

私募投资基金信息披露上半年报表

1、基金产品概况

1.1基金基本情况

基金名称	腾云资产-银河2号文化影视基金专项资产管理计划
基金编号	SE7336
基金运作方式	封闭运作
基金成立日期	2016-01-26
基金管理人	上海腾云资产管理有限公司
基金托管人	杭州银行股份有限公司
投资顾问（如有）	广州市鑫懿和资产管理有限公司
报告期末基金份额总额	10,447,624.10
基金合同存续期	2年,目前处于清算期

1.2基金产品说明

投资目标	管理人按照《腾云资产-银河2号文化影视基金专项资产管理计划资产管理合同》的约定为投资人的利益管理、运用和处分，以期获得收益。
投资策略	<p>本基金财产主要投向于影视文化项目的拍摄、制作、发行，获取影视文化项目的票房、广告等投资收益，实现基金资产的稳健增值。</p> <p>基金管理人将密切关注国内外经济运行情况、国内财政政策和产业政策等政策取向，深入分析国民经济各行业的发展现状，在此基础上分析投资标的资产的持续的现金收益，盈利的稳定增长前景，及投资标的的可持续长期竞争力。</p> <p>本基金聘请广州市鑫懿和资产管理有限公司作为投资顾问，就本基金投资及退出等事宜提供顾问服务。</p>
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本基金为分级型产品，优先级份额具有中高等风险特征；劣后级份额的预期风险高于优先级份额，具有高风险特征。

1.3基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海腾云资产管理有限公司	杭州银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程伟刚
	联系电话	021-58931217
	电子邮箱	mailreturn@tengyunasset.com
办公地址	上海市浦东新区启帆路515号森兰美奂B座1019室	杭州市下城区庆春路46号
法定代表人	王海平	陈震山

1.4信息披露方式

本次私募投资基金年度信息通过上海腾云资产管理有限公司官方网站以只对投资者开放的方式进行披露，投资者可登陆<http://www.tengyunasset.com/>进行查询。上海腾云资产管理有限公司也已通过私募基金信息披露平台对此次信息进行了报送。

1.5其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	无	无
注册登记机构	上海腾云资产管理有限公司	上海市浦东新区启帆路515号 森兰美奂B座1019室
外包机构	无	无

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2022年H1	2021年	2020年
本期已实现收益	4.05	1,223,420.59	-363,420.62
本期利润	4.05	1,223,420.59	-363,420.62
期末数据和指标	2022年H1	2021年	2020年
期末可供分配利润	-1,658,201.96	-1,658,206.01	-2,881,626.6
期末可供分配基金份额利润	-0.159	-0.159	-0.276
期末基金资产净值	8,789,422.14	8,789,418.09	7,565,997.5
期末基金份额净值	0.841	0.841	0.724
累计期末指标	2022年H1	2021年	2020年
基金份额累计净值增长率	0.00%	5.69%	-1.66%

备注：截止报告日将计提未付的费用冲回；期末份额净值的计算不考虑基金的结构化设计因素

2.2基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差 (选填)	业绩比较基准收 益率 (选填)	业绩比较基准收益 率标准差 (选填)
当年	0.00%			
自基金合同 生效起至今	-6.80%			

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	10,447,624.10
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	10,447,624.10

4、管理人说明的其他情况

4.1 基金运作合规守信情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.2 基金估值程序

截止到报告期末，本管理人委托上海银行股份有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。

- 1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法。
- 2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。
- 3、在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

4.3 基金运作情况

标的运作情况：

诉讼进展：2022年1月5日，管理人收到上海市第一中级人民法院（2021）沪01民终11778号民事判决书，终审判决维持一审判决，即法院认为《差额补足函》合法有效，但生效条件尚未成就，驳回管理人的诉求。管理人将判决书发送托管银行，并将同托管银行商议后续处置事宜。诉讼中晏翥飞提出基金尚存回购权利的抗辩，管理人已向广州燊珑发催收函，业已签收。

基金到期后，基金管理人仍坚持投后工作，截至报告日项目已进入清算阶段。本基金已完成超过70%的投资本金清算工作。

2021年12月10日协会中国证券投资基金业协会公告，因不能持续符合管理人登记要求，协会注销公司私募基金管理人登记。我司将根据协会通知要求：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、协会相关自律规则和基金合同约定，妥善处置在管基金财产，依法保障投资者的合法利益。管理人将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则履行管理人职责。有关基金的任何最新进展，管理人将通过半年报和微信电话方式告知投资者。

5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——杭州银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基金管理人本年度报告中的财务指标、净值表现等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6、财务报表

6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末2022-06-30	上年末2021-12-31
资产：		
银行存款	2,672.06	2,668.01
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	8,836,783.36	8,836,783.36
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	8,839,455.42	8,839,451.37
负债和所有者权益	本期末2022-06-30	上年末2021-12-31
负债：	0.00	0.00

短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00
应付托管费	0.00	0.00
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	50,033.28	50,082.08
负债合计	50,033.28	50,082.08
所有者权益：		
实收基金	10,447,624.10	10,447,624.10
未分配利润	-1,658,201.96	-1,658,254.81
所有者权益合计	8,789,422.14	8,789,369.29
负债和所有者权益合计	8,839,455.42	8,839,451.37

6.2 利润表

单位：元

项目	本期
	2022-01-01至2022-06-30
一、收入	
1.利息收入	4.05
其中：存款利息收入	4.05
债券利息收入	0.00
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产利息收入	0.00
其他利息收入	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）	0.00
其中：股票投资收益	0.00
基金投资收益	0.00
债券投资收益	0.00
资产支持证券投资收益	0.00
贵金属投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00

股利收益	0.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	0.00
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00
5.其他收入（损失以“-”填列）	0.00
减：二、费用	
1.管理人报酬	0.00
其中：固定管理费	0.00
业绩报酬	0.00
2.托管费	0.00
3.销售服务费	0.00
4.外包服务费	0.00
5.交易费用	0.00
6.利息支出	0.00
其中：卖出回购金融资产款支出	0.00
7.其他费用	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4.05
减：所得税费用	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4.05

6.3所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2022-01-01至2022-06-30)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,447,624.10	-1,658,254.81	8,789,369.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		4.05	4.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款			
2.基金赎回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动			
五、期末所有者权益（基金净值）	10,447,624.10	-1,658,201.96	8,789,422.14