

国泰招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：招商银行股份有限公司

公告日期：2022 年 11 月 14 日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰招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]1558号《关于准予国泰招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《国泰招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。本基金为契约型开放式,存续期限不定。根据《国泰招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)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起(包括该日)至18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18个月后的对应日前一日(包括该日)的期间,以此类推。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,开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币209,996,486.10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56号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2018年1月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,078,773.91份基金份额,其中认购资金利息折合82,287.81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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“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:

“本基金自基金合同生效后,在任一开放期最后一日日终(注册登记机构完成最后一日申购、赎回及基金转换业务申请的确认以后),有下列情形之一的,将根据基金合同第十九部分的约定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。

- 1、基金份额持有人数量不满200人的;
- 2、基金资产净值小于5000万元的(此处基金资产净值包含开放期最后一日净申赎金额)。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”

本基金最近一次开放期为2022年9月19日至2022年10月14日。截至该次开放期的最后一日

（即 2022 年 10 月 14 日）日终，本基金已经触发上述第 2 条基金合同终止事由。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，不需要召开基金份额持有人大会。

本基金清算期为 2022 年 10 月 18 日到 2022 年 11 月 4 日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、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 2022 年 10 月 18 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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	4
2 基金概况	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）	6
3.1 资产负债表	6
3.2 利润表	7
3.3 净资产（基金净值）变动表	8
4 清盘事项说明	10
4.1 基金基本情况	10
4.2 清算原因	12
4.3 清算起始日	12
4.4 清算报表编制基础	12
5 清算情况	12
5.1 清算费用	12
5.2 资产处置情况	12
5.3 负债清偿情况	13
5.4 清算期间的清算损益情况	13
5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况	14
5.6 基金财产清算报告的告知安排	14
6 备查文件目录	14
6.1 备查文件目录	14
6.2 存放地点	14
6.3 查阅方式	14

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	国泰招惠收益定期开放债券
基金主代码	005185
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 24 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
2022 年 10 月 17 日基金份额总额	7,123,645.96 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	1、封闭期投资策略：1) 资产配置策略；2) 债券投资策略；3) 股票资产投资策略；4) 存托凭证投资策略；5) 资产支持证券投资策略；6) 中小企业私募债投资策略；7) 国债期货投资策略；8) 权证投资策略。 2、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，属于较低预期风险和预期收益的产品。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	张燕
	联系电话	021-31081600转	0755-83199084
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95555

传真	021-31081800	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200082	518040
法定代表人	邱军	缪建民

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：国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 10 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 10 月 17 日 (基金最后运作日)	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	6,842,522.58	1,034,120.86
结算备付金	94,077.00	650,888.93
存出保证金	10,447.86	4,977.43
交易性金融资产	2,581,606.59	78,271,316.00
其中：股票投资	106,040.00	8,381,642.40
基金投资	-	-
债券投资	2,475,566.59	69,889,673.60
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收清算款	15,587,757.84	720,268.21
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	1,257,129.90
资产总计	25,116,411.87	81,938,701.33
负债和净资产	本期末 2022 年 10 月 17 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	19,500,000.00
应付清算款	-	897,114.99
应付赎回款	15,982,641.17	-
应付管理人报酬	9,412.05	36,256.21
应付托管费	2,689.17	10,358.95
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	33.95	4,877.95
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	116,081.16	137,824.92
负债合计	16,110,857.50	20,586,433.02
净资产:		
实收基金	7,123,645.96	47,549,705.81
未分配利润	1,881,908.41	13,802,562.50
净资产合计	9,005,554.37	61,352,268.31
负债和净资产总计	25,116,411.87	81,938,701.33

注：1. 报告截止日 2022 年 10 月 17 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.2642 元；基金份额总额 7,123,645.96 份。于 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2903 元；基金份额总额 47,549,705.81 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 日（基金最后运作日）和 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

3.2 利润表

会计主体：国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 日（基金最后运作 日）止期间	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间
一、营业总收入	-240,041.66	5,171,545.74
1.利息收入	17,687.10	2,091,116.99
其中：存款利息收入	15,779.69	21,835.34
债券利息收入	-	2,069,174.94
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	1,907.41	106.71
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-576,207.99	4,601,656.81
其中：股票投资收益	-2,185,455.71	2,223,564.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,538,210.13	2,263,439.19
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	71,037.59	114,653.31
其他投资收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	318,478.61	-1,521,531.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	0.62	303.17
减：二、营业总支出	808,499.15	1,262,018.76
1. 管理人报酬	319,536.65	413,001.43
2. 托管费	91,296.17	118,000.35
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	249,005.98	497,378.64
其中：卖出回购金融资产支出	249,005.98	497,378.64
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	4,173.03	6,916.63
8. 其他费用	144,487.32	226,721.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,048,540.81	3,909,526.98
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,048,540.81	3,909,526.98
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-1,048,540.81	3,909,526.98

