关于国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金暂停申购（含定投）及转换转入业务的公告

公告送出日期:2018年11月17日

一、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	
基金主代码	006726	
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司	
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等相关文件的规定。	
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购业务起始日	2018年11月22日
	暂停转换转入起始日	2018年11月22日
	暂停定期定额投资起始日	2018年11月22日
	暂停申购（含定投）及转换转入的原因说明	保护基金份额持有人利益

二、其他需要提示的事项

在本基金暂停申购（含定投）、转换转入业务期间，本基金的赎回、转换转出等业务正常办理。

投资者可登录本公司网站www.gtfund.com，或拨打客户服务电话400-888-8688咨询相关信息。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018年11月17日

国泰安心回报混合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:中国建设银行股份有限公司

公告日期:2018年11月17日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰安心回报混合型证券投资基金(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[2015]2321号《关于准予国泰安心回报混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2017]509号《关于国泰安心回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册募集,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《国泰安心回报混合型证券投资基金合同》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211,452,609.63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1047号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰安心回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年11月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为211,478,307.96份基金份额,其中认购资金利息折合25,698.33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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《国泰安心回报混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,《基金合同》生效后,连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的,基金将按照《基金合同》的约定进入清算程序并终止,无需召开基金份额持有人大会审议。鉴于本基金已触发基金合同终止事由,本基金将根据《基金合同》的约定进行清算并终止《基金合同》。本基金的最后运作日定为2018年9月5日,并于2018年9月6日进入清算程序。

本基金清算期为2018年9月6日到2018年10月17日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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9月6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	国泰安心回报混合型证券投资基金	
基金简称	国泰安心回报混合	
基金主代码	002204	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月29日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
2018年9月5日基金份额总额	1,838,458.26份	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超额收益。
投资策略	本基金的投资策略包括采用CPPI策略进行资产配置、股票投资策略、债券投资策略、股指期货交易策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永梅	田青
	联系电话	021-31081600转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000,400-888-8688	010-67595096
传真		021-31081800	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200082	100033
法定代表人		陈勇胜	田国立

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:国泰安心回报混合型证券投资基金

报告截止日:2018年9月5日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	本期末 2018年9月5日(基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	735,647.91	211,648,177.24
结算备付金	6,199.09	-
存出保证金	373.23	-
交易性金融资产	1,406,720.00	-
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,406,720.00	-
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	26,371.75	545,513.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,175,311.98	212,193,691.03
负债和所有者权益	**本期末 2018年9月5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	87,356.78	-
应付管理人报酬	416.24	215,759.22
应付托管费	86.73	44,949.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	320.00	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	248,140.43	16,000.00
负债合计	336,320.18	276,709.07
所有者权益:		
实收基金	1,838,458.26	211,478,307.96
未分配利润	533.54	438,674.00
所有者权益合计	1,838,991.80	211,916,981.96
负债和所有者权益总计	2,175,311.98	212,193,691.03

注:报告截止日2018年9月5日(基金最后运作日),基金份额净值1.000元;基金份额总额1,838,458.26份。

3.2 利润表

会计主体:国泰安心回报混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年9月5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9月5日(基金最后运作日)止期间	上年度可比期间 2017年11月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间
一、收入	1,868,836.50	745,554.54
1.利息收入	1,287,089.57	741,324.97
其中:存款利息收入	659,389.77	741,324.97
债券利息收入	621,096.58	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,633.22	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	6,528.00	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,528.00	-
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)	-1,920.00	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	577,138.93	4,229.57
减:一、费用	822,036.60	306,880.54
1. 管理人报酬	455,241.96	222,712.16
2. 托管费	94,842.05	46,398.38
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,402.41	-
5. 利息支出	10,055.85	-
其中:卖出回购金融资产支出	10,055.85	-
6. 其他费用	259,494.33	37,770.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,046,799.90	438,674.00
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,046,799.90	438,674.00

3.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国泰安心回报混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年9月5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9月5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)	211,478,307.96	438,674.00	211,916,981.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,046,799.90	1,046,799.90
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)	-209,639,849.70	-1,484,940.36	-211,124,790.06
其中:1.基金申购款	651,812.10	4,792.48	656,604.58
2.基金赎回款	-210,291,661.80	-1,489,732.84	-211,781,394.64
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)	1,838,458.26	533.54	1,838,991.80

项目	上年度可比期间 2017年11月29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)	211,478,307.96	-	211,478,307.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	438,674.00	438,674.00
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)	211,478,307.96	438,674.00	211,916,981.96

