

上投摩根安鑫回报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：二〇二一年九月二十八日

报告公告日期：二〇二一年十月二十日

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.....	9
6.2 资产处置情况.....	9
6.3 负债清偿情况.....	9
6.4 清算期的清算损益情况.....	10
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

上投摩根安鑫回报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]2279号文准予募集注册，于2016年8月5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。根据《上投摩根安鑫回报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2021年8月26日发布的《关于上投摩根安鑫回报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2021年8月24日表决通过了《关于上投摩根安鑫回报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2021年8月26日，并于2021年8月27日进入基金财产清算程序。

本基金从2021年8月27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	上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根安鑫回报混合
基金主代码	001947
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月5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
2021年8月26日基金份额总额	11,303,717.31

下属分级基金的基金简称	上投摩根安鑫回报混合A	上投摩根安鑫回报混合C
下属分级基金的交易代码	001947	002845
2021年8月26日下属分级基金份额总额	8,451,743.92	2,851,973.39

2.2 基金产品说明

投资目标	以追求稳健收益作为基金的投资目标，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策、资金面、市场估值水平和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析，评估股票、债券等各类资产风险收益特征，预测不同类别资产表现，确定合适的资产配置比例。同时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。 2、债券投资策略 本基金根据对财政政策、货币政策的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、中小企业私募债策略、证券公司短期债等多种投资策略，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。 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。 本基金将采取一定的新股投资策略，深入分析基本面，结合市场估值水平和股市投资环境，选择合适标的参与新股投资。 4、股指期货投资策略

	本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。 5、股票期权投资策略 本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。 6、资产支持证券投资策略 本基金主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，确定资产合理配置比例。 7、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
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高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中等风险收益水平的基金产品。 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。

3、基金运作情况概述

本基金根据中国证监会《关于准予上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2279号文）和《关于上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函[2016]1063号文），自2016年7月4日起向全社会公开募集，截至2016年7月29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

876,147,291.75元人民币（其中A类基金份额533,371,654.71元人民币、C类基金份额342,775,637.04元人民币），折合基金份额876,147,291.75份（其中A类基金份额533,371,654.71份、C类基金份额342,775,637.04份）；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计114,035.29元人民币（其中A类基金份额81,542.14元人民币、C类基金份额32,493.15元人民币），折合基金份额合计876,261,327.04份（其中A类基金份额533,453,196.85份、C类基金份额342,808,130.19份）。

经中国证监会注册，本基金的基金合同于2016年8月5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2016年8月5日至2021年8月26日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2021年8月27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：上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金

报告截止日：2021年8月26日

单位：人民币元

资 产	本期末 2021年8月26日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	1,830,208.22
结算备付金	26,825.99
存出保证金	2,310.62
交易性金融资产	9,628,013.60
应收利息	184,078.09
应收申购款	3,537.31
资产总计	11,674,973.83
负债和所有者权益	
负 债：	
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	436.25

应付管理人报酬	13,042.05
应付托管费	4,075.63
应付销售服务费	4,897.56
应付交易费用	2,664.90
应交税费	551.62
应付利息	-
其他负债	20,000.41
负债合计	45,668.42
所有者权益：	
实收基金	11,303,717.31
未分配利润	325,588.10
所有者权益合计	11,629,305.41
负债和所有者权益总计	11,674,973.83

注：

1. 报告截止日 2021 年 8 月 26 日(基金最后运作日), 基金份额总额 11,303,717.310 份, 其中 A 类基金份额 8,451,743.92 份, A 类基金份额净值为 1.0296 元; C 类基金份额 2,851,973.39 份, C 类基金份额净值为 1.0266 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 8 月 26 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《基金合同》和《上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金招募说明书》的规定, 本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时, 收取认购/申购费用的, 称为 A 类基金份额; 不收取认购/申购费用, 但从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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, 本基金投资于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)、存托凭证、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、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、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)。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。

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%

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 2021 年 8 月 26 日发布的《关于上投摩根安鑫回报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 2021 年 8 月 24 日表决通过了《关于上投摩根安鑫回报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 2021 年 8 月 26 日，并于 2021 年 8 月 27 日进入财产清算期。

5.3 清算起始日

根据上投摩根基金管理有限公司《关于上投摩根安鑫回报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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 8 月 27 日至 2021 年 9 月 28 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《上投摩根安鑫回报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 1,830,208.22 元。截至 2021 年 9 月 28 日（清算截止日）银行存款为人民币 11,392,163.55 元。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 26,825.99 元。截至 2021 年 9 月 28 日（清算截止日）结算备付金为 0 元。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,310.62 元。截至 2021 年 9 月 28 日（清算截止日）存出保证金为 2,002.85 元。

（4）本基金最后运作日应收利息为人民币 184,078.09 元。截至 2021 年 9 月 28 日（清算截止日）余额为人民币 886.73 元。

（5）本基金最后运作日应收申购款为人民币 3,237.31 元和转入款项 300.00 元，已分别于 2021 年 8 月 27 日和 2021 年 8 月 30 日收到。于 2021 年 8 月 26 日(基金最后运作日)提出申请并于 2021 年 8 月 27 日确认的基金申购款项 8,679.31 元，已于 2021 年 8 月 30 日收回。

（6）本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 9,628,013.60 元。截至 2021 年 9 月 28 日（清算截止日），本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部变现。

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 436.25 元，已分别于 2021 年 8 月 27 日和 2021 年 8 月 30 日划付完毕。于 2021 年 8 月 26 日(基金最后运作日)提出申请并于 2021 年 8 月 27 日确认的基金赎回款项 263,649.49 元，已于 2021 年 8 月 31 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 13,042.05 元，该款项已于 2021 年 9 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,075.63 元, 该款项已于 2021 年 9 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费用为人民币 4,897.56 元, 该款项已于 2021 年 9 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 2,664.90 元, 该款项已于 2021 年 9 月 15 日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 551.62 元, 该款项已于 2021 年 9 月 7 日支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为本基金预提费用和赎回费, 包含本基金应付审计费 20,000 元, 应付赎回费 0.41 元, 上述款项均已支付完毕。

6.4 清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	自2021年8月27日至2021年9月28日止清算期间
一、资产处置收入	
1. 利息收入	8,457.98
2. 其他收入-赎回费收入	1.79
3. 交易性金融资产变现投资收益	14,345.28
二、清算费用	
1. 交易费用	2,030.02
2. 其他费用	52.33
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	20,722.70

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2021年9月28日, 本基金剩余财产为人民币11,395,053.13 元, 自本次清算结束日次日2021年9月29日至本次清算款划出前一日的银行存款、结算

备付金和存出保证金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，用以垫付银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息收入和结算备付金、存出保证金等。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。

本基金的上述利息收入为预计金额，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）上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- （2）关于《上投摩根安鑫回报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。

上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金财产清算组

2021年10月20日