

融通核心趋势混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022年4月20日

公告日期：2022年4月26日

一、重要提示

融通核心趋势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证监许可[2021]242号《关于准予融通核心趋势混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，本基金的基金合同生效日为2021年5月25日。基金管理人为融通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《融通核心趋势混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人应当按照基金合同的约定程序进行基金财产清算并终止基金合同，不需要召开基金份额持有人大会”，截至2022年4月12日日终，本基金资产净值出现连续50个工作日低于5000万元的情形，为保护投资者利益，基金管理人将按照基金合同约定程序对本基金进行清算并终止基金合同，且不需要召开基金份额持有人大会。本基金管理人已于2022年4月13日在《中国证券报》和基金管理人网站上刊登了《关于融通核心趋势混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，具体详见基金管理人相关公告。

本基金最后运作日为2022年4月12日，自2022年4月13日（最后运作日的次日）起，本基金进入清算程序，由基金管理人融通基金管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和北京大成（上海）律师事务所于2022年4月13日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，北京大成（上海）律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	融通核心趋势混合型证券投资基金
基金简称	融通核心趋势混合
基金主代码	011595
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年5月25日

基金最后运作日（2022-4-12） 基金份额总额	6,306,231.93 份	
投资目标	在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，精选优质证券进行中长期投资，力争实现基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证香港 100 指数收益率×20%+中债综合全价（总值）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，低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通核心趋势混合 A	融通核心趋势混合 C
下属分级基金的交易代码	011595	011596
基金最后运作日（2022-4-12） 基金份额总额	4,078,900.67 份	2,227,331.26 份

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：融通核心趋势混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 4 月 12 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	2022 年 4 月 12 日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	7,321,191.97
结算备付金	36,462.18
存出保证金	72,055.78
交易性金融资产	92,264.10
资产总计：	7,521,974.03
负债和所有者权益	2022 年 4 月 12 日(基金最后运作日)
负债：	
应付赎回款	2,672,735.61
应付管理人报酬	6,537.85
应付托管费	1,089.64

应付销售服务费	443.08
其他负债	86,590.83
负债合计:	2,767,397.01
所有者权益:	
实收基金	6,306,231.93
未分配利润	-1,551,654.91
所有者权益合计:	4,754,577.02
负债与持有人权益总计:	7,521,974.03

注: 报告截止日为 2022 年 4 月 12 日(基金最后运作日), 基金份额总额为 6,306,231.93 份; 其中融通核心趋势混合 A 基金份额总额为 4,078,900.67 份, 基金份额净值 0.7551 元; 融通核心趋势混合 C 基金份额总额为 2,227,331.26 份, 基金份额净值 0.7518 元。

四、清算情况

自 2022 年 4 月 13 日至 2022 年 4 月 19 日止为本基金第一次清算报告期间, 基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算, 具体清算情况如下:

1、清算费用

按照《融通核心趋势混合型证券投资基金基金合同》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剩余财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 7,321,191.97 元(含银行存款应收利息人民币 1,583.62 元), 该款项由基金托管人负责保管;

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 36,462.18 元(含结算备付金应收利息人民币 89.36 元), 该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管;

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 72,055.78 元(含存出保证金应收利息人民币 89.84 元), 该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管;

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产全部为股票, 股票市值为人民币 92,264.10 元, 该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和, 本基金最后运作日(2022 年 4 月 12 日)持有的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	估值价格 (人民币元/股)	最后运作日估值金额 (人民币元)
1	688212	澳华内镜	1,188.00	43.65	51,856.20
2	000552	靖远煤电	8,897.00	3.90	34,698.30

3	603051	鹿山新材	104.00	54.90	5,709.60
合计					92,264.10

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 2,672,735.61 元, 该款项于约定支付日划出;

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 6,537.85 元, 该款项将于实际支付时扣除;

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,089.64 元, 该款项将于实际支付时扣除;

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 443.08 元, 该款项将于实际支付时扣除;

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 86,590.83 元, 其中:

应付销售费合计为人民币 11,744.41 元, 该款项于实际支付时扣除;

应付交易费用为人民币 12,846.42 元, 该款项于实际支付时扣除;

应付审计费为人民币 40,000.00 元, 该款项于实际支付时扣除;

应付信息披露费为人民币 22,000.00 元, 该款项于实际支付时扣除。

4、第一次清算期间的剩余资产情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、基金最后运作日 2022 年 4 月 12 日基金净资产	4,754,577.02
加: 清算期间 (2022 年 4 月 13 日至 2022 年 4 月 19 日) 收入	360.86
利息收入-银行存款利息收入	326.70
利息收入-结算备付金利息收入	11.48
利息收入-存出保证金利息收入	22.68
加: 公允价值变动	1,948.32
减: 清算期间 (2022 年 4 月 13 日至 2022 年 4 月 19 日) 支付款项	783,055.29
支付赎回款	779,526.65
支付销售费	3,450.17
支付交易费用	4.78
银行汇划费	73.69
减: 清算期间 (2022 年 4 月 13 日至 2022 年 4 月 19 日) 股票差价收入	473.70
二、2022 年 4 月 19 日基金净资产	3,973,357.21
三、第一次清算划付金额	3,750,000.00

注: (1) 第一次清算款划付金额以截至本次清算结束日已变现情况为基准划付。

(2) 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。由于本基金截至第一次清算期结束日(2022年4月19日)持有未变现股票,本基金将根据变现情况进行后续清算流程,并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、本次清算结束日(2022年4月19日)金融资产为人民币88,502.82元,具体明细如下:

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	估值价格 (人民币元/股)	本次清算结束日估值金额 (人民币元)	备注
1	688212	澳华内镜	1,188.00	45.29	53,804.52	首发流通受限
2	000552	靖远煤电	8,897.00	3.90	34,698.30	重大事项停牌
合计					88,502.82	

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,并经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见后,报监管备案并向基金份额持有人公告。

五、备查文件

1、备查文件目录

(1) 融通核心趋势混合型证券投资基金2022年1月1日至2022年4月12日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 北京大成(上海)律师事务所关于《融通核心趋势混合型证券投资基金清算报告》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。

基金管理人: 融通基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

2022年4月20日