

# 国都智能制造混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

报告出具的时间：2020年12月24日

报告公告的时间：2020年12月31日

## 1 重要提示

国都智能制造混合型发起式证券投资基金（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”）《关于准予国都智能制造混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]933号文）批准，由国都证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国都智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2017年9月29日生效。本基金为混合型发起式证券投资基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为47,418,554.98份基金单位，其中认购资金利息折合2,828.33份基金单位。

本基金的基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。根据《国都智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》第五部分“基金备案”中的约定“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值规模低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”

因此本基金根据基金合同约定进入基金财产清算程序，而不需召开基金份额持有人大会。

基金管理人于2020年9月30日发布了《关于国都智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于同日进入清算程序，以2020年9月30日为基金开始清算日。

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金财产清算小组由基金管理人国都证券股份有限公司、基金托管人广发银行股份有限公司、中审华会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成，并于2020年9月30日成立。其中，基金管理人的授权代表为薛志宏、赵楠、王实、张崴；基金托管人的授权代表为王妍；中审华会计师事务所会计师为黄庆林、尚国海；上海市通力律师事务所律师为黎明、陆奇。

本基金财产清算小组根据相关法律法规履行清算程序。本基金清算期结束日为2020年12月24日。

## 2 基金产品概况

基金名称	国都智能制造混合型发起式证券投资基金
基金简称	国都智能制造
基金主代码	004935
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月29日
运作期期末基金份额总额	11,062,194.60份
投资目标	本基金投资于智能制造相关标的，力求把握中国实施制造强国战略的发展契机，紧追制造升级的高速发展趋势，在严格控制风险的前提下，努力获取超过业绩比较基准的收益，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金跟踪和分析宏观经济数据，通过定性与定量分析，对经济形势及未来发展趋势进行判断，同时，结合资本市场所处环境，最终形成大类资产配置决策。</p> <p>（1）宏观经济形势及国家政策的变化对资本市场影响深远。本基金将跟踪国家货币政策、财政政策、税收政策，以及CPI、PPI、PMI等各类宏观经济指标，构建宏观经济分析框架；（2）基于对宏观经济形势的判断，甄选具备投资机会的资产方向。（3）在各类资产预期收益率及风险分析的基础上，结合本基金的投资收益目标和风险控制要求，确定各大类资产的投资范围及配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>1) 行业投资策略</p> <p>制造业是国民经济的主体，是立国之本、兴国之器、强国之基。打造具有国际竞争力的制造业，尤其是具备</p>

	<p>高技术和高速发展特征的智能制造业，是我国提升综合国力、保障国家安全、建设世界强国的必由之路。未来三个十年，是我国实施制造业强国战略的关键时期，智能制造业蕴含着丰富的投资机会，尤其是在智能制造领域的价值，本基金将重点挖掘并进行主要配置。本基金所定义的中国智能制造主题包含以下方面：</p> <p>（1）智能装备、信息技术及高端装备等，包括机器人、无人机、人工智能技术、自动化技术、超级计算机、海洋工程装备、核电装备、环保清洁能源设备、先进轨道交通装备、电力装备、国防军工及相关产业、新材料技术、医疗器械，以及其他代表行业前沿科技和应用方向的装备制造业；</p> <p>（2）与信息技术相结合，制造业相关的新业态，包括工业互联网、能源互联网、车联网、无人驾驶、智能物流、智能仓储等；</p> <p>（3）向智能化、高端化转型升级的传统制造业，包括家用电器、汽车、化工、有色金属、食品饮料、纺织服装、生物医药、农林牧渔等。</p> <p>随着技术进步及行业发展，智能制造主题的外延将不断扩大，本基金将根据实际情况对符合投资理念的领域及标的进行动态调整，并在招募说明书中更新。</p> <p>2) 个股选择</p> <p>本基金通过定量与定性分析相结合的方式，筛选兼具估值吸引力与业绩成长性的优质标的。</p> <p>定量分析主要是根据公司财务数据和业务量数据来综合考量公司的盈利能力、风险状况，主要指标包括资产与负债比率、现金充足率、成本与利润增长率、毛利率变动等。定性分析主要是结合宏观、行业的发展态势，分析公司所处环境的竞争格局、未来趋势，进而判</p>
--	---

