（上接B080版）

特定是指某类或某个信用产品具有某种特别的特点，这种特点会造成此类信用产品的价值被高估或者低估。特定跟踪策略，就是要根据特定信用产品的特定特点，进行跟踪和选择。在所有的信用产品中，寻找在持有期内级别上调可能性比较大的产品，并进行配置；对在持有期内级别下调可能性比较大的产品，要进行规避。判断的基础就是对信用产品进行持续内部跟踪评级及对信用评级要素进行持续跟踪与判断，简单的做法就是跟踪特定事件：国家特定政策及特定事件变动态势、行业特定政策及特定事件变动态势、公司特定事件变动态势，并对特定政策及事件对于信用产品的级别变化影响程度进行评估，从而决定对于特定信用产品的取舍。

2）相对价值策略

本策略的宗旨是要找到价值被低估的信用产品。属于同一个行业、类属同一个信用级别且具有相近期限的不同债券，由于息票因素、流动性因素及其他因素的影响程度不同，可能具有不同的收益水平和收益变动趋势，对同类债券的利差收益进行分析，找到影响利差的因素，并对利差水平的未来走势做出判断，找到价值被低估的个券，进而相应地进行债券置换。本策略实际上是某种形式上的债券互换，也是寻求相对价值的一种投资选择策略。

这种投资策略的一个切实可行的操作方法是：在一级市场上，寻找并配置在同等行业、同等期限、同等信用级别下拥有较高票面利率的信用产品；在二级市场上，寻找并配置同等行业、同等信用级别、同等票面利率下具有较低二级市场信用溢价（价值低估）的信用产品并进行配置。

3）数量化选择策略（骑乘策略）

债券投资的另外一个可利用的策略就是骑乘策略，也就是当收益率曲线比较陡峭时，买入收益率处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑而获得资本利得收益。

通过运用数量化投资选择策略，来对个券进行选择。考虑到骑乘策略，国泰基金通过ROLL-DOWN模型等数量化工具来选择相对价值低估的个券，并通过凸性分析选择波动特性最优的单个产品。

（4）中小企业私募债投资策略

利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合Z-Score、KMV等数量分析模型，测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异，根据自上而下的宏观经济及行业特性分析，从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异，结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。

3、股票投资策略

本基金适当投资于股票市场，以强化组合获利能力，提高预期收益水平。本基金股票投资以价值选股、组合投资为原则，通过选择高流动性股票，保证组合的高流动性；通过选择具有高安全边际的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资，降低个股风险与集中性风险。

本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选取主业清晰，具有持续的核心竞争力，管理透明度较高，流动性好且估值具有高安全边际的个股构建股票组合。

4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较标准为：一年期银行定期存款税后收益率 + 0.5%

本基金选择该业绩比较基准的原因如下：

本基金在满足分红条件的情况下，将定期为投资者分配收益。该机制体现了本基金追求绝对收益、为投资者实现稳定定期回报的理念。因此，本基金采用一年期银行定期存款税后收益率 + 0.5%作为业绩比较基准也正是本基金追求绝对收益的体现。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒体上予以公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2018年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	16,316,674.96	4.52
	其中：股票	16,316,674.96	4.52
2	固定收益投资	324,494,406.00	89.83
	其中：债券	324,494,406.00	89.83
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	14,563,778.89	4.03
7	其他各项资产	5,846,896.70	1.62
8	合计	361,221,756.55	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	16,316,674.96	5.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	16,316,674.96	5.45

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	69,600	3,807,120.00	1.27
2	300274	阳光电源	141,722	2,718,227.96	0.91
3	002035	华帝股份	86,700	2,268,072.00	0.76
4	000921	海信科龙	130,200	1,594,950.00	0.53
5	300296	利亚德	61,800	1,552,416.00	0.52
6	600056	中国医药	62,600	1,488,002.00	0.50
7	000910	大亚圣象	60,100	1,212,818.00	0.41
8	002572	索菲亚	27,900	956,133.00	0.32
9	002798	帝王洁具	11,200	582,736.00	0.19
10	000568	泸州老窖	2,400	136,200.00	0.05

