

申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债 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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年11月27日

清算报告公告日：2024年12月30日

一、重要提示

申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2019】2346号文注册募集,于2020年3月18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《申万菱信安泰鑫利纯债一年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,本基金在基金合同生效3年后继续存续的,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50个工作日出现前述情形的,基金合同应当终止,无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

截至2024年8月26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8月27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8月27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安泰鑫

利纯债一年定期开放债券型发起式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 8 月 27 日至 2024 年 11 月 27 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	申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券
基金主代码	009084
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 18 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
最后运作日(2024 年 8 月 26 日)基金份额总额	9,999,847.99 份
最后运作日(2024 年 8 月	1.0647 元

26日)基金份额净值	
------------	--

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，以期获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
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。

三、基金运作情况概述

申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证监会证监许可【2019】2346号文《关于准予申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式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

2020年3月18日正式生效，首次设立募集规模（含利息结转份额）为9,999,350.00份基金份额，有效认购户数为1户。

根据《申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式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安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式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8月27日起本基金进入清算程序，不再办理本基金的申购、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：申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年8月26日(最后运作日)

资产	本期末 2024年8月26日 (最后运作日)
资产：	
货币资金	118,645.39
结算备付金	1,021,829.67
存出保证金	17,217.02
交易性金融资产	9,594,412.60
其中：债券投资	9,594,412.60
资产总计	10,752,104.68
负债和净资产	

负债：	
应付管理人报酬	2,270.13
应付托管费	756.71
其他负债	102,649.79
负债合计	105,676.63
净资产：	
实收基金	9,999,847.99
未分配利润	646,580.06
净资产合计	10,646,428.05
负债和净资产总计	10,752,104.68

注：1、报告截止日 2024 年 8 月 26 日(最后运作日)，基金份额净值 1.0647 元，基金份额总额 9,999,847.99 份。

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。

五、 清算情况

自2024年8月27日至2024年11月27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《申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金

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1,021,829.67元(含应计利息)。其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的交易所最低备付金本金为人民币75,495.26元，该款项于2024年9月9日调整为3,708.95元，已于2024年10月15日划入托管账户；期货保证金为人民币940,823.41元，该款项已分别于2024年8月29日及2024年9月3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17,217.02元(含应计利息)。存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金本金为人民币17,163.30元，该款项已于2024年9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9,594,412.60元(含应计利息)，其中债券投资为9,594,412.60元，已于2024年8月29日全部变现，相关证券清算款已于2024年8月30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管理人报酬为人民币2,270.13元，已最晚于2024年9月3日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币756.71元，已最晚于2024年9月3日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币102,649.79元：应付信息披露费为人民币50,000.00元，已于2024年11月25日支付；应付律师费为人民币

20,000.00 元，已于 2024 年 11 月 14 日支付；应付审计费为人民币 32,649.79 元，已最晚于 2024 年 9 月 20 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8月26日基金净资产	10,646,428.05
加：期间确认的净申购	
减：期间确认的净赎回	
加：清算期间清算净收益	20,250.29
三、清算结束日2024年11月27日基金净资产	10,666,678.34

资产处置及负债清偿后，于2024年11月27日本基金剩余财产为人民币 10,666,678.34元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式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11月27日至本基金最后一笔清算款划出日前一日的货币资金、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) 申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信安泰鑫利纯债一年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。

申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2024年12月30日