

申万菱信价值优利混合型证券投资基金

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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年12月21日

清算报告公告日：2023年2月9日

一、重要提示

申万菱信价值优利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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【2017】848号文注册募集，于2017年9月21日成立并正式运作，本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

依据《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》等法律法规的规定以及《申万菱信价值优利混合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，连续20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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议。”

截至2022年11月17日日终，本基金已经出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，已触发基金合同中约定的上述基金合同终止条款。本基金于2022年11月18日进入基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2022年11月18日发布的在本基金管理人网站（www.swsmu.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn>）的《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金清算期为 2022 年 11 月 18 日至 2022 年 12 月 21 日，由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（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、基金基本情况

| | | |
|-------------------------------|-------------------|------------|
| 基金名称 | 申万菱信价值优利混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 申万菱信价值优利混合 | |
| 基金主代码 | 004951 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 9 月 21 日 | |
| 基金管理人 | 申万菱信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属基金类别的基金简称 | 价值优利 A | 价值优利 C |
| 下属基金类别的交易代码 | 004951 | 014584 |
| 最后运作日（2022 年 11 月 17 日）基金份额总额 | 450,459.68 份 | 9,917.62 份 |

| | | |
|--------------------------|--------------|-------------|
| 最后运作日(2022年11月17日)基金资产净值 | 599,243.62 元 | 13,119.72 元 |
|--------------------------|--------------|-------------|

2、基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资，充分发挥数量化投资的优势，保持投资策略的一致性与有效性。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 |

三、基金运作情况概述

申万菱信价值优利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证监会证监许可【2017】848 号文《关于准予申万菱信价值优利混合型证券投资

资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人申万菱信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 9 月 21 日正式生效，首次设立募集规模(含利息结转份额)为 225,886,769.96 份基金份额，有效认购户数为 613 户。

根据《申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同》以及《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自 2022 年 11 月 18 日起，本基金进入清算程序，不再办理申购、赎回、转换及定期定额投资等业务。

四、 财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信价值优利混合型证券投资基金

报告截止日：2022年11月17日(最后运作日)

| 资产 | 本期末 2022 年 11 月 17 日 (最后运作日) |
|------------|------------------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 421,700.35 |
| 结算备付金 | 1,104.22 |
| 存出保证金 | 30,397.39 |
| 交易性金融资产 | 418,941.24 |
| 其中：股票投资 | 418,941.24 |

| | |
|-----------------|-------------------|
| 资产总计 | 872,143.20 |
| 负债和净资产 | |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 139,074.59 |
| 应付管理人报酬 | 416.31 |
| 应付托管费 | 34.68 |
| 应付销售服务费 | 3.36 |
| 应付证券清算款 | 79.39 |
| 其他负债 | 120,171.53 |
| 负债合计 | 259,779.86 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 460,377.30 |
| 未分配利润 | 151,986.04 |
| 净资产合计 | 612,363.34 |
| 负债和净资产总计 | 872,143.20 |

注：1、报告截止日 2022 年 11 月 17 日(最后运作日)，A 类基金资产净值 599,243.62 元，C 类基金资产净值 13,119.72 元；基金份额总额 460,377.30 份，其中 A 类基金份额 450,459.68 份，C 类基金份额 9,917.62 份。

五、 清算情况

自2022年11月17日至2022年12月21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《申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同》“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财产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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币1,104.22元(含应计利息，下同)。其中交易所最低备付金为人民币4.22元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金及应计利息，该款项预计将于2022年12月21日划入托管账户。期货清算备付金及其应计利息总和为人民币1,100.00元，已于2022年11月24日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币30,397.39元(含应计利息，下同)，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金及应计利息，该款项已于2022年12月2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418,941.24元(含应计利息，下同)，全部为股票投资。已最晚于2022年11月22日全部变现，相关证券清算款已最晚于2022年11月23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139,074.59元，已于2022年11月22日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币416.31元，已于2022年

12月2日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 34.68 元，已于 2022 年 12 月 2 日支付。

(4)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3.36 元，已于 2022 年 12 月 2 日支付。

(5)本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 79.39 元，已于 2022 年 11 月 24 日支付。

(6)本基金最后运作日其他负债为人民币 120,171.53 元，其中应付券商佣金 84.67 元，已于 2022 年 11 月 25 日支付；其中应付审计费 47,084.53 元，已于 2022 年 12 月 15 日支付；其中应付信息披露费 53,000.00 元，已于 2022 年 12 月 16 日支付；其中律师费 20,000.00 元，已于 2022 年 12 月 8 日支付。

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2022年11月17日基金净资产 | 612,363.34 |
| 加：清算期间清算净损益 | -7,718.63 |
| 三、2022年12月21日基金净资产 | 604,644.71 |

资产处置及负债清偿后，于2022年12月21日本基金剩余财产为人民币 604,644.71元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信价值优利混合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,根据基金合同终止日基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2022年12月21日至本基金最后一笔清算款划出日前一日的银行存款、存出保证金、结算备付金及前述资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笔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。

5、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) 申万菱信价值优利混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 关于《申万菱信价值优利混合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。

申万菱信价值优利混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2023年2月9日