

# 上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十二月二十五日

报告公告日期：二〇一九年一月二十八日

## 目录

1、重要提示.....	3
2、基金概况.....	3
2.1 基金基本情况.....	3
2.2 基金产品说明.....	4
3、基金运作情况概述.....	5
4、财务会计报告.....	5
5、清盘事项说明.....	7
5.1 基金基本情况.....	7
5.2 清算原因.....	8
5.3 清算起始日.....	8
5.4 清算报表编制基础.....	8
6、清算情况.....	8
6.1 清算费用.....	8
6.2 资产处置情况.....	8
6.3 负债清偿情况.....	9
6.4 清算期的清算损益情况.....	9
6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	10
6.6 基金财产清算报告的告知安排.....	11
7、备查文件目录.....	11
7.1 备查文件目录.....	11
7.2 存放地点.....	11
7.3 查阅方式.....	12

## 1、重要提示

上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金（以下简称“天颐年丰混合”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]321号文注册，于2013年7月18日成立并正式运作，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，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》和《上投摩根天颐年丰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，上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与本基金托管人协商一致，提议召开基金份额持有人大会终止本基金基金合同。本基金基金份额持有人大会于2018年11月20日表决通过了《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见2018年11月22日刊登在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》及基金管理人网站上的《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金从2018年11月23日起进入清算期，由基金管理人上投摩根基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 2、基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根天颐年丰混合
基金主代码	000125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月18日
基金管理人名称	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
2018年11月22日基金份额总额	30,516,856.45

下属分级基金的基金简称	天颐年丰混合A	天颐年丰混合C
下属分级基金的交易代码	000125	002437
2018年11月22日下属分级基金份额总额	30,516,856.45	-

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争为投资者提供稳定的现金分红。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金管理人将采用严格的仓位控制策略，根据基金单位净值的变化和对未来市场的判断，灵活控制股票仓位，控制下行风险。具体而言，本基金将以每一个会计年度作为仓位控制策略执行的周期，即：以上一年度年末的基金单位净值作为基准，根据基金当前净值与本年度单位累计分红金额之和确定股票仓位上限。</p> <p>2、债券投资策略：本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转债策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。</p> <p>3、股票投资策略：本基金将采用自下而上的分析方法，以企业基本面研究为核心，并结合股票价值评估，精选具有较强竞争优势且估值合理的股票构建投资组合。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+1%
风险收益特性	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益水平的基金产品。

### 3、基金运作情况概述

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于核准上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]321号文），自2013年6月17日起向全社会公开募集，截至2013年7月12日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为439,211,938.71元人民币，折合基金份额439,211,938.71份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计72,543.59人民币，折合基金份额72,543.59份。

经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于2013年7月18日生效。本基金为契约型开放式混合型基金，存续期限为不定期。

自2013年7月18日至2018年11月22日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2018年11月23日起，本基金进入清算程序。

### 4、财务会计报告

#### 资产负债表（已经审计）

会计主体：上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金

报告截止日：2018年11月22日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年11月22日 (基金最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	16,355,938.54
结算备付金	2,000,579.31
存出保证金	22,499.34
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
债券投资	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	12,000,986.31
应收利息	16,849.11

应收申购款	112,676.87
<b>资产总计</b>	<b>30,509,529.48</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债：</b>	
应付证券清算款	-
应付赎回款	4,575.99
应付管理人报酬	16,445.86
应付托管费	4,568.28
应付交易费用	5,609.93
应交税费	645.02
其他负债	130,016.51
<b>负债合计</b>	<b>161,861.59</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	30,516,856.45
未分配利润	-169,188.56
<b>所有者权益合计</b>	<b>30,347,667.89</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>30,509,529.48</b>

注：

1.报告截止日 2018 年 11 月 22 日（基金最后运作日），上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额总额为 30,516,856.45 份，均为 A 类基金份额，基金份额净值 0.994 元。

