

# 申万菱信乐研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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年2月13日

清算报告公告日：2025年3月24日

## 一、重要提示

申万菱信乐研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【2023】1757号文注册募集，于2024年4月25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”），基金托管人为中国工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《申万菱信乐研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，本基金将进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

截至2024年12月17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12月18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12月18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乐研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 12 月 18 日至 2025 年 02 月 13 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	申万菱信乐研混合型证券投资基金	
基金简称	申万菱信乐研混合	
基金主代码	019326	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 4 月 25 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属基金类别的基金简称	乐研混合 A	乐研混合 C
下属基金类别的交易代码	019326	019327
最后运作日（2024 年 12 月 17 日）基金份额总额	3,661,540.24 份	3,653,784.16 份
最后运作日（2024 年 12 月 17 日）基金份额净值	1.0345 元	1.0317 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	$65\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率 (经汇率调整后)} + 25\% \times \text{中证全债指数收益率}$
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

申万菱信乐研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【2023】1757号文《关于准予申万菱信乐研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2024年4月25日正式生效，首次设立募集规模（含利息结转份额）为236,735,105.09份基金份额，有效认购户数为928户。

根据《申万菱信乐研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乐研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12月18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：申万菱信乐研混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月17日(最后运作日)

资产	本期末 2024年12月17日 (最后运作日)
<b>资产：</b>	
货币资金	3,077,237.20
结算备付金	117,237.28
存出保证金	35,211.87
交易性金融资产	6,130,350.99

其中：股票投资	6,130,350.99
<b>资产总计</b>	<b>9,360,037.34</b>
<b>负债和净资产</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	1,587,090.92
应付管理人报酬	9,418.97
应付托管费	1,569.82
应付销售服务费	1,321.40
其他负债	203,511.88
<b>负债合计</b>	<b>1,802,912.99</b>
<b>净资产：</b>	
实收基金	7,315,324.40
未分配利润	241,799.95
<b>净资产合计</b>	<b>7,557,124.35</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>9,360,037.34</b>

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 17 日(最后运作日)，A 类基金份额净值 1.0345 元，C 类基金份额净值 1.0317 元；基金份额总额 7,315,324.40 份，其中 A 类基金份额 3,661,540.24 份，C 类基金份额 3,653,784.16 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12月18日至2025年2月13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《申万菱信乐研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

(1)本基金最后运作日结算备付金为人民币117,237.28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116,579.59元，该款项于2025年1月9日调整为8,868.17元，已于2025年2月12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35,211.87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35,121.17元，该款项已于2025年1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6,130,350.99元，其中股票投资为6,130,350.99元，已于2024年12月26日全部变现，相关证券清算款已于2024年12月27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为人民币1,587,090.92元，已最晚于2024

年12月20日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币9,418.97元,已最晚于2025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1,569.82元,已最晚于2025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1,321.40元,已最晚于2025年1月3日支付。

(5)本基金最后运作日其他负债为人民币203,511.88元:应付交易费用为人民币46,580.44元,已最晚于2025年1月16日支付;应付信息披露为人民币90,000.00元,已最晚于2025年2月10日支付;应付律师费为人民币15,000.00元,已最晚于2025年2月6日支付;应付审计费为人民币51,931.44元,已最晚于2025年2月7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12月17日基金净资产	7,557,124.35
加: 期间确认的净申购	
减: 期间确认的净赎回	61,659.32
加: 清算期间清算净收益	50,248.21
三、清算结束日2025年2月13日基金净资产	7,545,713.24



资产处置及负债清偿后，于2025年02月13日本基金剩余财产为人民币7,545,713.24元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信乐研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。

2025年2月13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) 申万菱信乐研混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 关于《申万菱信乐研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。

申万菱信乐研混合型证券投资基金基金财产清算小组

2025年3月24日