（上接B106版）

6.基金份额持有人大会费用；

7.基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

8.基金的证券交易费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用

10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金管理费。

前一日的基金资产净值为已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金托管费。

前一日的基金资产净值为已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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0.25%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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。

4. 上述“一、基金费用的种类中第4－10项费用”，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对基金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4月20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“三、基金管理人”中的相关内容；

3、更新了“五、相关服务机构” 中销售机构的相关内容；

4、更新了“八、基金份额的申购与赎回”中的相关内容；

5、更新了“九、基金的投资”中基金投资组合报告，数据截止至2018年6月30日；

6、更新了“十、基金的业绩”，数据截止至2018年6月30日；

7、更新了“二十二、其他应披露的事项”，新增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

二〇一八年十月二十日

国泰安惠收益定期开放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：平安银行股份有限公司

公告日期：2018年10月20日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰安惠收益定期开放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]630号《关于准予国泰安惠收益定期开放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《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金存续期限不定期，以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起（含基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（含该日）一年的期间内，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（含该日）起至一年后的对应日（含该日）的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（含该日）至一年后的对应日（含该日）的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期或为非工作日，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。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）不少于5个工作日并且最长不超过20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。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。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。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,476,804.19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(2018)第89号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2018年2月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,486,086.45份基金份额，其中认购资金利息折合9,282.26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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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《关于终止国泰安惠收益定期开放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6月25日起至2018年7月23日17:00止。本次会议议案于2018年7月24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7月25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《国泰安惠收益定期开放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8月10日起进入清算期。

本基金清算期为2018年8月10日到2018年8月31日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人平安银行股份有限公司、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8月10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	国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	国泰安惠收益定期开放债券	
基金主代码	004678	
交易代码	004678	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年2月2日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
2018年8月9日基金份额总额	3,242,334.99份	
下属分级基金的基金简称	国泰安惠收益定期开放债券A	国泰安惠收益定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	004678	004679
2018年8月9日下属分级基金的份额总额	3,169,157.39份	73,177.60份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较长期稳定的投资回报。
投资策略	（一）封闭期投资策略 本基金的投资策略包括类属配置策略、信用债策略、杠杆投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于中等风险/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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永梅	方琦
	联系电话	021-31081600转	0755-22168073
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95511
传真		021-31081800	0755-82080400
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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
邮政编码		200082	518000
法定代表人		陈勇胜	谢永林

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：国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年8月9日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2018年8月9日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	8,221,637.74
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	25,711.87
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	8,247,349.61
负债和所有者权益	本期末 2018年8月9日（基金最后运作日）
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	4,820,762.43
应付管理人报酬	17,527.80
应付托管费	4,381.96
应付销售服务费	9.98
应付交易费用	1,917.26
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	147,000.00
负债合计	4,991,599.43
所有者权益：	
实收基金	3,242,334.99
未分配利润	13,415.19
所有者权益合计	3,255,750.18
负债和所有者权益总计	8,247,349.61

注：1. 报告截止日2018年8月9日（基金最后运作日），国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金A类基金的份额净值1.0042元，国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金C类基金的份额净值1.0032元；基金份额总额3,242,334.99份，其中国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金A类基金的份额总额3,169,157.39份，国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金C类基金的份额总额73,177.60份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年2月2日（基金合同生效日）至2018年8月9日（基金最后运作日）。

3.2 利润表

会计主体：国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018年2月2日（基金合同生效日）至2018年8月9日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月2日至2018年8月9日（基金最后运作日）止期间
一、收入	4,526,929.42
1.利息收入	4,508,188.42
其中：存款利息收入	3,887,593.81
债券利息收入	393,975.01
资产支持证券利息收入	–
买入返售金融资产收入	226,619.60
其他利息收入	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	18,741.00
其中：股票投资收益	–
基金投资收益	–
债券投资收益	18,741.00
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）	–
减：二、费用	1,178,147.83
1. 管理人报酬	809,206.01
2. 托管费	202,301.51
3. 销售服务费	330.31
4. 交易费用	1,210.00
5. 利息支出	–
其中：卖出回购金融资产支出	–
6. 其他费用	165,100.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,348,781.59
减：所得税费用	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,348,781.59