2.本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 22 日(基金最后运作日)止期间。

## 5、清盘事项说明

### 5.1 基金基本情况

根据《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》和《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自

2016年2月15日起，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别，但各类别基金份额之间不得相互转换。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的0%-40%；债券、现金等其他金融工具占基金资产的比例不低于60%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资占基金资产净值的0-3%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

根据《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》以及上投摩根基金管理有限公司于2018年11月22日发布的《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的最后运作日为2018年11月22日，并于2018年11月23日进入财产清算程序。

## 5.2 清算原因

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》和《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2018年11月20日表决通过了《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

### 5.3 清算起始日

根据上投摩根基金管理有限公司《关于上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的清算起始日为2018年11月23日。

### 5.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是参考《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。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 6、清算情况

自2018年11月23日至2018年12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，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### 6.1 清算费用

按照《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金基金合同》中“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。

### 6.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币16,355,938.54元，截至2018年12月25日（清算截止日）银行存款为人民币25,805,202.53元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币2,000,579.31元。截至2018年12月25日（清算截止日）结算备付金为583,650.75元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币22,499.34元。截至2018年12月25日（清算截止日）存出保证金为24,987.76元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币12,000,986.31元。截至2018年



12月25日（清算截止日）余额为人民币0.00元。

（5）本基金最后运作日应收利息为人民币16,849.11元，截至2018年12月25日（清算截止日）余额为人民币2,717.32元。

（6）本基金最后运作日应收申购款为人民币112,676.87元，截至2018年12月25日（清算截止日）余额为人民币0.00元。

### 6.3 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币4,575.99元，该款项已分别于2018年11月23日和2018年11月26日从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币16,445.86元，该款项已于2018年12月5日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币4,568.28元，该款项已于2018年12月5日支付。

（4）本基金最后运作日应付交易费用为人民币5,609.93元，该款项截止2018年12月24日已全部支付。

（5）本基金最后运作日应交税费为人民币645.02元，该款项截止2018年12月7日已全部支付。

（6）本基金最后运作日其他负债为本基金预提费用和赎回费，包含本基金审计费55,000.00元，信息披露费75,000.00元，赎回费16.51元，上述款项截至2018年12月12日已全部偿还。

### 6.4 清算期的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2018年11月23日至2018年12月25日止清算期间
一、资产处置收入	
1. 利息收入-存款利息收入（注1）	18,286.00
2. 回购利息收入	1,528.77
二、清算费用	
银行划款手续费	115.00

律师费	40,000.00
公证费	10,000.00
其他费用（注2）	10,293.40
二、清算净损益（净亏损以“-”） 号填列	-40,593.63

注1：利息收入以当前适用的利率预估计提的自2018年11月23日至2018年12月25日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

注2：其他费用包含债券账户维护费和赎回费。

## 6.5 清算期的其他事项

1、于2018年11月23日，本基金经上投摩根基金管理有限公司登记系统确认的基金申购及转入款项为1,351.79元，折合为1,359.94份基金份额。均为于2018年11月22日(基金最后运作日)提出申请并于2018年11月23日确认的基金申购及转入款项。

2、于2018年11月23日，本基金经上投摩根基金管理有限公司登记系统确认的基金赎回份额3,918,759.36份，折合为赎回款项3,891,867.69元，均为于2018年11月22日(基金最后运作日)提出申请并于2018年11月23日确认的基金赎回款项。

## 6.6 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

截至本次清算期结束日2018年12月25日，本基金剩余财产为人民币26,416,558.36元，自本次清算结束日次日2018年12月26日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。根据本基金的基金合同约定，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。

为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人上投摩根基金管理有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息。基金管理人所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。

本基金的银行存款应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额

的尾差由基金管理人承担。

## 6.7 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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

## 7、备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- (1) 上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- (2) 关于《上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

### 7.2 存放地点

基金管理人处

### 7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金财产清算组

2019年1月28日