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	14,718,000.00	4.92
2	央行票据	–	–
3	金融债券	20,008,000.00	6.68
	其中：政策性金融债	20,008,000.00	6.68
4	企业债券	185,297,559.00	61.91
5	企业短期融资券	50,186,000.00	16.77
6	中期票据	49,458,000.00	16.52
7	可转债（可交换债）	4,826,847.00	1.61
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	324,494,406.00	108.41

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	041756005	17国泰租赁CP001	300,000	30,132,000.00	10.07
2	122448	15龙光02	300,000	29,892,000.00	9.99
3	101552013	15华润MTN001	300,000	29,478,000.00	9.85
4	112481	16广联01	300,000	29,238,000.00	9.77
5	136753	16大华02	300,000	28,863,000.00	9.64

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人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。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（十）本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,194.55
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,742,705.67
5	应收申购款	95,996.48
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,846,896.70

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113012	骆驼转债	83,352.90	0.03
2	110031	航信转债	11,437.80	0.00
3	132007	16凤凰EB	749,332.80	0.25
4	132003	15清控EB	36,737.30	0.01

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2017年12月31日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

国泰民安增利债券基金A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年12月26日至2012年12月31日	0.10%	0.05%	0.06%	0.01%	0.04%	0.04%
2013年度	-0.20%	0.13%	3.50%	0.01%	-3.70%	0.12%
2014年度	21.52%	0.22%	3.47%	0.01%	18.05%	0.21%
2015年度	13.59%	0.29%	2.62%	0.01%	10.97%	0.28%
2016年度	2.59%	0.14%	2.00%	0.01%	0.59%	0.13%
2017年度	2.50%	0.06%	2.00%	0.01%	0.50%	0.05%
2012年12月26日至2017年12月31日	45.00%	0.19%	13.65%	0.01%	31.35%	0.18%

国泰民安增利债券基金C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年12月26日至2012年12月31日	0.10%	0.05%	0.06%	0.01%	0.04%	0.04%
2013年度	-0.70%	0.13%	3.50%	0.01%	-4.20%	0.12%
2014年度	20.93%	0.22%	3.47%	0.01%	17.46%	0.21%
2015年度	13.54%	0.29%	2.62%	0.01%	10.92%	0.28%
2016年度	2.23%	0.14%	2.00%	0.01%	0.23%	0.13%
2017年度	2.07%	0.06%	2.00%	0.01%	0.07%	0.05%
2012年12月26日至2017年12月31日	42.41%	0.19%	13.65%	0.01%	28.76%	0.18%

十三、基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、销售服务费：本基金从C类基金份额的基金资产中计提销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.7%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“（一）基金费用的种类中第4－9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2018年2月8日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；

2、更新了“一、绪言”中的相关信息；

3、更新了“二、释义”中的相关信息；

4、更新了“三、基金管理人”中的相关信息；

5、更新了“四、基金托管人”中的相关信息；

6、更新了“五、相关服务机构”中的相关信息；

7、更新了“八、基金份额的申购与赎回”中的相关信息；

8、更新了“九、基金的投资”中基金投资组合报告，为本基金2018年1季度报告的内容；

9、更新了“十、基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核；

10、更新了“十二、基金资产的估值”中的相关信息；

11、更新了“十六、基金的信息披露”中的相关信息；

12、更新了“十七、风险揭示”中的相关信息；

13、更新了“二十、托管协议的内容摘要”中的相关信息；

14、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中的相关信息；

15、更新了“二十二、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇一八年八月九日

国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2018年8月9日

1. 公告基本信息

基金名称	国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国泰价值精选灵活配置混合
基金主代码	005726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月8日
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		证监许可【2018】334号
基金募集期间		自2018年7月16日至2018年8月3日止
验资机构名称		普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
募集资金划入基金托管专户的日期		2018年8月7日
募集有效认购总户数（单位：户）		5,545
募集期间净认购金额（单位：元）		314,537,559.62
认购资金在募集期间产生的利息（单位：元）		98,550.03
募集份额（单位：份）	有效认购份额	314,537,559.62
	利息结转的份额	98,550.03
	合计	314,636,109.65
其中：募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	0
	占基金总份额比例	0
	其他需要说明的事项	无
其中：募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	1,369,416.80
	占基金总份额比例	0.4352%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2018年8月8日