3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018年2月2日（基金合同生效日）至2018年8月9日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月2日至2018年8月9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）	200,486,086.45	–	200,486,086.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	3,348,781.59	3,348,781.59
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）	-197,243,751.46	-649,113.31	-197,892,864.77
其中：1.基金申购款	2,071.99	3.08	2075.07
2.基金赎回款	-197,245,823.45	-649,116.39	-197,894,939.84
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）	–	-2,686,253.09	-2,686,253.09
五、期末所有者权益（基金净值）	3,242,334.99	13,415.19	3,255,750.18

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰安惠收益定期开放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]630号《关于准予国泰安惠收益定期开放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《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金存续期限不定期，以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起（含基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（含该日）一年的期间内，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（含该日）起至一年后的对应日（含该日）的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（含该日）至一年后的对应日（含该日）的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期或为非工作日，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。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）不少于5个工作日并且最长不超过20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。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。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。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,476,804.19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(2018)第89号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2018年2月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,486,086.45份基金份额，其中认购资金利息折合9,282.26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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、中小企业私募债券、短期融资券及超级短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行定期存款、同业存单、权证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相关规定）。本基金的投资组合比例为：债券资产比例不低于基金资产的80%，股票资产比例为基金资产的0%-20%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

根据国泰基金管理有限公司于2018年7月25日发布的《国泰安惠收益定期开放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《关于终止国泰安惠收益定期开放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，国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金自2018年8月10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8月10日到2018年8月31日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人平安银行股份有限公司、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8月10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《关于终止国泰安惠收益定期开放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8月10日起进入清算期，清算期为2018年8月10日至2018年8月31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8月10日至2018年8月31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《国泰安惠收益定期开放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。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2018年8月31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8,221,637.74元，截止清算结束日2018年8月31日余额为2,063,572.29元，其中包含基金管理人于2018年8月28日划入的垫付资金40,000.00元。

（2）本基金最后运作日应收利息人民币25,711.87元，截止清算结束日2018年8月31日余额为26,840.19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4,820,762.43元，该款项于2018年8月10日支付人民币3,012,700.32元，于2018年8月13日支付人民币1,808,062.11元。

（2）本基金最后运作日应付管理费为人民币17,527.80元，该款项已于2018年8月28日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币4,381.96元，该款项已于2018年8月28日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币9.98元，该款项已于2018年8月29日支付。

（5）本基金最后运作日应付银行间市场交易费用为人民币1,917.26元，该款项已于2018年8月22日支付760.00元，于2018年8月28日支付1,157.26元。

（6）本基金最后运作日其他负债人民币147,000元，该款项为预提审计费、预提信息披露费、预提银行间债券账户维护费以及应付律师费，已于2018年8月13日支付审计费31,000.00元，于2018年8月14日支付律师费50,000.00元， 于2018年8月22日支付银行间债券账户维护费3,000.00元，于2018年8月28日支付银行间债券账户维护费3,000.00元，于2018年8月24日支付信息披露费60,000.00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8月10日（基金清算起始日）至2018年8月31日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	1,128.32
1.利息收入	1,128.32
其中：存款利息收入	1,128.32
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）	1,128.32

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8月31日本基金剩余财产为人民币2,050,412.48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8月10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8月28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8月31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2,063,572.29元，其中人民币40,000.00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、《国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金2018年2月2日（基金合同生效日）至2018年8月9日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

2、上海市通力律师事务所关于《国泰安惠收益定期开放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。

国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

二〇一八年八月三十一日

国泰民惠收益定期开放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：中国民生银行股份有限公司

公告日期：2018年10月20日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰民惠收益定期开放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[2016]2690号《关于准予国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金存续期限不定期，以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起(含基金合同生效日)或者每一个开放期结束之日次日起(含该日)18个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)不少于5个工作日并且最长不超过20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。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币208,323,586.19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(2016)第1756号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年12月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为208,432,746.91份基金份额， 其中认购资金利息折合109,160.72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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金最近一个开放期自2018年7月2日（含该日）至2018年7月27日（含该日），在开放期届满时（即2018年7月27日日终），本基金当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于5000 万元，已触发《基金合同》中约定的终止基金合同情形。本基金应当根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止基金合同，且不需要召开基金份额持有人大会。基金管理人于2018年7月28日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了《关于国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金从2018年7月28日起进入清算期。