	<p>断公司未来的成长性、可持续性及其投资价值。</p> <p>具体到标的的筛选，对于估值便宜且未来成长性良好的公司，将纳入核心股票池进行重点配置；对于未来成长性良好但估值已经充分反映的公司，以及估值便宜但未来成长性不足的标的，将保持密切关注和跟踪，等待基本面的转变或更好的配置时机；对于估值高且成长性不佳的公司，不予配置。</p> <p>3、固定收益投资策略</p> <p>固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。</p> <p>本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>基金管理人的债券研究团队会密切关注通胀、利率、期限、流动性、税收等因素，实时的确定各债券品种的公允价值。通过配置不同类别和期限的债券品种，达到债券组合的收益率目标。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金的股指期货投资以套期保值为目的，将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资</p>
--	---

	<p>资产支持证券。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。</p>
业绩比较基准	中证装备产业指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司

### 3 基金运作情况概述

国都智能制造混合型发起式证券投资基金（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”）《关于准予国都智能制造混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]933号文）批准，由国都证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国都智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2017年9月29日生效。本基金为混合型发起式证券投资基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为47,418,554.98份基金单位，其中认购资金利息折合2,828.33份基金单位。2017年9月29日至2020年9月29日期间，本基金按基金合同正常运作。

### 4 财务报表

#### 4.1 资产负债表

会计主体：国都智能制造混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020年9月29日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2020年9月29日
<b>资产：</b>	
银行存款	2,632,485.65
结算备付金	
存出保证金	50,200.56
交易性金融资产	10,230,969.89
其中：股票投资	9,744,476.43
债券投资	486,493.46
资产支持证券投资	
基金投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	1,952.29
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产合计：	12,915,608.39
负债和所有者权益	
<b>负债：</b>	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	37,229.87
应付管理人报酬	15,891.73
应付托管费	1,589.15
应付销售服务费	
应付交易费用	201.58
应付税费	4.87
应付利息	
应付利润	
其他负债	52,377.81
负债合计	107,295.01
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	11,062,194.60
未分配利润	1,746,118.78

所有者权益合计	12,808,313.38
---------	---------------

#### 4.2 利润表

会计主体：国都智能制造混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年9月29日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 9月29日
<b>一、收入</b>	<b>5,419,732.57</b>
1.利息收入	50,297.55
其中:存款利息收入	37,792.76
债券利息收入	12,504.79
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	
2.投资收益（损失以“-”填列）	17,587,699.66
其中:股票投资收益	15,509,857.74
基金投资收益	
债券投资收益	1,979,762.64
资产支持证券投资收益	
贵金属投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	98,079.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-12,351,784.69
4.其他收入（损失以“-”号填列）	133,520.05
<b>减：二、费用</b>	<b>961,463.05</b>
1. 管理人报酬	482,791.66
2. 托管费	48,279.17
3. 销售服务费	
4. 交易费用	377,970.36
5. 利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
6.税金及附加	44.05
7.其他费用	52,377.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>4,458,269.52</b>
减：所得税费用	
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>4,458,269.52</b>

注：本报告期的基金财务会计报告经中审华会计师事务所审计，注册会计师黄庆林、尚国海签字出具了CAC专字[2020]2642号标准无保留意见的审计报告。



## 5 基金财产分配

本基金于 2020 年 9 月 30 日进入清算期。

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。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。

自 2020 年 9 月 30 日至 2020 年 12 月 24 日止的清算期间，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：

### 5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 2,632,485.65 元，截止至 12 月 20 日银行存款净流入人民币 10,722,833.60 元，12 月 20 日余额为人民币 13,355,319.25 元，12 月 21 日银行结息，清算结束日银行存款余额应为 12 月 20 日银行存款余额与银行实际结息金额的合计，为人民币 13,374,008.88 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金余额为 50,200.56 元，已于清算期全部调回托管户，清算结束日存出保证金余额为零。