注：1、本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

2、本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人认购本基金份额总量的数量区间为0至10万份（含）；本基金的基金经理认购本基金份额总量的数量区间为100万份以上。

3. 其他需要提示的事项

自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

基金份额持有人可以到销售机构的网点查询交易确认情况，也可以通过本基金管理人的网站（www.gtfund.com）或客户服务电话（400-888-8688）查询交易确认情况。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

风险提示：基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读该基金的《基金合同》、更新的《招募说明书》，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告

国泰基金管理有限公司

二零一八年八月九日

国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换业务并开展费率优惠活动的公告

公告送出日期：2018年8月9日

1 公告基本信息

基金名称	国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国泰宁益定期开放灵活配置混合	
基金主代码	003760	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月1日	
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司	
基金托管人名称	宁波银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	国泰基金管理有限公司	
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2018年8月14日	
赎回起始日	2018年8月14日	
转换转入起始日	2018年8月14日	
转换转出起始日	2018年8月14日	
下属分级基金的基金简称	国泰宁益定期开放灵活配置混合A	国泰宁益定期开放灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	003760	003761
该分级基金是否开放申购、赎回、转换业务	是	是

注：根据本基金《基金合同》和《招募说明书》的相关规定，2018年8月14日起（含）至2018年9月10日（含）期间的工作日为本基金申购、赎回、转换业务开放期。自2018年9月11日至2019年3月10日止，为本基金的第三个封闭期，封闭期内本基金不办理申购、赎回、转换或其他业务。

2 日常申购、赎回业务的办理时间

本基金自基金合同生效日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）6个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起（包括该日）至6个月后的对应日前一日（包括该日）的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至6个月后的对应日前一日（包括该日）的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期，则对应日调整至该对应日所在月度的最后一日；如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

本基金自基金合同生效后，每6个月开放一次申购和赎回。一般情况下，本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。

本基金第二个封闭期为2018年2月14日起至2018年8月13日。根据本基金《基金合同》、《招募说明书》的规定，本基金管理人决定自2018年8月14日起（含）至2018年9月10日（含）期间的工作日，本基金接受投资者的申购、赎回及转换业务。自2018年9月11日至2019年3月10日止，为本基金的第三个封闭期，封闭期内本基金不办理申购、赎回、转换或其他业务。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间。

本基金开放期内，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，也不上市交易。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3 日常申购业务

3.1申购金额限制

投资人单笔申购的最低金额为1.00元（含申购费）。

本基金管理人的直销机构单笔申购的最低金额为10.00元（含申购费）。除直销机构以外的其他销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

3.2申购费用

本基金基金份额分为A类和C类基金份额。投资人在申购A类基金份额时支付申购费用，申购C类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额的申购费率具体如下：

申购金额（M）	申购费率
M＜1000万	0.60%
M≥1000万	按笔收取，1000元/笔

申购费用由申购本基金A类基金份额的申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

3.3其他与申购相关的事项

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金持续营销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率。

4 日常赎回业务

4.1赎回份额限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份数为1.00份，若某基金份额持有人赎回时在销售机构保留的基金份额不足1.00份，则该次赎回时必须一起赎回。

本基金管理人的直销机构单笔赎回申请最低份数为10.00份，若某基金份额持有人赎回时在销售机构保留的基金份额不足10.00份，则该次赎回时必须一起赎回。本基金不对投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制。如除直销机构以外的其他销售机构对本基金最低赎回份额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4.2赎回费用

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。

本基金A类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30日但少于90日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于或等于90日但少于180日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于或等于180日的基金份额持有人不收取赎回费。赎回费中未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金A类基金份额的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.50%
7日≤Y＜30日	0.75%
30日≤Y＜180日	0.50%
Y≥180日	0.00%

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在注册登记机构的登记日开始计算。）

本基金C类基金份额对持续持有期少于一个封闭期的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产。其中，对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

本基金C类基金份额的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（Y）	赎回费率
在同一开放期内申购后又赎回且持续持有期少于7日	1.50%
在同一开放期内申购后又赎回的份额，持有期大于或等于7日	0.50%
认购或在非同一开放期申购后赎回的份额	0.00%

