

申万菱信基金管理有限公司
申万菱信价值优享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

基金主代码：004768

信息披露日期：2018年11月10日

一、重要提示

申万菱信价值优享混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2017】736号文注册募集，于2017年7月12日成立并正式运作，基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定及《申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定：

“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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。”

截至2018年9月3日日终，本基金连续60个工作日基金资产净值

低于5000万元，已触发本基金《基金合同》约定的基金合同终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据本基金《基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，本基金《基金合同》将终止并依法进入基金财产清算程序，上述事项无需召开基金份额持有人大会审议。

本基金自2018年9月4日起进入清算期，由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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2018年9月4日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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、基金名称：申万菱信价值优享混合型证券投资基金

2、基金简称：申万菱信价值优享混合

3、基金代码： 004768

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2017年7月12日

6、2018年9月3日（最后运作日）基金份额总额：

6,764,977.68份

7、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。

8、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。

9、业绩比较基准：中证500 指数收益率× 75%+中证综合债指数收益率×25%。

10、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。

11、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

12、基金托管人：华夏银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可【2017】736号文注册募集，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币204,109,354.93元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2017)第714号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于2017年7月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为204,124,984.96份基金份额，其中认购资金利息折合15,630.03份基金份额。自2017年7月12日至2018年9月3日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》约定，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2018年9月3日日终，本基金连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》有关约定，无需召开基金份额持有人大会，本基金《基金合同》将终止并依法履行基金财产清算程序。本基金自2018年9月4日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：申万菱信价值优享混合型证券投资基金

报告截止日：2018年9月3日（最后运作日）

资产	本期末 2018年9月3日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	2,898,544.28	14,797,224.32
结算备付金	-	625,677.42
存出保证金	129,224.12	213,552.08
交易性金融资产	3,910,350.81	181,959,154.36
其中：股票投资	3,910,350.81	181,838,054.36
债券投资	-	121,100.00
应收证券清算款	-	1,277,778.30
应收利息	4,266.11	3,671.91
应收申购款	346.38	-
资产总计	6,942,731.70	198,877,058.39
负债和所有者权益		
负债：		
应付证券清算款	-	1,268,595.25
应付赎回款	11,304.48	1,066.15
应付管理人报酬	7,930.24	198,911.39
应付托管费	660.84	16,575.96
应付交易费用	1,057.96	363,733.32
其他负债	210,442.93	210,002.68
负债合计	231,396.45	2,058,884.75
所有者权益：		
实收基金	6,764,977.68	179,376,332.77

未分配利润	-53,642.43	17,441,840.87
所有者权益合计	6,711,335.25	196,818,173.64
负债和所有者权益总计	6,942,731.70	198,877,058.39

注：

1. 报告截止日 2018 年 9 月 3 日(基金最后运作日)，申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金份额净值 0.9921 元，基金份额总额 6,764,977.68 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 3 日(基金最后运作日)止期间。

3、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 2018 年 9 月 3 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、清算事项说明

自2018年9月4日至2018年9月20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《申万菱信价值优享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) 根据中国证券登记结算有限责任公司结算保证金计算规则，本基金最后运作日结算保证金人民币 129,224.12 元，其中 18,339.05 元已于 2018 年 9 月 4 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产估值金额人民币 3,910,350.81 元，全部为股票资产，已于 2018 年 9 月 4 日将可变现部分全部变现，变现款项已于 2018 年 9 月 5 日划入托管账户。

未变现部分全部为停牌股票资产(单只停牌股票最后运作日估值金额=该停牌股票于最后运作日估值价格×股票数量)，具体情况如下：

股票代码	股票名称	股票数量 (股)	最后运作日估值 价格(人民币元)	最后运作日估值 金额(人民币元)
002051	中工国际	49,000	12.66	620,340.00

截至本次清算期结束日(2018 年 9 月 20 日)，本基金所持上述股票尚未复牌。由于上述股票复牌可变现的时间尚不确定，因此需要进行二次清算。待本基金所持停牌股票复牌后进入二次清算程序，将全部停牌股票变现后的基金资产净值按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币 4,266.11 元，至本基金最后一笔清算款划出日前一日的银行存款、清算备付金及结算保证金将按规定继续计提利息并归基金份额持有人所有。

(4) 本基金最后运作日应收申购款人民币 346.38 元，已于 2018 年 9 月 4 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 11,304.48 元，已于 2018 年 9 月 4 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 7,930.24 元，其中人民币 7,045.41 元已于 2018 年 9 月 4 日支付，人民币 884.83 元已于 2018 年 9 月 7 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 660.84 元，其中人民币 587.10 元已于 2018 年 9 月 4 日支付，人民币 73.74 元已于 2018 年 9 月 7 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,057.96 元，为应付券商佣金，已于 2018 年 9 月 7 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 210,442.93 元，其中应付赎回费人民币 5.45 元，已于 2018 年 9 月 4 日支付；应付审计费为人民币 40,437.48 元，将于收到会计师事务所付费通知之后支付；应付信息披露费为人民币 150,000.00 元，将于收到信息披露机构发票后支付；应付律师费为人民币 20,000.00 元，已于 2018 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2018年9月3日基金净资产	6,711,335.25
加：清算期间清算净收益	-30,913.62
减：清算费用	-
三、2018年9月20日基金净资产	6,680,421.63

资产处置及负债清偿后，于2018年9月20日本基金剩余财产为人民币6,680,421.63元，其中包括交易性金融资产估值金额人民币625,240.00元（该金额为停牌股票于本次清算结束日估值金额，与停牌股票资产复牌后实际变现金额可能存在差异）。根据《关于申万菱信价值优享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，因持有停牌证券暂时无法变现的，本基金将先以已变现基金资产为限进行分配，待停牌证券复牌并全部变现后进行再次分配。

2018年9月20日至本基金最后一笔清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及结算保证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于最后一次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。

6、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) 申万菱信价值优享混合型证券投资基金2018年9月3日资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信价值优享混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

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。

申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018 年 11 月 10 日