5.1.3 本基金最后运作日 2020 年 9 月 29 日应收利息余额为人民币 1,952.29 元，其中，应收银行存款利息为人民币 495.03 元，应收结算保证金利息为人民币 20.34 元，应收债券利息为人民币 1,436.92 元；

清算期间计提应收债券利息人民币 76.43 元，收到债券利息人民币 1,513.35 元，计提结算保证金利息人民币 51.58 元，截止到 12 月 20 日（含）新增计提应收银行存款利息人民币 18,122.94 元；12 月 20 日应收利息余额为人民币 18,689.89 元。

12 月 21 日银行结息，银行存款和结算保证金结息金额以实际收到金额为准，有可能与计提金额产生尾差；且从 12 月 21 日到清算结束日预计会产生应收银行存款利息 1,069.92 元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并划入托管账户。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。

5.1.4 本基金最后运作日交易型金融资产为 10,230,969.89 元，其中股票投资 9,744,476.43 元，债券投资为 486,493.46 元。截至清算结束日，股票投资和债券投资资产余额为零。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 37, 229.87 元，均于清算期间支付，清算结束日应付赎回款余额为零。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 15, 891.73 元，均于清算期间支付，清算结束日应付管理人报酬余额为零。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1, 589.15 元，均于清算期间支付，清算结束日应付托管费余额为零。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 201.58 元，均于清算期间支付，清算结束日应付交易费用余额为零。

5.2.5 本基金最后运作日应交税费人民币 4.87 元，于清算期间支付，清算结束日应付交易费用余额为零。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币 52, 377.81 元，除审计费外其他均于清算期间支付，清算结束日其他负债余额为人民币 13, 000.00 元，该款项预计于清算结束后凭发票支付，随后将剩余财产分配给份额持有人。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2020年9月30日(基金开始清算日)至 2020年12月24日(基金结束清算日)止期间
一、资产处置损益	597, 436. 41
1. 利息收入	19, 318. 62
其中：存款利息收入	19, 192. 86
存出保证金利息收入	51. 58
债券利息收入	74. 18
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3, 162, 697. 87
其中：股票投资收益	3, 048, 079. 23

债券投资收益	117,955.55
股利收入（股息红利税）	-3,336.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,584,607.46
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	27.38
二、清算费用	36,367.98
1. 交易费用	20,745.51
2. 税金	0.28
3. 其他费用	15,622.19
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	561,068.43

注：1、此处的其他收入为赎回费收入。

2、存款利息收入含 12 月 21 日至 12 月 24 日预估银行存款利息人民币 1,069.92 元。

#### 5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2020年9月29日基金净资产	12,808,313.38
加：清算期间净收益	561,068.43
加：基金最后运作日客户赎回申请	-7,302.75
二、清算期结束日2020年12月24日基金净资产	13,362,079.06

注：2020年9月29日（基金最后运作日）本基金收到客户赎回申请，赎回份额为6,307.44份，赎回申请日单位净值为1.1578元，2020年9月30日确认赎回金额全额为7,302.75元。根据《基金合同》第六部分基金份额的申购与赎回中约定：“赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产，具体比例详见招募说明书，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费，其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产”，本基金赎回费用27.38元归入基金财产；2020年10月9日，本基金划付7,275.37元至客户账户。

资产处置及负债清偿后，本基金清算期结束日 2020 年 12 月 24 日的剩余财产为人民币 13,362,079.06 元。自清算期结束日次日起至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付并划入托管账户。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。

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。后续由于清算支付过程中所产生的划款手续费由剩余资产承担。

### 5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金管理人审核、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。

## § 6 备查文件

### 6.1 备查文件目录

- 1、国都智能制造混合型发起式证券投资基金财务报表及审计报告
- 2、关于《国都智能制造混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

### 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 6.3 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，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人客服热线 400-818-8118。

国都智能制造混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2020 年 12 月 24 日