

上投摩根安瑞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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月二十一日

报告公告日期：二〇一九年三月四日

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.....	9
6.1 清算费用.....	9
6.2 资产处置情况.....	9
6.3 负债清偿情况.....	10
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.....	11
6.6 基金财产清算报告的告知安排.....	11
7、备查文件目录.....	12
7.1 备查文件目录.....	12
7.2 存放地点.....	12
7.3 查阅方式.....	12

1、重要提示

上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金（以下简称“安瑞回报混合”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2541号文准予募集注册，于2017年1月25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《上投摩根安瑞回报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12月19日发布的《关于上投摩根安瑞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2018年12月17日表决通过了《关于上投摩根安瑞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2018年12月19日，并于2018年12月20日进入基金财产清算程序。

本基金从2018年12月20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	上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金
基金简称	安瑞回报混合
基金主代码	003778
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月25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
2018年12月19日基金份额总额	18,487,660.11

下属分级基金的基金简称	上投摩根安瑞回报混合 A类	上投摩根安瑞回报混合C类
下属分级基金的交易代码	003778	003779
2018年12月19日下属分级基金 份额总额	10,182,278.54	8,305,381.57

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	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金将采用自下而上的分析方法，根据上市公司财务分析、盈利预期、治理结构等因素，结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，构建投资组合。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>5、股票期权投资策略</p> <p>本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期货定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中证综合债券指数收益率×85%
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，属于中等风险收益水平的基金产品。本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。</p>

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中国证监会证监许可[2016]2541号文准予募集注册，自2016年12月1日至2017年1月20日止募集工作顺利结束。

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212,568,569.54元人民币，折合基金份额212,568,569.54份，其中上投摩根安瑞回报混合A类份额110,798,079.55份，上投摩根安瑞回报混合C类份额101,770,489.99份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计57,629.55元人民币，折合基金份额57,629.55份。总计募集基金份额212,626,199.09份。

经中国证券监督管理委员会备案，本基金的基金合同于2017年1月25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2017年1月25日至2018年12月19日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2018年12月20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：安瑞回报混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月19日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年12月19日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	416,341.30
结算备付金	250,984.07
存出保证金	3,288.42
交易性金融资产	3,006,300.00
其中：债券投资	3,006,300.00
买入返售金融资产	5,000,000.00
应收利息	96,076.80
应收证券清算款	9,630,474.60
应收申购款	29.97
资产总计	18,403,495.16
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	69,739.14
应付管理人报酬	11,189.09
应付托管费	3,496.59

应付销售服务费	4,052.86
应付交易费用	3,018.57
应交税费	74.00
其他负债	85,483.70
负债合计	177,053.95
所有者权益：	
实收基金	18,487,660.11
未分配利润	-261,218.90
所有者权益合计	18,226,441.21
负债和所有者权益总计	18,403,495.16

注：

1. 报告截止日 2018 年 12 月 19 日(基金最后运作日)，安瑞回报混合 A 类基金的份额净值 0.9905 元，安瑞回报混合 C 类基金的份额净值 0.9802 元；基金份额总额 18,487,660.11 份。其中安瑞回报混合 A 类基金的份额总额 10,182,278.54 份，安瑞回报混合 C 类基金的份额总额 8,305,381.57 份。

2. 财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 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《上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金基金合同》和《上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，并不再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、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分

别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金基金合同》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（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、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、同业存单、银行存款、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)。

股票资产占基金资产的 0%-30%；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：沪深 300 指数收益率×15%+中证综合债券指数收益率×85%

5.2 清算原因

根据《上投摩根安瑞回报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 12 月 19 日发布的《关于上投摩根安瑞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》，本基金的最后运作日为 2018 年 12 月 19 日，并于 2018 年 12 月 20 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《关于上投摩根安瑞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 2018 年 12 月 20 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》

的有关规定制编制。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12月20日至2019年1月21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《上投摩根安瑞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416,341.30元，截至2019年1月21日（清算截止日）银行存款为人民币10,800,805.63元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币250,984.07元。上述款项于2019年1月21日（清算截止日）为222,785.50元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币3,288.42元。截至2019年1月21日（清算截止日）存出保证金为0元。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币96,076.80元，截至2019年1月21日（清算截止日）余额为人民币6,800.18元。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币29.97元，已于2018年12月20日收到该款项。

(6) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币9,630,474.60元，截至2019年1月21日（清算截止日）余额为人民币0元。

(7) 本基金最后运作日债券投资为人民币3,006,300.00元，截至2019年1月21日（清算截止日）余额为人民币0元。

(8) 本基金最后运作日买入返售证券为人民币 5,000,000.00 元, 截至 2019 年 1 月 21 日 (清算截止日) 余额为人民币 0 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 69,739.14 元, 该款项已于 2018 年 12 月 21 日支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 11,189.09 元, 该款项已于 2019 年 1 月 4 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,496.59 元, 该款项已于 2019 年 1 月 4 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费用为人民币 4,052.86 元, 该款项已于 2019 年 1 月 4 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 3,018.57 元, 该款项已于 2019 年 1 月 8 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为本基金预提费用, 包含本基金应付银行间市场清算所股份有限公司、中央国债登记结算有限责任公司的账户维护费共计人民币 9,300.00 元, 及审计费 60,000 元, 信息披露费 16,000 元, 应付赎回费 183.70 元, 上述款项截至 2019 年 1 月 21 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12月20日至2019年1月21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)	10,593.97
2. 其他收入-赎回费收入	133.54
二、清算费用	

1. 银行划款手续费	244.90
2. 账户维护费	1,600.00
3. 交易费用	3.08
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	8,879.53

注1：利息收入以当前适用的利率预估计提的自2018年12月20日至2019年1月21日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

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2019年1月21日，本基金剩余财产为人民币11,030,386.31元，自本次清算结束日次日2019年1月22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，用以垫付应收利息及结算备付金等。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。

6.6 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) 上投摩根安瑞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《上投摩根安瑞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。

上投摩根安瑞回报混合型证券投资基金财产清算组

2019年3月4日