本基金清算期为2018年7月28日到2018年9月7日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、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）和上海市通力律师事务所于2018年7月28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	国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国泰民惠收益定期开放债券
基金主代码	003899
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起（含基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（含该日）18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（含该日）起至18个月后的对应日（含该日）的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（含该日）至18个月后的对应日（含该日）的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期或为非工作日，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。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）不少于5个工作日并且最长不超过20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。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。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。
基金合同生效日	2016年12月29日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
2018年7月27日基金份额总额	28,427,567.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较长期稳定的投资回报。
投资策略	（一）封闭期投资策略 1、类属配置策略 本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 2、信用债策略 本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。 为控制本基金的信用风险，本基金将定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。封闭期内，如本基金持有债券的信用状况急剧恶化，甚至可能出现违约风险，进而影响本基金的买入持有到期策略，本基金将对该债券进行处置。 3、杠杆投资策略 本基金将在考虑债券投资的风险收益情况， 以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。为控制风险，本基金的杠杆比例在每个封闭期内原则上保持不变，但是在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下，基金管理人可以调整杠杆比例或者不进行杠杆放大。 4、现金管理策略 在开放期，鉴于本基金原则上将使基金资产保持现金状态，本基金可采用持有到期策略，投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购和银行存款。由于在建仓期本基金的债券投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配， 因此可能存在部分债券在封闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有债券的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券、回购或银行存款进行再投资或进行基金现金分红。 5、资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 6、定向增发策略 本基金从发展前景和估值水平两个角度出发，通过定性和定量分析相结合的方法评价定向增发项目对上市公司未来价值的影响。结合定向增发一二级市场价差的大小，理性做出投资决策。在严格控制风险的前提下，对投资组合进行优化配置和动态调整。 7、中小企业私募债投资策略 本基金在严格控制风险的前提下， 综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。 8、非公开发行股票投资策略 本基金从发展前景和估值水平两个角度出发，通过定性和定量分析相结合的方法评价非公开发行项目对上市公司未来价值的影响。结合非公开发行一二级市场价差的大小，理性做出投资决策。在严格控制投资组合风险的前提下，对行业进行优化配置和动态调整。 9、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下， 将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于中等风险/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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永梅	罗菲菲
	联系电话	021-31081600转	010-58560666
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95568
传真		021-31081800	010-58560798
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	北京市西城区复兴门内大街2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	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200082	100031
法定代表人		陈勇胜	洪崎

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：国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年7月27日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2018年7月27日(基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	27,320,761.71	550,496.73
结算备付金	4,949,917.52	6,523,139.61
存出保证金	41,045.01	22,304.23
交易性金融资产	883,484.00	315,796,888.05
其中：股票投资	883,484.00	15,206,518.05
债券投资	–	300,590,370.00
买入返售金融资产	–	9,936,134.90
应收利息	37,051.17	5,356,686.29
应收申购款	799.52	–
资产总计	33,233,058.93	338,185,649.81
负债和所有者权益		
负债：		
卖出回购金融资产款	–	124,800,000.00
应付证券清算款	–	477,340.73
应付赎回款	3,248,746.58	–
应付管理人报酬	35,883.17	126,325.73
应付托管费	10,252.35	36,093.09
应付交易费用	19,513.32	15,489.74
应交税费	575.90	–
应付利息	–	-69,335.19
其他负债	262,000.00	120,000.00
负债合计	3,576,971.32	125,505,914.10
所有者权益：		
实收基金	28,427,567.29	208,432,746.91
未分配利润	1,228,520.32	4,246,988.80
所有者权益合计	29,656,087.61	212,679,735.71
负债和所有者权益总计	33,233,058.93	338,185,649.81

注：报告截止日2018年7月27日(基金最后运作日)，国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金的份额净值1.0432元，基金份额总额28,427,567.29份。

3.2 利润表

会计主体：国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年7月27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7月27日(基金最后运作日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	7,496,735.89	10,377,765.06
利息收入	6,074,420.81	11,269,391.52
其中：存款利息收入	121,062.71	1,024,642.71
债券利息收入	5,921,131.69	10,201,431.43
买入返售金融资产收入	32,226.41	43,317.38
投资收益	1,815,363.59	-1,050,683.48
其中：股票投资收益	714,825.72	1,110,924.50
债券投资收益	1,051,433.72	-2,190,844.33
股利收益	49,104.15	29,236.35
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-393,050.33	159,057.02
其他收入	1.82	–
减：二、费用	3,144,027.10	6,214,031.79
管理人报酬	783,118.26	1,480,743.58
托管费	223,748.09	423,069.53
交易费用	75,425.44	79,348.29
利息支出	1,747,505.83	3,665,957.42
其中：卖出回购金融资产支出	1,747,505.83	3,665,957.42
税金及附加	18,880.00	–
其他费用	295,349.48	564,912.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	4,352,708.79	4,163,733.27
减：所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,352,708.79	4,163,733.27