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在注册登记机构的登记日开始计算。）

4.3其他与赎回相关的事项

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金持续营销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金赎回费率。

5 日常转换业务

“基金转换业务” 是指投资者在某销售机构持有国泰基金管理有限公司（以下简称本基金管理人）管理的开放式基金基金份额后，可将其持有的基金份额直接转换成本基金管理人管理的且由同一销售机构销售的其他开放式基金基金份额，而不需要先赎回已持有的基金份额，再申购目标基金的一种业务模式。基金转换业务适用于所有已在同一销售机构购买本基金管理人所管理且担任注册登记机构的任一基金份额的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

5.1转换费用

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

5.1.1转入基金申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于或等于转入基金的申购费率的，补差费为零。

5.1.2转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

5.2其他与转换相关的事项

5.2.1国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金可支持转换本基金管理人旗下以下产品：

基金代码	基金名称
000199	国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金
000218	国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金（A类）
000362	国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金（A类）
000363	国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金（C类）
000367	国泰安康定期支付混合型证券投资基金（A类）
000511	国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金（A类）
000512	国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金（A类）
000526	国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金（A类）
000742	国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金
000953	国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金（A类）
000954	国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金（C类）
001265	国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金（A类）
001542	国泰互联网+股票型证券投资基金
001576	国泰智能装备股票型证券投资基金
001579	国泰大农业股票型证券投资基金
001626	国泰央企改革股票型证券投资基金
001645	国泰大健康股票型证券投资基金
001789	国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金
001790	国泰智能汽车股票型证券投资基金
001850	国泰安益灵活配置混合型证券投资基金（A类）
001922	国泰新目标收益保本混合型证券投资基金
002055	国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金（C类）
002059	国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金（C类）
002061	国泰安康定期支付混合型证券投资基金（C类）
002062	国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金（C类）
002063	国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金（C类）
002197	国泰鑫保本混合型证券投资基金
002204	国泰安心回报混合型证券投资基金
002458	国泰民利保本混合型证券投资基金
002489	国泰民福保本混合型证券投资基金
003457	国泰润泰纯债债券型证券投资基金
003515	国泰利是宝货币市场基金
003516	国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金
003517	国泰润利纯债债券型证券投资基金
003593	国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金
003689	国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金（A类）
003690	国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金（C类）
003754	国泰普益灵活配置混合型证券投资基金（A类）
003755	国泰普益灵活配置混合型证券投资基金（C类）
004101	国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金
004253	国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金（C类）
005095	国泰量化成长优选混合型证券投资基金（A类）
005096	国泰量化成长优选混合型证券投资基金（C类）
005115	国泰量化价值精选混合型证券投资基金（A类）
005116	国泰量化价值精选混合型证券投资基金（C类）
005244	国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金（A类）
005245	国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金（C类）
005246	国泰可转债债券型证券投资基金
005730	国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金
005819	国泰优势行业混合型证券投资基金
005867	国泰沪深300指数证券投资基金（C类）
020001	国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金
020002	国泰金龙债券证券投资基金（A类）
020003	国泰金龙行业精选证券投资基金
020005	国泰金马稳健回报证券投资基金
020007	国泰货币市场证券投资基金
020009	国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金
020010	国泰金牛创新成长混合型证券投资基金
020011	国泰沪深300指数证券投资基金（A类）
020012	国泰金龙债券证券投资基金（C类）
020015	国泰区位优势混合型证券投资基金
020018	国泰金鹿保本增值混合证券投资基金
020019	国泰双利债券证券投资基金（A类）
020020	国泰双利债券证券投资基金（C类）
020021	国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金
020022	国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金
020023	国泰事件驱动策略混合型证券投资基金
020026	国泰成长优选混合型证券投资基金
020031	国泰现金管理货币市场基金（A类）
020032	国泰现金管理货币市场基金（B类）
020033	国泰民安增利债券型发起式证券投资基金（A类）
020034	国泰民安增利债券型发起式证券投资基金（C类）
020035	国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A类）
020036	国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C类）
160211	国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)
160212	国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)
160215	国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
160217	国泰信用互利分级债券型证券投资基金
160218	国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金
160219	国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金
160220	国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(A类)
160221	国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金
160222	国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金
160223	国泰创业板指数证券投资基金（LOF）
160224	国泰深证TMT50指数分级证券投资基金
160225	国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）
160226	国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（C类）
501016	国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）
501017	国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
501019	国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）
519020	国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金(A类)
519021	国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金
519022	国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（C类）
519606	国泰金鑫股票型证券投资基金

