

国联创业板两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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年10月28日

清算报告公告日：2024年11月14日

一、重要提示及目录

1、重要提示

国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“国联创业板两年定开混合”)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〕1372号文《关于准予中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)向社会公开发行募集,基金合同于2020年8月21日生效,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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日起更名为国联创业板两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》、《国联创业板两年定期开放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》”)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、基金份额持有人人数少于200人。

截至2024年9月25日终(即本基金第二个开放期最后一日),本基金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,已触发基金合同终止的上述情形。根据《基金合同》约定,本基金管理人依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算并终止基金合同,无需召开基金份额持有人大会。

本基金最后运作日为2024年9月25日,自2024年9月26日起进入清算程序。由基金管理人国联基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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.....	6
五、清算情况	6
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：国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金
- 2、基金简称：国联创业板两年定开混合（基金代码：168207）
- 3、基金运作方式：契约型定期开放式
- 4、基金合同生效日：2020年8月21日
- 5、2024年9月25日（基金最后运作日）基金份额总额：48,972,982.19份
- 6、投资目标：本基金在控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
- 7、投资策略：（一）封闭期投资策略：（1）资产配置策略（2）战略配售股票投资策略（3）股票投资策略（4）港股通投资策略（5）债券投资策略（6）衍生品投资策略（7）资产支持证券投资策略（8）融资交易策略（9）参与转融通证券出借业务策略；（二）开放期投资策略。
- 8、业绩比较基准：创业板指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×25%
- 9、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。
- 10、基金管理人：国联基金管理有限公司
- 11、基金托管人：交通银行股份有限公司
- 12、基金份额上市的证券交易所：深圳证券交易所

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金

最后运作日：2024年9月25日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2024年9月25日
资产：	
货币资金	1,452,682.80
结算备付金	18,296.68
存出保证金	10,383.24

交易性金融资产	34,459,344.84
其中：股票投资	31,435,319.36
债券投资	3,024,025.48
应收申购款	509.24
应收清算款	1,742,148.52
资产总计	37,683,365.32
负债：	
应付赎回款	3,472,229.70
应付管理人报酬	32,439.91
应付托管费	5,406.65
其他负债	133,587.61
负债合计	3,643,663.87
净资产：	
实收基金	48,972,982.19
未分配利润	-14,933,280.74
净资产合计	34,039,701.45
负债及净资产总计	37,683,365.32

四、清算事项说明

1、基本情况

国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金(原名为中融创业板两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]1372号文《关于准予中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》发起，于2020年8月21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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交

易可转债的纯债部分等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)以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:创业板指数收益率 \times 70%+恒生指数收益率 \times 5%+中债综合指数收益率 \times 25%。

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》、《国联创业板两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9月25日终(即本基金第二个开放期最后一日),本基金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,已触发基金合同终止的情形。根据《基金合同》约定,本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》约定2024年9月25日为本基金最后运作日,本基金于2024年9月26日进入清算期,故本基金清算起始日为2024年9月26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(2024年9月25日)起,资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自2024年9月26日至2024年10月9日止为本基金清算报告期,自清算起始日起,本基金成立基金财产清算小组,并对本基金的资产、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) 本基金最后运作日货币资金为人民币 1,452,682.80 元，其中活期存款为人民币 1,452,570.37 元，应计利息为人民币 112.43 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 18,296.68 元，其中应计利息为人民币 4.10 元。存出保证金为人民币 10,383.24 元，其中应计利息为人民币 2.35 元，存出保证金已于清算期间转入托管账户人民币 10,380.89 元。

(3) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 1,742,148.52 元，该款项已于清算期间转入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 509.24 元，该款项已于清算期间转入托管账户。

(5) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 34,459,344.84 元，其中股票投资人民币 31,435,319.36 元，债券投资人民币 3,024,025.48 元，本基金已于清算期间卖出所有可流通股票、债券。