3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年7月27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7月27日(基金最后运作日)		
	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)	208,432,746.91	4,246,988.80	212,679,735.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	4,352,708.79	4,352,708.79
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)	-180,005,179.62	-7,371,177.27	-187,376,356.89
其中：1.基金申购款	3,459.99	145.16	3,605.15
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-180,008,639.61	-7,371,322.43	-187,379,962.04
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)	28,427,567.29	1,228,520.32	29,656,087.61
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	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)	208,432,746.91	83,255.53	208,516,002.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	4,163,733.27	4,163,733.27
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(以“-”号填列)	–	–	–
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)	208,432,746.91	4,246,988.80	212,679,735.71

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰民惠收益定期开放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[2016]2690号《关于准予国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金存续期限不定期，以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起(含基金合同生效日)或者每一个开放期结束之日次日起(含该日)18个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)不少于5个工作日并且最长不超过20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。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币208,323,586.19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(2016)第1756号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年12月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为208,432,746.91份基金份额， 其中认购资金利息折合109,160.72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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、中小企业私募债券、短期融资券及超级短期融资券、可分离交易债券的纯债)、资产支持证券、债券回购、银行定期存款、同业存单、权证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比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于股票资产比例为基金资产的 0%-20%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前两个月、开放期及开放期结束后两个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金和应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

根据国泰基金管理有限公司于2018年7月28日发布的《关于国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金自2018年7月28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7月28日到2018年9月7日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、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）和上海市通力律师事务所于2018年7月28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

触发了《基金合同》中约定的终止基金合同情形。

4.3 清算起始日

本基金于2018年7月28日起进入清算期，清算期为2018年7月28日至2018年9月7日。

由于本基金于清算结束日(2018年9月7日)仍持有停牌股票导致部分资产未变现，因此需要进行二次或多次清算，待本基金所持停牌股票变现后将及时进行再次分配。

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7月28日至2018年9月7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《国泰民惠收益定期开放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。

5.2 资产处置情况

（1）本基金最后运作日活期存款人民币27,320,761.71元，截止清算结束日2018年9月7日余额为23,770,684.59元。

（2）本基金最后运作日结算备付金人民币4,949,917.52元，截止清算结束日2018年9月7日余额为95,652.17元。

（3） 本基金最后运作日存出保证金人民币41,045.01元，截止清算结束日已全部调回托管户。

（4）本基金最后运作日应收申购款人民币799.52元，于2018年7月30日划入托管户。

（5）本基金最后运作日应收利息人民币37,051.17元，截止清算结束日余额为58,056.54元。

（5）本基金最后运作日持有的流通受限股票资产为人民币883,484.00元。

具体情况如下：

1）本基金最后运作日（2018年7月27日）持有的停牌股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	估值价格（人民币元）	最后运作日估值金额（人民币元）
1	002450	康得新	55,600.00	15.89	883,484.00
合计					883,484.00

2）本次清算期间（2018年7月28日至2018年9月7日）股票处置情况：

由于本基金于清算终止日(2018年9月7日)仍持有停牌股票（估值金额787,852.00元）导致部分资产未变现，因此需要进行二次或多次清算，待本基金所持停牌股票变现后将及时进行再次分配。

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3,248,746.58元，截止清算结束日已支付完毕。

（2）本基金最后运作日应付管理费为人民币35,883.17元，截止清算结束日已支付完毕。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币10,252.35元，截止清算结束日已支付完毕。

（4）本基金最后运作日应付交易费用为人民币19,513.32元，截止清算结束日已支付完毕。

（5）本基金最后运作日应交税费为人民币575.90元，截止清算结束日已支付完毕。

（6）本基金最后运作日其他负债人民币262,000.00元。其中预提信息披露费212,000.00元，预提审计费用34,000.00元，预提账户维护费6,000.00元，预提律师费10,000.00元，截止清算结束日已支付完毕。

