

# 上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年第 4 季度报告

### 2022 年 12 月 22 日

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：二〇二三年一月二十日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 22 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	上投摩根文体休闲混合
基金主代码	001795
交易代码	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
报告期末基金份额总额	17,637,727.88 份
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	1、资产配置策略 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

	<p>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%
风险收益特征	<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</p>

	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。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 22 日)
1.本期已实现收益	-332,452.47
2.本期利润	-249,301.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0121
4.期末基金资产净值	15,308,878.54
5.期末基金份额净值	0.8680

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.86%	1.95%	0.30%	0.74%	-7.16%	1.21%
过去六个月	-14.86%	1.75%	-8.00%	0.64%	-6.86%	1.11%
过去一年	-32.15%	1.73%	-13.29%	0.77%	-18.86%	0.96%

过去三年	-33.23%	1.66%	-12.73%	0.71%	-20.50%	0.95%
过去五年	-21.09%	1.79%	0.46%	0.77%	-21.55%	1.02%
自基金合同生效起至今	-13.20%	1.64%	-4.08%	0.75%	-9.12%	0.89%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015 年 12 月 23 日至 2022 年 12 月 22 日)



注：本基金合同生效日为2015年12月23日，本基金运作终止日为2022年12月22日，图示的时间段为合同生效日至本基金运作终止日2022年12月22日。

本基金建仓期为本基金合同生效日起6个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年	说明
----	----	-------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
周战海	本基金基金经理	2015-12-23	-	16 年	周战海先生,2007 年 1 月至 2009 年 3 月在国金证券股份有限公司担任分析师,2009 年 4 月至 2010 年 7 月在太平洋资产管理有限公司担任研究员。2010 年 8 月起加入上投摩根基金管理有限公司,历任行业专家、基金经理助理、基金经理、高级基金经理。自 2015 年 12 月至 2022 年 12 月担任上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2018 年 2 月起同时担任上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金基金经理,自 2022 年 1 月起同时担任上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注: 1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.周战海先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《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》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管

理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：无。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年四季度，A 股整体呈现震荡走势，上证综指上涨 2.14%，深圳成指上涨 2.2%，创业板指上涨 2.53%。行业结构上，以申万行业分类统计来看，社会服务、计算机、传媒、综合、医药生物表现相对靠前，房地产、有色金属、电力设备、石油石化、煤炭表现相对落后。报告期内，本基金按照契约要求，以科技成长股为主要投资方向，投资重点依然集中在半导体、计算机、通信、传媒、元宇宙为主的 TMT 行业。报告期内，受所投资行业整体弱势影响，基金净值表现较差。

展望 2023 年一季度，制约经济的疫情政策出现根本性变化，防疫政策不断优化，宏观不确定性大幅下行。人民币汇率企稳回升，内外金融条件改善，流动性有望继续宽松，对应资产的风险溢价相应回落，风险偏好有望得到提升，我们预计这将推动 A 股估值进一步修复。根据证监会的政策要求，本基金也将在一季度完成清算清盘。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根文体休闲混合份额净值增长率为:-6.86%，同期业绩比较基准收益率为:0.30%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2022 年 10 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日。

上投摩根文体休闲混合已进入清算期。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	958,900.55	6.21
7	其他各项资产	14,481,330.73	93.79
8	合计	15,440,231.28	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### **5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

### **5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

### **5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

### **5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### **5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

### **5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

### **5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

### **5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### **5.11 投资组合报告附注**

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,928.79
2	应收证券清算款	14,478,022.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	379.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,481,330.73

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

本报告期初基金份额总额	19,218,745.28
报告期期间基金总申购份额	19,850,065.87
减：报告期期间基金总赎回份额	21,431,083.27
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	17,637,727.88

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20221116-20221122	0.00	19,294,871.79	19,294,871.79	0.00	0.00%
个人	1	20221001-20221115	3,983,827.49	0.00	0.00	3,983,827.49	22.59%
	2	20221123-20221222	3,983,827.49	0.00	0.00	3,983,827.49	22.59%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 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》，本次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》，决议自该日起生效。该基金份额持有人大会决议生效后，根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明，本基金将从本公告的下一日，即 2022 年 12 月 23 日起进入基金财产清算期。本基金进入清算程序后，即自 2022 年 12 月 23 日起，不再接受投资者提出的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务的申请，且不再计提管理费、托管费。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《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》
- 3、《上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

## 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

## 9.3 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。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二三年一月二十日