截止清算结束日，本基金持有的股票投资为人民币 12,284.16 元，为本基金持有的处于限售期的股票投资，本基金将于该类股票解除限售后及时进行变现。明细如下：

单位：人民币元

证券代码	证券名称	数量（股）	清算结束日 (2024年10月9日) 估值单价	清算结束日 (2024年10月9日) 估值总额
301565	中仑新材	152	19.27	2,929.04
301580	爱迪特	39	63.20	2,464.80
301603	乔锋智能	58	40.16	2,329.28
301606	绿联科技	74	29.17	2,158.58
301552	科力装备	54	44.49	2,402.46

注：流通受限股票清算结束日估值金额与实际变现金额可能存在差异，实际变现金额存在不确定性。待该类股票解除限售后，本基金管理人将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 3,472,229.70 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人民币 32,439.91 元，该款项将于清算审计完成后从托管账户划出。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 5,406.65 元，该款项将于清算审计完成后从托管账户划出。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 133,587.61 元，其中应付赎回费为人民币 22.17 元，该款项已于清算期间支付；应付交易费用为人民币 45,069.26 元，该款项将于 2024 年 4 季度支付；应付律师费为人民币 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；应付审计费为人民币 14,698.16 元，该款项将于清算审计完成后从托管账户划出；应付信息披露费为人民币 58,798.02 元，该款项将于取得信息披露费发票后从托管账户划出。

3、净资产情况

最后运作日基金净资产人民币 34,039,701.45 元，基金份额总额为 48,972,982.19 份；清算结束日基金净资产为人民币 32,795,844.96 元，基金份额总额为 47,474,715.72 份。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算期（2024 年 9 月 26 日至 2024 年 10 月 9 日） 发生额
一、清算期间收入	
1、利息收入（注 1）	3,904.22
2、赎回费收入	3,456.56
3、投资收益（损失以“-”号填列）（注 2）	-2,808,651.05
4、公允价值变动损益（损失以“-”填列）（注 3）	2,599,003.58
清算期间收入小计	-202,286.69
二、清算期间费用	
1、汇划费	124.77
清算期间费用小计	124.77
三、清算净收益（清算净损失以“-”表示）	-202,411.46

注 1：利息收入包括本基金自清算起始日 2024 年 9 月 26 日至 2024 年 10 月 9 日形成的银行存款利息收入人民币 3,886.63 元、备付金利息收入人民币 11.48 元、保证金利息收入人民币 6.11 元，共计人民币 3,904.22 元。

注 2：投资收益为 2024 年 9 月 26 日至 2024 年 10 月 9 日的清算期间的股票和债券投资收益、股

票红利收入以及交易所市场交易费用等。

注 3：公允价值变动损益为最后运作日未变现股票在 2024 年 9 月 26 日至 2024 年 10 月 9 日产生的公允价值变动，以及清算期间处置持有股票投资时，将原计入该股票投资的公允价值变动转出至投资收益的金额。

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 9 月 25 日基金净资产	34,039,701.45
加：清算期间净收益（净损失以“-”表示）	-202,411.46
加：清算期间确认的申购款	201,707.44
减：清算期间确认的赎回款及赎回费（含赎回费收入）（注）	1,243,152.47
二、清算结束日 2024 年 10 月 9 日基金净资产	32,795,844.96

注：清算期间确认的申购款为 2024 年 9 月 25 日投资者提交的申购申请，清算期间确认的赎回款及赎回费为 2024 年 9 月 25 日投资者提交的赎回申请。

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、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。

由于本基金截至清算期结束日（2024 年 10 月 9 日）所持限售股票尚未解禁，本基金将于未变现资产全部变现后，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。

本基金清算起始日 2024 年 9 月 26 日至基金财产分配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。如前述利息和存出保证金在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）和未返还的存出保证金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，将与会计师事务所出具的审计报告、律师事务

所出具的法律意见书，一并报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈国联创业板两年定期开放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。

国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年10月28日