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰安心回报混合型证券投资基金(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[2015]2321号《关于准予国泰安心回报混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2017]509号《关于国泰安心回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册募集,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《国泰安心回报混合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211,452,609.63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1047号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰安心回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年11月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为211,478,307.96份基金份额,其中认购资金利息折合25,698.33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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰安心回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、股指期货、权证等权益类金融工具,债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具,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:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的40%,本基金投资于股票的比例不高于基金资产的60%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。

根据国泰基金管理有限公司于2018年8月30日发布的《关于国泰安心回报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》,国泰安心回报混合型证券投资基金的最后运作日为2018年9月5日,自2018年9月6日起进入清算程序,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9月6日到2018年10月17日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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9月6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

本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,触发基金合同终止事由。

4.3 清算起始日

本基金于2018年9月6日起进入清算期,清算期为2018年9月6日至2018年10月17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9月6日至2018年10月17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《国泰安心回报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10月17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735,647.91元,截至清算结束日2018年10月17日余额为1,939,046.30元,其中包含基金管理人于2018年9月20日划入的垫付资金100,000.00元及由垫付资金孳生的利息结息到账资金2.00元。

(2)本基金最后运作日结算备付金人民币6,199.09元,存出保证金人民币373.23元,资金已于2018年10月9日赎回至托管账户。

(3)本基金最后运作日债券投资人民币1,406,720.00元,应收债券利息人民币22,182.90元,已于2018年9月11日卖出所有债券。

(4)本基金最后运作日应收活期存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息以及直销申购款利息合计人民币4,188.85元,已于2018年9月21日结息到账总金额4,622.10元,于2018年9月25日结息到账总金额13.80元,于2018年9月26日结息到账总金额0.41元,截至清算结束日2018年10月17日余额为1,120.39元,其中包含基金管理人垫付资金孳生的应收利息余额6.40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87,356.78元,该款项于2018年9月6日支付人民币55,321.17元和2018年9月7日支付人民币32,035.61元。

(2)本基金最后运作日应付赎回费为人民币140.43元,该款项于2018年9月6日支付人民币82.40元和2018年9月7日支付人民币58.03元。

(3)本基金最后运作日应付管理费为人民币416.24元,该款项已于2018年10月10日支付。

(4)本基金最后运作日应付托管费为人民币86.73元,该款项已于2018年10月10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320.00元,该款项已于2018年9月19日支付300.00元,于2018年10月15日支付20.00元。

(6)本基金最后运作日其他负债人民币248,000.00元,该款项为预提审计费、信息披露费、银行间债券账户维护费和律师费,已于2018年9月13日支付审计费46,000.00元,于2018年9月13日支付律师费10,000.00元,于2018年9月19日支付银行间债券账户维护费4,500.00元,于2018年9月27日支付银行间债券账户维护费4,500.00元,于2018年10月10日支付信息披露费183,000.00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9月6日(基金清算起始日)至2018年10月17日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	2,104.07
1.利息收入	2,383.77
其中:存款利息收入	1,513.85
债券利息收入	869.92
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,200.00
其中:股票投资收益	-
债券投资收益	-2,200.00
基金投资收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,920.00
4.其他收入(损失以“-”号填列)	0.30
二、清算费用	386.43
1. 交易费用	1.43
2. 其他费用	385.00
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	1,717.64

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10月17日本基金剩余财产为人民币1,840,110.69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9月6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9月20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10月17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1,939,046.30元,其中人民币100,002.00元系基金管理人垫付资金及由垫付资金孳生的利息结息到账资金。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、《国泰安心回报混合型证券投资基金2018年1月1日至2018年9月5日(基金最后运作日)止期间和2017年11月29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《国泰安心回报混合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。

国泰安心回报混合型证券投资基金财产清算小组

二〇一八年十月十七日

国泰丰祺纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2018年11月17日

1. 公告基本信息

基金名称	国泰丰祺纯债债券型证券投资基金
基金简称	国泰丰祺纯债债券
基金主代码	006116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月16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	中国光大银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《国泰丰祺纯债债券型证券投资基金基金合同》、《国泰丰祺纯债债券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】909号
基金募集期间		自2018年11月12日至2018年11月15日
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11月16日
募集有效认购总户数(单位:户)		292
募集期间净认购金额(单位:元)		200,000,592.11
认购资金在募集期间产生的利息(单位:元)		0.15
募集份额(单位:份)	有效认购份额	200,000,592.11
	利息结转的份额	0.15
	合计	200,000,592.26
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)	19,999,000.00
	占基金总份额比例	9.9995%
	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)	3,220.53
	占基金总份额比例	0.0016%
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11月16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0。

