

申万菱信兴利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：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年4月1日

清算报告公告日：2024年5月16日

一、重要提示

申万菱信兴利债券型证券投资基金(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【2021】3666号文注册募集,于2022年6月1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”),基金托管人为浙商银行股份有限公司(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《申万菱信兴利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,本基金基金份额持有人大会已于2023年12月28日表决通过《关于终止申万菱信兴利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》(以下简称“《议案》”),并于2023年12月29日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>)发布《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信兴利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》。

本基金清算期为2023年12月30日至2024年4月1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	申万菱信兴利债券型证券投资基金	
基金简称	申万菱信兴利债券	
基金主代码	015431	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年6月1日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属基金类别的基金简称	兴利债券 A	兴利债券 C
下属基金类别的交易代码	015431	015432
最后运作日(2023年12月29日)基金份额总额	65,348.61 份	12,318.20 份
最后运作日(2023年12月29日)基金份额净值	1.0495 元	1.0464 元

2、基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,努力追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的
------	--

	投资回报。
投资策略	本基金通过资产配置策略、债券投资策略（利率预期策略、收益率曲线策略、信用债投资策略）、可转换债券与可交换债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略，努力追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中国债券总指数(全价)收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。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

申万菱信兴利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证监会许可【2021】3666号文准予注册，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2022年6月1日正式生效，首次设立募集规模（含利息结转份额）为202,086,962.19份基金份额，有效认购户数为330户。

根据《申万菱信兴利债券型证券投资基金基金合同》、本次基金基金份额持有人大会表决通过的《议案》以及《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信兴利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》，本基金自 2023 年 12 月 29 日起不再接受赎回、转换转出申请，申购、转换转入、定期定额投资业务亦不再恢复。自 2023 年 12 月 30 日起，本基金进入清算程序，不再收取基金管理费、基金托管费及销售服务费。

四、 财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信兴利债券型证券投资基金

报告截止日：2023年12月29日(最后运作日)

资产	本期末 2023 年 12 月 29 日 (最后运作日)
资产：	
银行存款	100,437.90
结算备付金	36,375.20
存出保证金	9,052.95
交易性金融资产	
资产总计	145,866.05
负债和净资产	
负债：	

应付赎回款	31.00
应付管理人报酬	516.32
应付托管费	103.28
应付销售服务费	12.57
应交税费	1.10
其他负债	63,731.00
负债合计	64,395.27
净资产：	
实收基金	77,666.81
未分配利润	3,803.97
净资产合计	81,470.78
负债和净资产总计	145,866.05

注：1、报告截止日2023年12月29日（最后运作日），申万菱信兴利债券A类份额净值1.0495元，基金份额总额65,348.61份，申万菱信兴利债券C类份额净值1.0464元，基金份额总额12,318.20份，总份额合计77,666.81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相关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于2023年12月29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2023年12月30日至2024年4月1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《申万菱信兴利债券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

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 36,375.20 元 (含应计利息，下同)。其中交易所最低备付金为人民币 36,373.58 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，其中 28,984.67 元已于 2024 年 1 月 9 日划入托管账户，7,374.15 元已于 2024 年 2 月 8 日划入托管户。期货清算备付金为人民币 1.62 元，已于 2024 年 1 月 18 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 9,052.95 元 (含应计利息，下同)，其中交易所保证金为人民币 9,052.95 元，截至 2024 年 4 月 1 日，存出保证金为人民币 3,212.42 元，其中交易所保证金为人民币 3,212.42 元，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。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 31.00 元 ,已最晚于 2024 年 1 月 3 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 516.32 元 ,已最晚于 2024 年 1 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 103.28 元 ,已最晚于 2024 年 1 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 12.57 元 ,已最晚于 2024 年 1 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付税费为人民币 1.10 元 ,已最晚于 2024 年 1 月 8 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 63,731.00 元 ,其中应付审计费 25,000.00 元 ,已于 2024 年 3 月 12 日支付 ;应付律师费 25,000.00 元 ,已于 2024 年 1 月 30 日支付 ;其中应付公证费 10,000.00 元 ,已于 2024 年 1 月 19 日支付 ;其中应付佣金为人民币 3,731.00 元 ,已最晚于 2024 年 4 月 1 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2023年12月29日基金净资产	81,470.78
加：清算期间清算净损益	102.54
三、2024年4月1日基金净资产	81,573.32

资产处置及负债清偿后，于2024年4月1日本基金剩余财产为人民币 81,573.32元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信兴利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》，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。

2024年4月1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) 申万菱信兴利债券型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 关于《申万菱信兴利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。

申万菱信兴利债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2024年5月16日