

申万菱信价值臻选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：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年3月15日

清算报告公告日：2024年4月30日

一、重要提示

申万菱信价值臻选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【2022】2178号文注册募集，于2023年5月30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”），基金托管人为平安银行股份有限公司（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《申万菱信价值臻选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，本基金的基金合同生效后，连续50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，本基金将终止《基金合同》并进入清算程序，而无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

截至2024年1月31日日终，本基金已经出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金根据约定终止《基金合同》，并于2024年2月1日进入基金财产的清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2024年2月1日发布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臻选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 2024 年 2 月 1 日至 2024 年 3 月 15 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	申万菱信价值臻选混合型证券投资基金	
基金简称	申万菱信价值臻选混合	
基金主代码	017065	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 5 月 30 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属基金类别的基金简称	价值臻选 A	价值臻选 C
下属基金类别的交易代码	017065	017066
最后运作日(2024 年 1 月 31 日) 基金份额总额	734,627.00 份	3,970,948.02 份
最后运作日(2024 年 1 月 31 日) 基金份额净值	0.8533 元	0.8509 元

2、基金产品说明

投资目标	本基金结合宏观经济周期、中观产业景气度、上市公司基本面和市场流动性的趋势，判断并把握投资机会，在控制投资组合风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金综合宏观、中观、微观三个角度布局投资机会，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。根据经济周期的阶段，进行大类资产配置；根据产业景气趋势的比较，选择重点配置的行业；根据上市公司基本面、财务和估值指标，筛选具备性价比的优质标的；根据市场流动性的状态，适当调整持股的风格。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如投资于港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、 基金运作情况概述

申万菱信价值臻选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【2022】2178号文《关于准予申万菱信价值臻选混合型证券投资基金注册的批复》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2023年5月30日正式生效，首次设立募集规模（含利息结转份额）为202,587,718.65份基金份额，有效认购户数为408户。

根据《申万菱信价值臻选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臻选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2024年2月1日起本基金进入清算程序，不再办理本基金的申购、定投、转换、赎回等业务。

四、 财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信价值臻选混合型证券投资基金

报告截止日：2024年01月31日(最后运作日)

资产	本期末 2024年01月31日 (最后运作日)
资产：	
货币资金	5,182,405.48

交易性金融资产	2,794,402.00
资产总计	7,976,807.48
负债和净资产	
负债：	
应付赎回款	3,868,675.31
应付管理人报酬	19,835.10
应付托管费	3,305.86
应付销售服务费	5,053.73
其他负债	74,000.00
负债合计	3,970,870.00
净资产：	
实收基金	4,705,575.02
未分配利润	-699,637.54
净资产合计	4,005,937.48
负债和净资产总计	7,976,807.48

注：1、报告截止日 2024 年 01 月 31 日(最后运作日)，A 类基金份额净值 0.8533 元，C 类基金份额净值 0.8509 元；基金份额总额 4,705,575.02 份，其中 A 类基金份额 734,627.00 份，C 类基金份额 3,970,948.02 份。

2、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 2024 年 01 月 31 日(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、 清算情况

自2024年02月01日至2024年03月15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《申万菱信价值臻选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

本基金最后运作日交易性金融资产估值金额人民币 2,794,402.00 元，其中股票投资为 2,794,402.00 元，已最晚于 2024 年 2 月 1 日全部变现，相关证券清算款已最晚于 2024 年 2 月 2 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 3,868,675.31 元，已于 2024 年 2 月 5 日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 19,835.10 元，已于 2024 年 2 月 2 日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,305.86 元，已于 2024 年 2 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 5,053.73 元，已于 2024 年 2 月 2 日支付。

(5)本基金最后运作日其他负债为人民币 74,000.00 元，其中应付清盘审计费为人民币 15,000.00 元，已于 2024 年 3 月 4 日支付；其中应付 2023 年度审计费为人民币 44,000.00 元，已于 2024 年 3 月 11 日支付；应付律师费为人民币 15,000.00 元，已于 2024 年 3 月 4 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2024年1月31日基金净资产	4,005,937.48
减：2024年1月31日确认的净赎回	1,449,091.69
加：清算期间清算净收益	35,150.51
三、2024年3月15日基金净资产	2,591,996.30

资产处置及负债清偿后，于2024年3月15日本基金剩余财产为人民币 2,591,996.30元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信价值臻选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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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) 申万菱信价值臻选混合型证券投资基金资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信价值臻选混合型证券投资基金》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。

申万菱信价值臻选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年4月30日