(3)本基金管理人运用固有资金于2018年11月14日通过本公司直销柜台认购本基金20,000,000.00元,认购费用为1,000元,募集期间认购资金产生的利息为0元,认购份额19,999,000.00份。

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。

本基金自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回业务。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基金的《基金合同》、《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

二零一八年十一月十七日

国泰润鑫纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年11月17日

1. 公告基本信息

基金名称	国泰润鑫纯债债券型证券投资基金
基金简称	国泰润鑫纯债债券
基金主代码	003696
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》等
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	黄志翔
离任基金经理姓名	韩哲昊

2. 离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	韩哲昊
离任原因	因内部工作调整需要
离任日期	2018年11月16日
转任本公司其他工作岗位的说明	继续担任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金的基金经理
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是

3. 其他需要说明的事项

公司已按规定向中国证券投资基金业协会办理相应手续,并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

二零一八年十一月十七日

国泰瞬利交易型货币市场基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年11月17日

1. 公告基本信息

基金名称	国泰瞬利交易型货币市场基金
基金简称	国泰瞬利货币ETF
基金主代码	511620
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》等
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	黄志翔
离任基金经理姓名	韩哲昊

2. 离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	韩哲昊
离任原因	因内部工作调整需要
离任日期	2018年11月16日
转任本公司其他工作岗位的说明	继续担任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金的基金经理
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是

3. 其他需要说明的事项

公司已按规定向中国证券投资基金业协会办理相应手续,并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

二零一八年十一月十七日

国泰稳益定期开放灵活配置混合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11月17日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰稳益定期开放灵活配置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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第2458号《关于准予国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册募集,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《国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,存续期限不定期。根据《国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,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)6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)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,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203,160,551.95元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年7月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为203,177,651.87份基金份额,其中认购资金利息折合17,099.92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。

本基金最近一个开放期自2018年9月3日(含该日)至2018年9月14日(含该日),在本次开放期届满时(即2018年9月14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《国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》((以下简称“《基金合同》”)中的定约终止基金合同情形。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9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《关于国泰稳益定期开放灵活配置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》。本基金从2018年9月15日起进入清算期。

本基金清算期为2018年9月15日到2018年10月23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9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	国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国泰稳益定期开放灵活配置混合	
基金主代码	003758	
交易代码	003758	
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(包括基金合同生效日)或者每一个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。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)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。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	2017年7月26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9月14日基金份额总额	4,593,052.23份	
下属分额类别的基金简称	国泰稳益定期开放灵活配置混合A	国泰稳益定期开放灵活配置混合C
下属分额类别的交易代码	003758	003759
2018年9月14日下属分额类别的份额总额	559,633.70份	4,033,418.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求稳健的投资回报。
投资策略	(一)封闭期投资策略 本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益类投资工具投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略等。 (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	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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	0574-89103213
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:国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年9月14日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	本期末 2018年9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	2,270,532.80	12,583,560.32
结算备付金	-	1,151,030.31
存出保证金	112,371.23	58,841.96
交易性金融资产	1,958,880.00	89,713,716.89
其中:股票投资	1,958,880.00	89,713,716.89
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	-	105,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	127,606.51	177,555.23
应收股利	-	-
应收申购款	1,009.38	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,470,399.92	208,684,704.71
负债和所有者权益	**本期末 2018年9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	418,507.30	-
应付管理人报酬	10,302.68	122,932.63
应付托管费	1,471.81	17,561.82
应付销售服务费	541.99	2,730.94
应付交易费用	78,966.61	126,624.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	248,500.00	60,000.00
负债合计	758,290.39	329,850.28
所有者权益:		
实收基金	4,593,052.23	203,177,651.87
未分配利润	-880,942.70	5,177,202.56
所有者权益合计	3,712,109.53	208,354,854.43
负债和所有者权益总计	4,470,399.92	208,684,704.71

注:报告截止日2018年9月14日(基金最后运作日),国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金A类基金的份额净值0.8094元,国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金C类基金的份额净值0.8080元;基金份额总额4,593,052.23份,其中国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金A类基金的份额总额559,633.70份,国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金C类基金的份额总额4,033,418.53份。

3.2 利润表

会计主体:国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年9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9月14日(基金最后运作日)止期间	上年度可比期间 2017年7月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间
一、收入	-23,758,949.48	6,375,181.55