注：（1）同一基金 A/C 类收费模式之间不可进行转换。

（2）上述表格内基金涉及跨TA转换业务仅限于通过本基金管理人直销柜台渠道办理。

5.2.2转换份额的计算公式

基金合同中无特殊约定基金的转换费用采用“转出和转入基金的申购费补差+转出基金的赎回费”算法，计算公式如下：

净转入金额＝B×C×（1－D）/（1+G）

转换补差费用＝【B×C×（1－D）/（1+G）】×G

转入份额＝净转入金额 / E

其中，B为转出的基金份额；

C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D为转出基金的对应赎回费率；

G为对应的申购补差费率，当转出基金的申购费率高于转入基金的申购费率时，则申购补差费率G为零；

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

例如：某基金份额持有人持有国泰金龙行业精选证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金，假设转换当日转出基金（国泰金龙行业）份额净值是1.200元，转入基金（国泰金鹰增长）份额净值是 1.300元，转出基金对应赎回费率为0.2%，转入基金申购补差费率为0.3%，则可得到的转换份额为：

净转入金额 ＝ 100,000×1.200×（1－0.2%）/（1+0.3%）＝119,401.79元

转换补差费用 ＝【100,000×1.200×（1－0.2%）/（1+0.3%）】×0.3% ＝358.21元

转入份额 ＝ 119,401.79 / 1.300=91,847.53份

即：某基金份额持有人持有国泰金龙行业精选证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金，假设转换当日转出基金份额净值是1.200元，转入基金的份额净值是1.300元，则可得到的转换份额为 91,847.53份。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

若遇上转出和转入基金的申购费一项为固定值，另一项为比例值，无法按差值进行计算，则申购费补差不再扣减原基金申购时已缴纳的1000元申购费。

5.3 基金转换的业务规则

①基金转换只能在同一销售机构办理，该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售，且拟转出基金及拟转入基金已在该销售机构开通转换业务。

②基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

③基金转换采取未知价法，即以申请受理当日转出、转入基金的基金份额净值为基础进行计算。

④正常情况下，基金注册登记机构将在 T+1日对投资者 T日的基金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构查询基金转换的确认情况。

⑤基金转换的最低申请为1.00份，各基金转换的最低申请份额详见相关公告及规定。如投资者在单个销售网点持有单只基金的份额低于规定时，需一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。本基金管理人的直销机构对本基金单笔转换的最低份额为100.00份。除直销机构以外的其他销售机构对本基金转出和转入基金最低转换份额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

⑥单个开放日基金净赎回份额及净转出申请份额之和超过上一开放日基金总份额的20%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。但巨额赎回按比例确认时，基金转换出的未确认份额，不做顺延赎回处理。

⑦持有人对转入基金的持有期限自转入确认之日起计算。

5.4暂停基金转换的情形及处理

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此暂停基金转换适用有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、赎回的有关规定。

5.5重要提示

①基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构销售的本基金管理人旗下管理的基金，且拟转出基金及拟转入基金已在该销售机构开通转换业务。

②本基金管理人旗下新发售基金的转换业务规定，以届时公告为准。

③通过本基金管理人网上交易平台办理基金转换业务的有关事项请参见本基金管理人公布的基金网上交易相关业务规则或公告等文件。

④本基金管理人有权根据市场情况或法律法规变化调整上述转换的程序及有关限制，在实施日前依照《信息披露管理办法》的有关规定，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

