

国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资 基金清算报告

基金管理人：国联基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2024年5月13日

清算报告公告日期：2024年5月29日

一、重要提示及目录

1、重要提示

国联产业趋势一年定期开放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[2020]2764号文批准,于2020年12月23日成立并正式运作,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及基金合同的有关规定,基金合同生效后,在任一开放期的最后一日日终,如发生以下情形之一的,则无须召开基金份额持有人大会,本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止:

1、基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元;

2、基金份额持有人数量不满 200 人的;

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

截至2024年2月26日终(即本基金第三个开放期最后一日),本基金基金资产净值低于5000万元,已触发基金合同终止的上述情形。根据《基金合同》约定,基金管理人将终止基金合同并依法履行基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会。

本基金自2024年2月27日起进入清算期,由基金管理人国联基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力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,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

一、重要提示及目录	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
二、基金概况	4
三、财务会计报告	4
四、清算事项说明	5
1、基本情况.....	5
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	6
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况	7
1、资产处置情况.....	7
2、负债清偿情况.....	7
3、净资产情况.....	8
4、清算期间的清算损益情况、.....	8
5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况.....	9
6、基金财产清算报告的告知安排.....	9
六、备查文件目录	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	10
3、查阅方式.....	10

二、基金概况

- 1、基金名称： 国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金
- 2、基金简称： 国联产业趋势一年定开混合
- 3、基金代码： 国联产业趋势一年定开混合 A 代码： 010613
国联产业趋势一年定开混合 C 代码： 010614
- 4、基金运作方式： 契约型定期开放式
- 5、基金合同生效日： 2020 年 12 月 23 日
- 6、2024 年 2 月 26 日（基金最后运作日）基金份额总额： 47,832,159.25 份，
其中： 国联产业趋势一年定开混合 A： 41,440,217.92 份
国联产业趋势一年定开混合 C： 6,391,941.33 份
- 7、投资目标： 本基金通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，把握不同行业的发展趋势，精选具有产业优势的公司，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
- 8、投资策略：（一）封闭期投资策略： 1、资产配置策略； 2、股票投资策略（1）产业趋势股票的界定（2）股票投资策略（3）港股投资策略； 3、债券投资策略； 4、股指期货投资策略； 5、国债期货投资策略； 6、资产支持证券投资策略；（二）开放期投资策略。
- 9、业绩比较基准： 沪深 300 指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债综合指数收益率*20%
- 10、风险收益特征： 本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。
- 11、基金管理人： 国联基金管理有限公司
- 12、基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体： 国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日： 2024 年 2 月 26 日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2024 年 2 月 26 日
资产：	
货币资金	7,236,077.72
结算备付金	221,877.64
存出保证金	28,690.30
交易性金融资产	19,290,493.59
其中：股票投资	17,560,065.92
债券投资	1,730,427.67
应收清算款	124,911.49
资产合计	26,902,050.74
负债：	
应付赎回款	1,315,204.15
应付管理人报酬	24,158.45
应付托管费	4,026.41
应付销售服务费	2,215.91
其他负债	92,393.95
负债合计	1,437,998.87
净资产：	
实收基金	47,832,159.25
未分配利润	-22,368,107.38
净资产合计	25,464,051.87
负债及净资产合计	26,902,050.74

四、清算事项说明

1、基本情况

国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金(原名为中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金)经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]2764号文《关于准予中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》批准,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》发起,于2020年12月23日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》本基金自2023年9月8日起更名为国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资对象是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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债综合指数收益率*20%。

2、清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，截至2024年2月26日终（即本基金第三个开放期最后一日），本基金基金资产净值低于5000万元，已触发基金合同终止的情形。根据《基金合同》约定，基金管理人将终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人将按照《基金合同》有关规定对本基金的基金财产进行清算，并依法履行基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据《基金合同》及《关于国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》，2024年2月26日为基金最后运作日，本基金于2024年2月27日进入清算期，故本基金清算起始日为2024年2月27日。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自 2024 年 2 月 27 日至 2024 年 5 月 8 日止的清算期间，本基金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，具体情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 7,236,077.72 元，其中应计利息为 3,995.33 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 221,877.64 元，其中应计利息为 780.84 元。该款项已于清算期间转入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 28,690.30 元，其中应计利息为 79.35 元。该款项已于清算期间转入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产 19,290,493.59 元，其中：股票投资 17,560,065.92 元，债券投资 1,730,427.67 元，已于清算期间全部变现。

(5) 本基金最后运作日应收清算款 124,911.49 元，该款项已于 2024 年 2 月 27 日划入基金托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为 1,315,204.15 元，该款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 24,158.45 元，该款项已于 2024 年 3 月 6 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为 4,026.41 元，该款项已于 2024 年 3 月 6 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为 2,215.91 元，该款项已于 2024 年 3 月 6 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为 92,393.95 元，其中应付交易费用 61,492.70 元，该款项已于 2024 年 4 月 19 日支付；审计费用 23,114.48 元（含 2023 年度审计费用 20,000.00 元），2023 年度审计费用 20,000.00 元已于 2024 年 4 月 19 日支付，剩余款项将于清算审计完成后从托管账户划出；预提信息披露费 7,786.77 元，该款项将于收到信息披露费发票后从托管账户支付。

(6) 本基金清算期间计提律师费 15,000.00 元，该款项将于律师事务所出具法律意见书后从托管账户划出。

3、净资产情况

最后运作日本基金净资产为25,464,051.87元，基金份额总额47,832,159.25份，其中国联产业趋势一年定开混合A份额41,440,217.92份、国联产业趋势一年定开混合C份额6,391,941.33份；清算结束日本基金净资产为27,244,992.58元，基金份额总额46,061,827.41份，其中国联产业趋势一年定开混合A份额40,205,758.73份、国联产业趋势一年定开混合C份额5,856,068.68份。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币
元

项目	清算期发生额
一、清算期间收入	
1、利息收入（注1）	6,634.19
2、处置交易性金融资产产生的净收益	3,899,104.36
3、公允价值变动损益	-1,144,597.93
清算期间收入小计	2,761,140.62
二、清算期间费用	
1、审计费	
2、律师费	15,000.00
3、汇划费	124.00
4、交易费用	26,598.93
清算期间费用小计	41,722.93
三、清算净收益（清算净损失以“-”表示）	2,719,417.69

注：利息收入包括本基金自清算起始日 2024 年 2 月 27 日至 2024 年 5 月 8 日形成的银行存款利息收入 6,492.80 元、结算备付金利息收入 133.56 元、保证金利息收入 7.83 元，共计 6,634.19 元。

5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

单位：人民币元

项目	金额
----	----

一、最后运作日 2024 年 2 月 26 日基金净资产	25,464,051.87
加：清算期间净收益	2,719,417.69
加：清算期间因申购影响的金额	0
减：清算期间因赎回影响的金额	938,476.98
二、清算结束日 2024 年 5 月 8 日基金净资产	27,244,992.58

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，基金财产清算小组将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（基金管理人代为支付的部分除外）、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。同时，《基金合同》“第八部分 基金合同当事人及权利义务”中“三、基金份额持有人”项下约定：“同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。”基金财产将按照上述分配原则进行分配。

本基金清算起始日 2024 年 2 月 27 日至基金财产清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分将由基金管理人国联基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，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利息结清后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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，将报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金〉的法律意见》。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

国联产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年5月13日