

# 申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券

## 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：华夏银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年9月15日

清算报告公告日：2023年10月18日

## 一、重要提示

申万菱信安鑫回报灵活配置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【2015】477号文注册募集，于2015年4月28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”），基金托管人为华夏银行股份有限公司（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《申万菱信安鑫回报灵活配置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，如出现下述情况之一的，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：

- 1、连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人；
- 2、连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。

截至 2023 年 7 月 26 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。本基金根据约定终止《基金合同》，并于 2023 年 7 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 2023 年 7 月 27 日发布在本基金管理人网站（[www.swsmu.com](http://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鑫回报灵活配置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 2023 年 7 月 27 日至 2023 年 9 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	申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	申万菱信安鑫回报灵活配置混合	
基金主代码	001201	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属基金类别的基金简称	安鑫回报 A	安鑫回报 C
下属基金类别的交易代	001201	001727

码		
最后运作日（2023年7月26日）基金份额总额	2,477,063.92 份	5,174,764.85 份
最后运作日（2023年7月26日）基金份额净值	1.386 元	1.374 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，通过积极主动的资产配置，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策）、流动性水平（包括资金面供求情况、证券市场估值水平）的深入研究分析以及市场情绪的合理判断，紧密追踪股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整，谋求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率 + 50%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，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，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
--	--

### 三、 基金运作情况概述

申万菱信安鑫回报灵活配置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【2015】477号文《关于准予申万菱信安鑫回报灵活配置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2015年4月28日正式生效，首次设立募集规模（含利息结转份额）为2,308,235,317.02份基金份额，有效认购户数为427户。

根据《申万菱信安鑫回报灵活配置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安鑫回报灵活配置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2023年7月27日起本基金进入清算程序，不再办理赎回、转换转出等业务，本基金的申购、定投及转换转入业务亦不再恢复。

### 四、 财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年7月26日(最后运作日)

<b>资产</b>	<b>本期末 2023年7月26日 (最后运作日)</b>
<b>资产：</b>	
银行存款	70,929.75
结算备付金	313,119.29
存出保证金	29,157.55
交易性金融资产	11,468,988.09
其中：股票投资	2,254,490.14
债券投资	9,214,497.95
买入返售金融资产	2,500,000.00
应收清算款	65,426.66
<b>资产总计</b>	<b>14,447,621.34</b>
<b>负债和净资产</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	3,811,699.68
应付管理人报酬	7,249.17
应付托管费	1208.17
应付销售服务费	529.77
应交税费	2.46
其他负债	84,127.56
<b>负债合计</b>	<b>3,904,816.81</b>

<b>净资产：</b>	
实收基金	7,651,828.77
未分配利润	2,890,975.76
<b>净资产合计</b>	<b>10,542,804.53</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>14,447,621.34</b>

注：1、报告截止日 2023 年 7 月 26 日(最后运作日)，A 类基金份额净值 1.386 元，C 类基金份额净值 1.374 元；基金份额总额 7,651,828.77 份，其中 A 类基金份额 2,477,063.92 份，C 类基金份额 5,174,764.85 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 2023 年 7 月 26 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7月27日至2023年9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《申万菱信安鑫回报灵活配置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313,119.29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312,705.68元,该款项于2023年9月8日划入托管账户。应计交易所最低备付金利息413.61元,预计将于2023年9月21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29,157.55元(含应计利息)。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,该款项于2023年8月2日调整为25,040.81元,2023年9月4日调整为12,090.84元,预计将于2023年9月21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11,468,988.09元(含应计利息,下同),其中股票投资为2,254,490.14元,已最晚于2023年8月16日全部变现,相关证券清算款已最晚于2023年8月17日划入托管账户;债券投资为9,214,497.95元,已于2023年8月23日全部变现,相关证券清算款已于2023年8月24日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日买入返售金融资产估值金额人民币2,500,000.00元,已最晚于2023年7月27日全部到期,相关证券清算款已于2023年7月28日划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款金额为65,426.66元,最晚已于2023年8月24日全部划入托管账户。

## 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3,811,699.68



元，已最晚于 2023 年 7 月 31 日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 7,249.17 元，已最晚于 2023 年 8 月 2 日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,208.17 元，已最晚于 2023 年 8 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 529.77 元，已最晚于 2023 年 8 月 2 日支付。

(5)本基金最后运作日应交税费为人民币 2.46 元，已最晚于 2023 年 8 月 7 日支付。

(6)本基金最后运作日其他负债为人民币 84,127.56 元；应付交易费用为人民币 427.56 元，为应付券商佣金，已于 2023 年 9 月 5 日支付；应付信息披露费为人民币 33,400.00 元，已于 2023 年 9 月 15 日支付；应付银行间账户维护费为人民币 6,200.00 元，已于 2023 年 8 月 18 日支付；应付律师费为人民币 15,000.00 元，已于 2023 年 9 月 6 日支付；应付审计费为人民币 29,100.00 元，已于 2023 年 9 月 5 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7月26日基金净资产	10,542,804.53
加：期间确认的净申购	0
减：期间确认的净赎回	7,500,838.69
加：清算期间清算净收益	-2,456.50

三、2023年9月15日基金净资产	3,039,509.34
-------------------	--------------

资产处置及负债清偿后，于2023年9月15日本基金剩余财产为人民币3,039,509.34元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信安鑫回报灵活配置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。

2023年9月15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) 申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 关于《申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金证券投资基金清

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。

申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2023年10月18日