⑤本基金管理人旗下管理的基金的转换业务规则的解释权归本基金管理人所有。

6 基金销售机构

6.1直销机构

①国泰基金管理有限公司直销柜台

地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

传真：021-31081861 网址：www.gtfund.com

②国泰基金管理有限公司直销电子交易平台

投资者可通过国泰基金电子交易平台https://etrade.gtfund.com登录网上交易页面申购本基金，申购期内提供7×24小时申购服务。

智能手机APP平台：iphone交易客户端、Android交易客户端

“国泰基金”微信交易平台

电话：021-31081738 联系人：李静姝

6.2其他基金销售机构

深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司。

7 申购费率优惠

7.1直销柜台费率优惠

7.1.1适用对象及渠道

本活动适用于在本基金管理人直销柜台办理本基金的申购业务的投资者。

7.1.2费率优惠

自2018年8月14日起至2018年9月10日期间，投资者通过本基金管理人直销柜台办理本基金的申购业务，可享受申购费率1折优惠，优惠前申购费率固定费用的，则按原费率执行，不再享受相应费率优惠。

7.2其他销售机构费率优惠及具体规则

自2018年8月14日起至2018年9月10日期间，投资者通过除直销机构以外的其他销售机构申购本基金的，是否享受费率优惠、具体折扣费率及费率优惠活动期限以相关销售机构各自活动公告为准。

7.3重要提示

①本基金原费率标准详见本基金管理人网站发布的本基金《招募说明书》等法律文件，以及本基金管理人发布的最新业务公告。

②如本基金管理人新增通过以上渠道销售的基金，该基金是否同时参与相关费率优惠活动将另行公告。

③优惠活动期间，业务办理的流程以各销售机构的规定为准。投资者欲了解本基金产品的详细情况，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件。

④上述费率优惠活动仅适用于处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费，不包括基金的后端收费模式的申购手续费、转换手续费以及处于基金募集期的基金认购费，特殊情况以销售渠道出具的公告为准。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018年8月9日

国泰润享纯债债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

公告日期：2018年8月9日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰润享纯债债券型证券投资基金(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[2017]642号《关于准予国泰润享纯债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币220,056,770.92元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第1075号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年12月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为220,101,613.68份基金份额，其中认购资金利息折合44,842.76份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，基金管理人根据《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》的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。会议投票表决时间为2018年5月14日起至2018年6月13日17:00止。本次会议议案于2018年6月14日表决通过，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。基金管理人于2018年6月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。依据生效的基金份额持有人大会决议，本基金从2018年6月15日起进入清算期。

本基金清算期为2018年6月15日到2018年7月6日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人宁波银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2018年6月15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 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰润享纯债债券型证券投资基金
基金简称	国泰润享纯债债券
基金主代码	004665
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月13日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
2018年6月14日基金份额总额	4,618,360.33份

2.2 基金产品说明

投资目标	在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的投资策略包括久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购套利策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

2.3 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		国泰基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永梅	王海燕
	联系电话	021-31081600转	0574-89103171
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wanghaiyan@nbcb.cn
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95574
传真		021-31081800	0574-89103123
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码		200082	315100
法定代表人		陈勇胜	陆华裕

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

3.1 资产负债表

会计主体：国泰润享纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年6月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2018年6月14日（基金最后运作日）	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	5,714,341.69	220,155,688.81
结算备付金	–	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	–	–
其中：股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
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	103,053.34	322,187.28
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	5,817,395.03	220,477,876.09
负债和所有者权益	本期末 2018年6月14日（基金最后运作日）	上年度末 2017年12月31日
负债：		
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	1,083,303.65	–
应付管理人报酬	1,062.40	32,576.33
应付托管费	354.13	10,858.77
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	–	–
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	84,000.00	36,000.00
负债合计	1,168,720.18	79,435.10
所有者权益：		
实收基金	4,618,360.33	220,101,613.68
未分配利润	30,314.52	296,827.31
所有者权益合计	4,648,674.85	220,398,440.99
负债和所有者权益总计	5,817,395.03	220,477,876.09

注：1. 报告截止日2018年6月14日（基金最后运作日），基金份额净值1.0066元；基金份额总额4,618,360.33份。于2017年12月31日，基金份额净值1.0013元；基金份额总额220,101,613.68份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年6月14日（基金最后运作日）和2017年12月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日。

3.2 利润表

会计主体：国泰润享纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月14日（基金最后运作日）止期间	上年度可比期间 2017年12月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间
一、收入	830,239.76	376,662.41
1.利息收入	843,398.76	376,662.41
其中：存款利息收入	647,653.96	376,662.41
债券利息收入	101,558.91	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	94,185.89	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	-13,200.00	–
其中：股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-13,200.00	–
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	–	–
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	–	–
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	41.00	–
减：二、费用	286,882.10	79,835.10
1. 管理人报酬	108,624.03	32,576.33
2. 托管费	36,208.07	10,858.77
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	350.00	–
5. 利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	141,700.00	36,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	543,357.66	296,827.31
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	543,357.66	296,827.31

