业绩比较基准的投资收益。

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，在封闭期内原则上遵循组合久期与封闭期适当匹配的原则，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，以获取较高的债券组合投资收益。同时通过适当参与新股申购和增发来获取更高的超额收益。

9、业绩比较基准：在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的一年期金融机构人民币存款基准利率（税后）+0.6%。

10、风险收益特征：本基金为债券型基金，其长期预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金。

11、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

12、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2012]1744号文件予以注册募集，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,610,759,599.65元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第179号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于2013年3月29日正式生效，基金合同生效日的基金

份额总额为1,611,383,742.33份基金份额，其中认购资金利息折合624,142.68份基金份额。经深圳证券交易所深证上[2013]140号文审核同意，本基金份额21,454,994.00份于2013年5月6日上市交易。本基金自2013年3月29日至2015年5月7日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金在开放期的最后一日日终，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，或者基金份额持有人人数少于200人，或者前10大基金份额持有人持有基金份额总和占基金总份额的比例大于90%，无须召开基金份额持有人大会，本基金终止或与其他基金合并。

2014年4月5日至2015年4月6日为本基金第二个封闭运作期，封闭运作期结束后，本基金于2015年4月7日（含该日）至2015年5月6日（含该日）开放申购、赎回及转换业务，截止本基金开放期最后一日（即2015年5月6日）日终，本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）后的余额为47,989,457.77元，已触发基金合同中约定的本基金终止或与其他基金合并的条款。因我司旗下无其他同类基金可与本基金合并，为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金将终止并依法履行基金财产清算程序，本基金自2015年5月8日起进入清算期。基金管理人向深圳证券交易所申请并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2015]184号）同意，本基金于2015年5月13日终止上市交易。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2015年5月7日（最后运作日）

资 产	本期末 2015年5月7日 (基金最后运作日)	上年度末 2014年12月31日
资 产：		

银行存款	49,473,361.79	16,673,635.23
结算备付金	-	148,238.68
存出保证金	12,789.09	9,221.21
交易性金融资产	-	102,346,740.60
其中：债券投资	-	102,346,740.60
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	44,064.68	2,082,566.98
应收申购款	1,079,961.61	-
资产总计	50,610,177.17	121,260,402.70
负债和所有者权益		
负 债：		
应付赎回款	2,205,430.29	-
应付管理人报酬	6,554.70	60,439.70
应付托管费	1,966.42	18,131.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,738.54	15,148.45
应付利润	-	-
其他负债	431,000.00	340,000.00
负债合计	2,654,689.95	433,720.08
所有者权益：		
实收基金	42,425,049.83	106,028,662.86
未分配利润	5,530,437.39	14,798,019.76
所有者权益合计	47,955,487.22	120,826,682.62
负债和所有者权益总计	50,610,177.17	121,260,402.70

注：于基金最后运作日 2015 年 5 月 7 日，基金份额净值 1.130 元，基金份额总额 42,425,049.83 份。

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》“第二十分 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，包括但不限于审计费、律师费、银行汇划费等，根据基金合同，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金的实际情况，从基金份额持有人利益最大化的角度出发，本基金管理人决定承担本基金的清算费用，即清算费用将不从基金财产中支付，而是由基金管理人代为支付。

2、资产处置情况

本基金最后运作日应收申购款（含应收转入款）为人民币 1,079,961.61 元，其中人民币 153,082.52 元已于 2015 年 5 月 8 日划入托管账户，人民币 926,879.09 元已于 2015 年 5 月 11 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 2,205,430.29 元，其中人民币 1,541,433.35 元已于 2015 年 5 月 8 日支付，人民币 663,996.94 元已于 2015 年 5 月 11 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 6,554.70 元，已于 2015 年 5 月 8 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,966.42 元，已于 2015 年 5 月 8 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 9,738.54 元，其中应付券商佣金为人民币 8,508.54 元，已于 2015 年 5 月 8 日支付；应付银行间交易手续费为人民币 630.00 元，已于 2015 年 5 月 14 日支付；应付银行间结算服务费为人民币 600.00 元，已于 2015 年 5 月 15 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 431,000.00 元，其中应付信息披露费为人民币 340,000.00 元，已分别于 2015 年 5 月 14 日及 2015 年 5 月 15 日支付；应付 2014 年度审计费为人民币 60,000.00 元，已于 2015 年 5 月 8 日支付；应付深圳交易所上市年费为人民币 25,000.00 元，已于 2015 年 5 月 8 日支付；应付债券账户维护费为人民币 6,000.00 元，已于 2015 年 5 月 15 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

项目	自2015年05月08日至2015年6月26日止 (清算期间)
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	47,962.54
清算收入小计	47,962.54
二、清算费用	
1、银行汇划费(注2)	81.00
清算费用小计	81.00
三、清算净收益	47,881.54

注:

1) 利息收入系计提的自2015年5月8日起至2015年6月26日止清算期间的银行存款利息及存出保证金利息。

2) 银行汇划费系清算期间清偿负债时产生的银行划款手续费。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,本基金的清算费用将由基金管理人承担。

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2015年5月7日基金净资产	47,955,487.22
加:清算期间清算净收益	47,881.54
二、2015年06月26日基金净资产	48,003,368.76
加:清算期间汇划费用(管理人承担)	81.00
三、2015年6月26日基金可供分配的剩余资产	48,003,449.76

本基金最后运作日存出保证金共计人民币12,789.09元,已于2015年6月2日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

本基金将于2015年6月30日进行剩余财产的划付,2015年5月8日至2015年6月26日的银行存款及存出保证金所产生的利息属份额持有人所有,截止

2015年6月26日的应收利息共计人民币5,759.70元；自合同终止日后至剩余财产划付日前一自然日（2015年6月27日至2015年6月29日）本基金财产孳生利息共计2,879.85元。由管理人承担的清算期间汇划费用81.00元由基金管理人以自有资金支付并于2015年6月26日划入托管账户。

资产处置及负债清偿后，于2015年6月26日本基金剩余财产为人民币48,003,449.76元，加上合同终止日后至剩余财产划付日前一自然日孳生利息及由管理人承担的清算期间汇划费用，本基金于2015年6月30日划付的财产总额共计人民币48,006,329.61元。根据本基金的基金合同约定，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

本清算报告经备案并公告后，基金财产剩余财产将由基金托管账户划出，向基金份额持有人按其所持份额比例进行分配。

基金管理人所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。

本基金的银行存款应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由管理人承担。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人负有义务于收到资产托管人通知后当日内将款项补足。

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) 申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金2015年5月7日资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信定期开放债券型发起式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。

申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2015年6月26日