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7月28日（基金清算起始日）至2018年9月7日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	-73,168.00
1.利息收入	22,464.00
其中：存款利息收入	21,005.37
买入返售金融资产收入	1,458.63
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	–
股利收益	–
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-95,632.00
4.其他收入（损失以“-”号填列）	–
二、清算费用	253.23
1. 交易费用	–
2. 银行费用	253.23
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-73,421.23

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018 年7 月27 日基金净资产	29,656,087.61
加：清算期净收益	-73,421.23
加：应付利润结转实收基金金额	–
减：赎回金额（含费用）	4,870,421.08
二、2018 年9 月7 日基金净资产	24,712,245.30

资产处置及负债清偿后，于2018年9月7日本基金剩余财产为人民币24,712,245.30元，其中银行存款余额为23,770,684.59元；应收利息余额、结算备付金及未变现股票资产将在后续清算时一并清算。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，2018年9月8日至最终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。

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、《国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金2018年1月1日至2018年7月27日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

2、通力律师事务所关于《国泰民惠收益定期开放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。

国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

二〇一八年九月七日

国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告

根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）以及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）的原则和有关要求，国泰基金管理有限公司（以下简称本公司）与托管银行商定，决定对本公司旗下基金（ETF基金除外）持有的“小天鹅A”（证券代码：000418）、“长信科技”（证券代码：300088）及“益丰药房”（证券代码：603939）股票进行估值调整，自2018 年10月18日起按指数收益法进行估值。

待该股票的交易体现出活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时将不再另行公告。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018年10月20日

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）关于基金不定期份额折算的相关约定，当国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金（以下简称本基金）之B类份额的基金份额净值小于或等于0.2500元时，国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：国泰有色，基金代码：160221）、有色A份额（场内简称：有色A，基金代码：150196）、有色B份额（场内简称：有色B，基金代码：150197）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年10月19日收盘，有色B份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，在此提请投资者密切关注有色B份额近期基金份额净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于有色A份额、有色B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，有色A份额、有色B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、有色B份额表现为高预期风险、高预期收益的特征，不定期份额折算后其将恢复至初始杠杆水平。

三、有色A份额表现为较低预期风险和较低预期收益的特征，在不定期份额折算后，原有色A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化， 由持有单一的较低风险收益特征的有色A份额变为同时持有较低风险收益特征的有色A份额与较高风险收益特征的国泰有色份额的情况，因此，原有色A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，国泰有色为跟踪国证有色金属行业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原有色A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。请投资者认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》了解相关内容。

四、由于触发折算阈值当日，有色B的份额净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日有色B的份额净值可能与折算阈值0.2500元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算(最小单位为1份)，舍去部分计入基金资产，持有极小数量国泰有色份额、有色A份额、有色B份额的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停有色A份额与有色B份额的上市交易和国泰有色份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的《基金合同》及《招募说明书》或者拨打本基金管理人客服电话：400-888-8688。

三、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该基金的《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10月20日

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）关于基金不定期份额折算的相关约定，当国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金（以下简称本基金）之B类份额的基金份额净值小于或等于0.2500元时，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：国泰医药，基金代码：160219）、医药A份额（场内简称：医药A，基金代码：150130）、医药B份额（场内简称：医药B，基金代码：150131）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年10月19日收盘，医药B份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，在此提请投资者密切关注医药B份额近期基金份额净值的波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期份额折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于医药A份额、医药B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，医药A份额、医药B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、医药B份额表现为高预期风险、高预期收益的特征，不定期份额折算后其将恢复至初始杠杆水平。

三、医药A份额表现为较低预期风险和较低预期收益的特征，在不定期份额折算后，原医药A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化， 由持有单一的较低风险收益特征的医药A份额变为同时持有较低风险收益特征的医药A份额与较高风险收益特征的国泰医药份额的情况，因此，原医药A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，国泰医药为跟踪国证医药卫生行业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原医药A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。请投资者认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》了解相关内容。

四、由于触发折算阈值当日，医药B的份额净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日医药B的份额净值可能与折算阈值0.2500元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量国泰医药份额、医药A份额、医药B份额的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停医药A份额与医药B份额的上市交易以及国泰医药份额的申购、赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的《基金合同》及《招募说明书》或者拨打本基金管理人客服电话：400-888-8688。

三、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该基金的《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10月20日