3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰润享纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月14日（基金最后运作日）止期间		
	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）	220,101,613.68	296,827.31	220,398,440.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	543,357.66	543,357.66
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）	-215,483,253.35	-809,870.45	-216,293,123.80
其中：1.基金申购款	2,468,306.35	14,008.01	2,482,314.36
2.基金赎回款	-217,951,559.70	-823,878.46	-218,775,438.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	4,618,360.33	30,314.52	4,648,674.85

项目	上年度可比期间 2017年12月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间		
	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）	220,101,613.68	–	220,101,613.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	296,827.31	296,827.31
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（净值减少以“-”号填列）		–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	220,101,613.68	296,827.31	220,398,440.99

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰润享纯债债券型证券投资基金(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[2017]642号《关于准予国泰润享纯债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币220,056,770.92元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第1075号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年12月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为220,101,613.68份基金份额，其中认购资金利息折合44,842.76份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率。

根据国泰基金管理有限公司于2018年6月15日发布的《国泰润享纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会通过了《关于终止国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据持有人大会的决议，国泰润享纯债债券型证券投资基金自2018年6月15日起进入清算期，基金管理人已依据相关法律法规和本基金基金合同的规定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

本基金清算期为2018年6月15日到2018年7月6日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人宁波银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2018年6月15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。

4.2 清算原因

本基金基金份额持有人大会审议通过《关于终止国泰润享纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

4.3 清算起始日

根据生效的本基金基金份额持有人大会决议，本基金于2018年6月15日起进入清算期，清算期为2018年6月15日至2018年7月6日。

4.4 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。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。

5 清算情况

自2018年6月15日至2018年7月6日清算期间，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 清算费用

按照《国泰润享纯债债券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财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用由基金管理人代为支付。此外，基金管理人将以自有资金垫付清算期间产生的应收利息等。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2018年7月6日），各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日活期存款人民币5,714,341.69元，截止清算结束日2018年7月6日余额为3,744,721.32元，其中包含基金管理人于2018年6月29日划入的垫付资金20,000.00元。

（2）本基金最后运作日应收利息人民币103,053.34元，已于2018年6月21日结息到账总金额104,000.14元，截止清算结束日2018年7月6日余额为1,538.01元。

5.3 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,083,303.65元，该款项于2018年6月15日支付人民币570,132.93元和2018年6月19日支付人民币513,170.72元。

（2）本基金最后运作日应付管理费为人民币1,062.40元，该款项已于2018年6月25日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币354.13元，该款项已于2018年6月25日支付。

（4）本基金最后运作日其他负债人民币84,000.00元，该款项为预提审计费和信息披露费，已于2018年6月15日支付审计费33,000.00元，于2018年6月22日支付信息披露费51,000.00元。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月15日（基金清算起始日）至2018年7月6日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	2,484.81
1.利息收入	2,484.81
其中：存款利息收入	2,484.81
债券利息收入	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	–
其中：股票投资收益	–
债券投资收益	–
基金投资收益	–
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	–
4.其他收入（损失以“-”号填列）	–
二、清算费用	–
1. 交易费用	–
2. 其他费用	–
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	2,484.81

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

资产处置及负债清偿后，于2018年7月6日本基金剩余财产为人民币3,726,259.33元，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。

清算起始日2018年6月15日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。由基金管理人以自有资金垫付并已于2018年6月29日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账起孳生的利息归基金管理人所有。

截至2018年7月6日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币3,744,721.32元，其中人民币20,000.00元系基金管理人垫付资金。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.6 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、《国泰润享纯债债券型证券投资基金2018年1月1日至2018年6月14日(基金最后运作日) 止期间和2017年12月13日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的财务报表及审计报告》

2、通力律师事务所关于《国泰润享纯债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16-19层。

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。

国泰润享纯债债券型证券投资基金财产清算小组

二〇一八年七月六日