

上投摩根文体休闲灵活配置混合型 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月三十日

报告公告日期：二〇二三年二月八日

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	6
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.....	10
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.....	11

1、重要提示

上投摩根文体休闲灵活配置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[2015]1879号文准予募集注册，于2015年12月23日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）以及上投摩根基金管理有限公司于2022年12月22日发布的《关于上投摩根文体休闲灵活配置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》，基金份额持有人大会于2022年12月20日表决通过了《关于上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，本基金的最后运作日为2022年12月22日，并于2022年12月23日进入基金财产清算程序。

本基金从2022年12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	上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根文体休闲混合
基金代码	001795
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月23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	中国银行股份有限公司
2022年12月22日基金份额总额	17,637,727.88

2.2 基金产品说明

投资目标	采用定量及定性研究方法，自上而下进行宏观产业分析，自下而上优选文体休闲主题上市公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，确定合适的资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>根据本基金投资理念及投资目标，本基金在申银万国一级行业分类中选取了以下与文体休闲主题相关的行业，分别是：传媒、计算机、电子、休闲服务、房地产、纺织服装、轻工制造、商业贸易、通信、家用电器、交通运输、汽车、食品饮料、综合。我们将遵循自上而下的宏观产业分析逻辑，从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值，对基金资产在行业间分配进行安排。本基金将通过系统和深入的基本面研究，密切关注受益于国家文化体育产业政策扶持、满足城镇居民生活水平提高和消费升级需求的行业和公司，同时重点投资于创新商业模式、引领新的生活方式和消费习惯的相关行业及公司。</p> <p>3、固定收益类投资策略</p> <p>对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，自上而下进行组合构建，自下而上进行个券选择。</p> <p>4、其他投资策略：包括可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%

风险收益特性	<p>本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。</p> <p>根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>
--------	---

3、基金运作情况概述

本基金根据中国证监会证监许可[2015]1879号文《关于准予上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》，自2015年11月18日起向全社会公开募集，截至2015年12月16日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资，本次募集的有效净认购金额为316,703,607.97元人民币，折合基金份额316,703,607.97份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计44,319.73元人民币，折合基金份额44,319.73份。总计募集基金份额316,747,927.70份。

经中国证券监督管理委员会书面确认，本基金的基金合同于2015年12月23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2015年12月23日至2022年12月22日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2022年12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：上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月22日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 12 月 22 日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	950,355.95
结算备付金	8,544.60
存出保证金	2,928.79
交易性金融资产	-
其中：债券投资	-
买入返售金融资产	-
应收利息	-
应收证券清算款	14,478,022.04
应收申购款	379.90
资产总计	15,440,231.28
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	13,025.81
应付管理人报酬	14,854.08
应付托管费	2,475.67
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	100,997.18

负债合计	131,352.74
所有者权益：	
实收基金	17,637,727.88
未分配利润	-2,328,849.34
所有者权益合计	15,308,878.54
负债和所有者权益总计	15,440,231.28

注：

1. 报告截止日 2022 年 12 月 22 日(基金最后运作日), 本基金的份额净值 0.8680 元, 基金份额总额 17,637,727.88 份。

2. 财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 22 日(基金最后运作日)。

5、清盘事项说明

5.1 基金基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的有关规定, 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、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权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(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。

本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 0%-95%; 投资于本基金所定义的文体休闲主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 保持现金或到期日在一年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、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%。

5.2 清算原因

根据《基金合同》以及上投摩根基金管理有限公司于 2022 年 12 月 22 日发布的《关于上投摩根文体休闲灵活配置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》，基金份额持有人大会于 2022 年 12 月 20 日表决通过了《关于上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，本基金的最后运作日为 2022 年 12 月 22 日，并于 2022 年 12 月 23 日进入基金财产清算程序。

5.3 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 2022 年 12 月 23 日至 2023 年 1 月 30 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《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 950,355.95 元，其中活期存款人民币 950,337.36 元，应计活期存款利息人民币 18.59 元，截至 2023 年 1 月 30 日（清算截止日）银行存款为人民币 13,932,633 元，其中活期存款人民币 13,927,265.55 元，应计活期存款利息人民币 5,367.45 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 8,544.60 元，其中备付金余额为人民币 8,543.84 元，应计结算备付金利息为人民币 0.76 元，截至 2023 年 1 月 30 日（清算截止

日) 结算备付金为人民币 7.60 元, 均为应计备付金利息。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,928.79 元, 其中交易所结算保证金人民币 2,928.53 元, 应计存出保证金利息人民币 0.26 元, 截至 2023 年 1 月 30 日(清算截止日) 存出保证金余额为人民币 1.82 元, 均为应计保证金利息。

(4) 本基金最后运作日(2022 年 12 月 22 日)确认的应收申购款利息 379.90 元, 已于 2022 年 12 月 29 日收回。

(5) 本基金最后运作日(2022 年 12 月 22 日)确认的应收证券清算款 14,478,022.04 元, 已于 2022 年 12 月 23 日收回完毕。

6.3 负债清偿情况

(1) 于 2022 年 12 月 20 日提出申请并于 2022 年 12 月 21 日确认的基金赎回款项 1,104.10 元和转出款项 1,232.17 元, 已于 2022 年 12 月 23 日划付完毕。于 2022 年 12 月 21 日提出申请并于 2022 年 12 月 22 日(基金最后运作日)确认的基金赎回款项 10,689.54 元, 已于 2022 年 12 月 26 日划付完毕。于 2022 年 12 月 22 日(基金最后运作日)提出申请并于 2022 年 12 月 23 日确认的基金赎回款项 721,578.74 元和转出款项 654,760.09 元, 已于 2022 年 12 月 27 日划付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 14,854.08 元, 该款项已于 2023 年 1 月 5 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,475.67 元, 该款项已于 2023 年 1 月 5 日支付。

(4) 本基金最后运作日确认的其他负债 100,997.18 元, 包括应付审计费 30,000.00 元, 应付公证费 10,000.00 元, 应付律师费 40,000.00 元, 应付交易费用 20,963.79 元和应付赎回费 33.39 元, 均已支付完毕。

6.4 清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	自2022年12月23日至2023年1月30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)	5,357.26

2. 其他收入（注2）	952.12
二、清算费用	
1. 银行划款手续费	142.57
2. 股利红利税	2,768.59
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	3,398.22

注1：利息收入以当前适用的利率预估计提的自2022年12月23日至2023年1月30日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息。

注2：其他收入为最后运作日（12月22日）赎回申请产生的赎回费与补差费。

6.5 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2023年1月30日，本基金剩余财产为人民币13,932,642.42元，自本次清算结束日次日2023年1月31日至本次清算款划出前一日的银行存款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、结算备付金、存出保证金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。

6.6 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。

7、备查文件目录

7.1 备查文件目录

- (1) 上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- (2) 关于《上投摩根文体休闲灵活配置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。

上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金财产清算组

2023年2月8日