

申万菱信基金管理有限公司 申万菱信中证申万传媒行业投资指数 分级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:上海银行股份有限公司
基金主代码:申万传媒份额(场内简称:申万传媒);163117;
申万传媒A 份额(场内简称:传媒A);150233;
申万传媒B 份额(场内简称:传媒B);151024
信息披露日期:2018年10月12日

一、重要提示
申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金(原名为“申万菱信申万传媒行业投资指数分级证券投资基金”,以下简称“本基金”)经中国证监会2015年5月3日证监许可【2015】498号文注册募集,于2015年5月29日成立并正式运作,基金管理人申万菱信基金管理有限公司、基金托管人为上海银行股份有限公司。

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》、《申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)、《申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金招募说明书》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20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,基金合同生效后,如出现下述情形之一的,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20人;2.连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。”

截至2018年8月15日(最后运作日),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8月16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、基金托管人上海银行股份有限公司、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8月16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书。

二、基金概况
1.基金名称:申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金
2.基金简称:申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级
3.基金代码:申万传媒份额(场内简称:申万传媒);163117;申万传媒A 份额(场内简称:传媒A);150233;申万传媒B 份额(场内简称:传媒B);151024
4.基金运作方式:上市契约开放式
5.投资目标:本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差率不超过4%,实现对中证申万传媒行业投资指数的有效跟踪。

6.投资策略:本基金采用数量化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差率不超过4%,实现对中证申万传媒行业投资指数的有效跟踪。
7.投资目标:本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差率不超过4%,实现对中证申万传媒行业投资指数的有效跟踪。

8.投资范围:本基金投资于股票资产,按照目标指数的成份股及其权重构建股票投资组合并相应地调整,本基金股指期货投资策略为在股指期货投资中将股指期货纳入在风险控制的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金资产配置投资策略为在有效控制风险的前提下,对资产支持证券进行综合定价,选择低估的品种进行投资。

9.业绩比较基准:95%×中证申万传媒行业投资指数收益率+5%×银行同业存款利率
10.风险收益特征:本基金为股票型指数基金,由于采用了基金份额分级的方式,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万传媒份额为常规模数基金份额,具有预期风险较高,预期收益较高的特征,其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。申万传媒A 份额,具有预期风险、预期收益低于申万传媒B 份额;申万传媒B 份额由于采用杠杆投资,具有预期风险高、预期收益较高的特征。
11.基金管理人、申万菱信基金管理有限公司
12.基金托管人:上海银行股份有限公司

三、基金存续情况
本基金经中国证监会2015年3月31日证监许可【2015】498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222,701,984.62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(2015)第026号验资报告予以验证,经向中国证监会备案,基金合同于2015年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为322,741,381.41份基金份额,其中认购资金利息折合39,396.729份基金份额。自2015年5月29日至2018年8月15日清算期间,本基金按照基金合同约定正常运作。

根据《基金合同》约定的基金合同终止条款,出现下述情形之一的,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20人;
2.连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。

法律法规另有规定的,从其规定。
截至2018年8月15日(最后运作日),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,根据本基金《基金合同》的约定,无须经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8月16日起进入清算期。四、财务会计报告

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

资产负债表(已经审计)
资产主体:申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金
报告截止日:2018年8月15日(最后运作日)

资产	期末资产 2018年8月15日 (最后运作日)	上期期末资产 2017年12月31日
货币		
银行存款	4,288,331.21	4,797,375.29
结算备付金	490.65	
应收利息	8,737.57	20,394.34
交易性金融资产	26,476,126.60	62,529,696.42
可供出售金融资产	26,033,861.69	62,529,696.42
持有至到期投资	296,667.77	
应收股利	4,250.97	
应收申购款	15,902.06	14,588.77
资产总计	31,249,198.83	50,090,228.10
负债和所有者权益		
负债		
应付证券款项	21.25	
应付利息	186,182.38	
应付管理人报酬	15,844.08	42,687.34
应付托管费	3,368.69	9,439.86
应付增值税	7,628.53	7,697.77
其他应付款	1,257.75	237,928.26
负债合计	1,642,914.24	430,872.52
所有者权益		
实收资本	105,175,138.16	134,321,594.34
资本公积	16,849,286.29	48,625,326.76
未分配利润	29,606,469.49	65,926,296.59
所有者权益合计	31,249,198.83	50,090,228.10

注:
1.报告截止日2018年8月15日(最后运作日),申万传媒份额0.6915元,申万传媒A 份额参考净值1.0094元,申万传媒B 份额参考净值0.7376元,申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金份额总额42,852,913.31份,其中申万传媒份额36,046,960.13份,申万传媒A 份额3,402,976.00份,申万传媒B 份额3,402,976.00份。

2.清算期间按照中国证监会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》约定的估值方法进行估值,与中国证监会发布的有关规范性文件规定的基金行业实务操作惯例一致。
于2018年8月15日(最后运作日),所有资产可以回收的金额与原账面价值孰低计量,负债以预计清偿金额的金额计量。

五、清算事项说明
自2018年8月16日至2018年9月7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,本次清算工作按照清算原则清算手续进行,具体情况如下:
1.清算费用
按照《申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金合同》第二十五条“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定,清算费用指基金财产清算小组进行基金清算过程中发生的各项合理费用,清算费用从基金财产清算小组优先支付。

2.资产处置情况
(1)申万菱信最后运作日结算备付金人民币490.65元,该款项由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司收取并保管,已于2018年9月4日划入托管账户。
(2)申万菱信最后运作日应付证券款项人民币3,368.69元,已于2018年9月4日划入托管账户。
(3)申万菱信最后运作日应付管理人报酬人民币15,844.08元,已于2018年9月4日支付。
(4)申万菱信最后运作日应付托管费人民币3,368.69元,已于2018年9月4日支付。
(5)申万菱信最后运作日应付交易费用人民币7,820.33元,为应付券商佣金,已于2018年9月7日支付。
(6)申万菱信最后运作日其他应付款人民币16,778.71元,其中应付赎回费人民币53,390.86元,已于2018年8月16日支付了人民币1,581.57元,已于2018年8月17日支付了人民币1,809.29元;应付指数使用费人民币3,387.85元,已于2018年8月24日支付;应付审计费为人民币40,000.00元,将于收到会计师事务所收费通知之后支付;应付信息披露费为人民币30,000.00元,已于2018年8月24日支付人民币20,000.00元,剩余人民币10,000.00元将于收到信息披露费通知后支付;应付律师费为人民币20,000.00元,将于收到律师事务所发票后支付;应付上列费用为人民币40,000.00元,已于2018年8月17日支付。
3.资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
截止本报告期末2018年8月15日基金总资产	26,033,861.69	
其中:货币资金	468,760.62	
应收款项	48,649.73	
可供出售金融资产	25,516,451.34	
2018年9月30日止基金总资产	26,973,908.12	

项目	期末	期初
----	----	----