

# 申万菱信基金管理有限公司

## 申万菱信添益宝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：中国工商银行股份有限公司

基金主代码：310378

信息披露日期：2018年08月24日

### 一、重要提示

申万菱信添益宝债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2008年9月5日证监许可【2008】1104号文核准募集，于2008年12月4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》、《申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《基金合同》应当终止。申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于2018年5月14日发布《申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议终止本基金基金合同有关事项，本次基金份额持有人大会于2018年6月27日表决通过了《关于终止申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效，本基金管理人于2018年6月28日发布《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称决议生效公告）。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2018年6月28日，自2018年6月29日起，本基金进入基金财产清算程序。

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2018年6月29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：申万菱信添益宝债券型证券投资基金

2、基金简称：申万菱信添益宝债券

3、基金主代码：310378

A类基金份额基金代码：310378

B类基金份额基金代码：310379

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2008年12月4日

6、2018年6月28日（最后运作日）基金份额总额：14,207,776.26份

7、投资目标：在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收入和总回报。

8、投资策略：在大类资产的配置上，本基金主要根据宏观经济与市场运行趋势的综合分析，决定在转债、债券、新股/转债申购和现金资产上的资金分配。本基金的债券投资研究依托公司整体的债券研究平台，通过自上而下的宏观基本面和资金技术面分析，确定一个阶段对债券市场整体的把握，并确定投资组合的期限和策略。本基金主要利用信用分析对信用产品进行投资选择，信用分析包括信用评级体系和信用环境分析。在一级市场申购策略方面，本基金通过研究首次发行股票、增发新股及发行转债公司的基本面，估计上市后的合理价格，判断是否参与新股及转债的一级市场申购。

9、业绩比较基准：中债总指数（全价）。

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低于股票型基金、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：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2008年9月5日证监许可【2008】1104号文核准募集，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,378,649,628.99元，业经普华永道中天验字(2008)第189号验资确认。经向中国证监会备案，基金合同于

2008年12月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,379,022,309.66份基金份额，其中认购资金利息折合372,680.67份基金份额。自2008年12月4日至2018年6月28日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》约定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《基金合同》应当终止。本基金管理人于2018年5月14日发布《申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议终止本基金基金合同有关事项，本次基金份额持有人大会于2018年6月27日表决通过了《关于终止申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效，本基金管理人于2018年6月28日发布决议生效公告。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2018年6月28日，自2018年6月29日起，本基金进入基金财产清算程序。

#### 四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信添益宝债券型证券投资基金

报告截止日：2018年6月28日（基金最后运作日）

资产	本期末 2018年6月28日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	283,750.89	1,347,410.76
结算备付金	47,916.55	40,010.96
存出保证金	2,221.86	8,090.65
交易性金融资产	12,001,600.00	26,615,800.00
其中：债券投资	12,001,600.00	26,615,800.00
应收证券清算款	2,021,396.32	-
应收利息	358,869.58	653,107.97
应收申购款	-	400.00
<b>资产总计</b>	<b>14,715,755.20</b>	<b>28,664,820.34</b>
<b>负债和所有者权益</b>		
<b>负债：</b>		
应付赎回款	6,289.29	31,172.44
应付管理人报酬	7,120.07	14,478.76
应付托管费	2,373.38	4,826.24
应付销售服务费	2,494.17	2,973.46
应付交易费用	375.00	1,000.00

其他负债	129,926.34	311,921.74
<b>负债合计</b>	<b>148,578.25</b>	<b>366,372.64</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	14,207,776.26	26,856,609.94
未分配利润	359,400.69	1,441,837.76
<b>所有者权益合计</b>	<b>14,567,176.95</b>	<b>28,298,447.70</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>14,715,755.20</b>	<b>28,664,820.34</b>

注：1. 报告截止日 2018 年 6 月 28 日(基金最后运作日)，A 类基金份额净值 1.027 元，B 类基金份额净值 1.024 元；基金份额总额 14,207,776.26 份，其中 A 类基金份额 5,739,282.29 份，B 类基金份额 8,468,493.97 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 28 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 6 月 28 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 6 月 29 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》“第十八部分 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 47,916.55 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，已于 2018 年 7 月 3 日划入托管账户。

(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 2,221.86 元，已于 2018 年 7 月 3 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产估值金额人民币 12,001,600.00 元,全部为即将到期兑付债券,具体情况如下:

债券代码	股票名称	数量(张)	最后运作日估值 价格(人民币元)	最后运作日估值 金额(人民币元)
018005	国开 1701	20,000.00	100.18	2,003,600.00
170207	17 国开 07	100,000.00	99.98	9,998,000.00

其中,国开 1701 于 2018 年 6 月 29 日通过场内竞价交易完成变现,17 国开 07 于 2018 年 7 月 11 日通过兑付完成变现。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 358,869.58 元,其中应收国开 1701 利息人民币 17,398.36 元,随 2018 年 6 月 29 日完成变现后,于 2018 年 7 月 2 日划入托管账户;应收 17 国开 07 利息人民币 341,394.52 元,于 2018 年 7 月 11 日完成兑付后,划入托管账户;剩余为应收银行存款利息人民币 76.70 元,以及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。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 2,021,396.32 元,已于 2018 年 6 月 29 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 6,289.29 元,其中人民币 2,291.37 元已于 2018 年 6 月 29 日支付,人民币 3,997.92 元已于 2018 年 7 月 2 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 7,120.07 元,已于 2018 年 7 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,373.38 元,已于 2018 年 7 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,494.17 元,已于 2018 年 7 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 375.00 元,其中应付银行间交易手续费为人民币 75.00 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 300.00 元,已于 2018 年 7 月 13 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 129,926.34 元，应付赎回费 6.82 元，其中人民币 2.32 元已于 2018 年 6 月 29 日支付，人民币 4.50 元已于 2018 年 7 月 2 日支付；其他应付款 1,919.52 元，已于 2018 年 7 月 24 日转入基金财产；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；应付信息披露费为人民币 45,000.00 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 50,000.00 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6月28日基金净资产	14,567,176.95
加：清算期间清算净收益	28,762.09
减：清算费用	-
二、2018年7月24日基金净资产	14,595,939.04
其中归属于A类份额持有人的基金资产净值	5,922,965.73
其中归属于C类份额持有人的基金资产净值	8,672,973.31

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 14,595,939.04元，根据决议生效公告，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6月29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) 申万菱信添益宝债券型证券投资基金2018年6月28日资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信添益宝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。

申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金财产清算小组

2018年8月24日