

申万菱信价值优先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：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年5月25日

清算报告公告日：2023年8月2日

一、重要提示

申万菱信价值优先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【2017】737号文注册募集，于2017年12月14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”），基金托管人为中国农业银行股份有限公司（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《申万菱信价值优先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，“基金合同生效后，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60个工作日出现前述情形的，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。”

截至2023年3月16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，已触发基金合同中约定的上述基金合同终止条款。本基金于2023年3月17日进入基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2023年3月17日发布的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优先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3月17日至2023年5月25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	申万菱信价值优先混合型证券投资基金
基金简称	申万菱信价值优先混合
基金主代码	004769
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月14日
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
最后运作日（2023年3月16日） 基金份额总额	6,552,167.88
最后运作日（2023年3月16日） 基金资产净值	9,011,257.20

2、基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资，充分发挥数量化投资的优势，保持投资策略的一致性与有效性。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是混合型基金，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。

三、 基金运作情况概述

申万菱信价值优先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【2017】737号文《关于准予申万菱信价值优先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人募集，基金合同于2017年12月14日正式生效，首次设立募集规模（含利息结转份额）为362,984,274.46份基金份额，有效认购户数为7169户。

根据《申万菱信价值优先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优先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3月17日起，本基金进入清算程序，不再办理申购、赎回、转换及定期定额投资等业务。

四、 财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信价值优先混合型证券投资基金

报告截止日：2023年3月16日（最后运作日）

资产	本期末 2023年3月16日 (最后运作日)
资产：	
银行存款	1,280,378.41
结算备付金	146.80
存出保证金	25,928.05
交易性金融资产	8,296,262.87
其中：股票投资	8,296,262.87
应收申购款	2,229.37

资产总计	9,604,945.50
负债和净资产	
负债：	
应付清算款	124.10
应付赎回款	444,664.72
应付管理人报酬	6,823.25
应付托管费	568.62
其他负债	141,507.61
负债合计	593,688.30
净资产：	
实收基金	6,552,167.88
未分配利润	2,459,089.32
净资产合计	9,011,257.20
负债和净资产总计	9,604,945.50

注：1、报告截止日 2023 年 3 月 16 日(最后运作日)，基金份额净值 1.3753 元；基金份额总额 6,552,167.88 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 3 月 16 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3月17日至2023年5月25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《申万菱信价值优先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财产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146.80元(含应计利息，下同)。其中交易所最低备付金为人民币146.80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，该款项于2023年3月21日调整为78.40元，于2023年3月22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25,928.05元(含应计利息，下同)，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4月4日调整为21,532.89元，2023年5月2日调整为21,560.05元，2023年6月2日调整为71.23元，预计将于2023年6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8,296,262.87元(含应计利息，下同)，其中股票投资为8,296,262.87元，已最晚于2023年3月23日全部变现，相关证券清算款已最晚于2023年3月24日划入托管账户。

(4)本基金最后运作日应收申购款人民币2,229.37元，已最晚于2023年3月20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444,664.72元，已最晚于2023年3月21日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币6,823.25元，已最晚于2023

年4月4日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币568.62元，已最晚于2023年4月4日支付。

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币141,507.61元，其中应付赎回费为人民币102.32元，已最晚于2023年3月21日支付；应付交易费用为人民币16,405.29元，为应付券商佣金，已于2023年4月24日支付；应付信息披露费为人民币80,000.00元，已于2023年4月7日支付；应付律师费为人民币20,000.00元，已于2023年5月8日支付；应付审计费为人民币25,000.00元，已于2023年5月16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3月16日基金净资产	9,011,257.20
加：2023年3月16日确认的净申购	638.92
减：2023年3月16日确认的净赎回	91,344.31
加：清算期间清算净收益	46,365.63
二、2023年5月25日基金净资产	8,966,917.44

资产处置及负债清偿后，于2023年5月25日本基金剩余财产为人民币8,966,917.44元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信价值优先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5月25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) 申万菱信价值优先混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 关于《申万菱信价值优先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。

申万菱信价值优先混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2023年8月2日