3.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 日（基金最后运作日）止期间		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净	47,549,705.81	13,802,562.50	61,352,268.31

值)			
二、本期期初净资产 (基金净值)	47,549,705.81	13,802,562.50	61,352,268.31
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-40,426,059.85	-11,920,654.09	-52,346,713.94
(一)、综合收益总额	-	-1,048,540.81	-1,048,540.81
(二)、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)	-40,426,059.85	-10,872,113.28	-51,298,173.13
其中: 1.基金申购款	424.64	115.97	540.61
2.基金赎回款	-40,426,484.49	-10,872,229.25	-51,298,713.74
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	7,123,645.96	1,881,908.41	9,005,554.37
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	47,195,288.53	9,929,439.28	57,124,727.81
二、本期期初净资产 (基金净值)	47,195,288.53	9,929,439.28	57,124,727.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	354,417.28	3,873,123.22	4,227,540.5
(一)、综合收益总额	-	3,909,526.98	3,909,526.98
(二)、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)	354,417.28	-36,403.76	318,013.52

其中：1.基金申购款	27,110,264.89	6,142,166.83	33,252,431.72
2.基金赎回款	-26,755,847.61	-6,178,570.59	-32,934,418.20
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	47,549,705.81	13,802,562.50	61,352,268.31

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰招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]1558号《关于准予国泰招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《国泰招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。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据《国泰招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）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起（包括该日）至18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18个月后的对应日前一日（包括该日）的期间，以此类推。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，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 209,996,486.10 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 56 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 210,078,773.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 82,287.81 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰招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、存托凭证等)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、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%，但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前两个月至开放期结束后两个月内不受前述比例限制。封闭期内，本基金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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金以后，持有的现金或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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“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：

“本基金自基金合同生效后，在任一开放期最后一日日终（注册登记机构完成最后一日申购、赎回及基金转换业务申请的确认以后），有下列情形之一的，将根据基金合同第十九部分的约定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。

- 1、基金份额持有人数量不满 200 人的；
- 2、基金资产净值小于 5000 万元的（此处基金资产净值包含开放期最后一日净申购金额）。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

本基金最近一次开放期为 2022 年 9 月 19 日至 2022 年 10 月 14 日。截至该次开放期的最后一日（即 2022 年 10 月 14 日）日终，本基金已经触发上述第 2 条基金合同终止事由。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，不需要召开基金份额持有人大会。

本基金清算期为 2022 年 10 月 18 日到 2022 年 11 月 4 日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、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 2022 年 10 月 18 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

本基金最近一次开放期为 2022 年 9 月 19 日至 2022 年 10 月 14 日。截至该次开放期的最后一日（即 2022 年 10 月 14 日）日终，本基金已经触发上述《基金合同》“第五部分 基金备案”中基金合同终止事由。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，不需要召开基金份额持有人大会。

4.3 清算起始日

本基金于 2022 年 10 月 18 日起进入清算期，清算期为 2022 年 10 月 18 日至 2022 年 11 月 4 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 2022 年 10 月 18 日至 2022 年 11 月 4 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《国泰招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（2022 年 11 月 4 日），各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日活期存款本金人民币 6,841,442.63 元，应计活期存款利息人民币 1,079.95 元，存出保证金余额 10,447.86 元，其中应计保证金利息 12.09 元，清算备付金余额 94,077.00 元，其中应计清算备付金利息 71.01 元。截止清算结束日 2022 年 11 月 4 日活期存款本金余额为 9,106,532.13 元，其中包含基金管理人于 2022 年 10 月 28 日划入的垫付资金 150,000.00 元，应计银行存款利息归属于基金份额持有人部分余额为 2,741.68 元，存出保证金余额 11,976.17 元，其中应计保证金利息余额 20.73 元，清算备付金余额 30,138.51 元，其中应计清算备付金利息 138.51 元。

（2）本基金最后运作日股票投资人民币 106,040.00 元，债券投资人民币 2,475,566.59 元，截至 2022 年 11 月 4 日，本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部卖出，累计成交金额

2,565,804.23 元。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币 15,982,641.17 元，已于 2022 年 10 月 19 日结算交收。

(2) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 9,412.05 元，该款项已于 2022 年 10 月 24 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,689.17 元，该款项已于 2022 年 10 月 24 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付增值税及附加税为人民币 33.95 元，该款项已于 2022 年 10 月 24 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 12,791.86，该款项为应付券商佣金和银行间交易手续费，已于 2022 年 10 月 24 日支付券商佣金 12,781.86 元，于 2022 年 10 月 27 日支付银行间交易手续费 10 元。

(6) 本基金最后运作日其他负债人民币 103,289.30 元，该款项为预提审计费和信息披露费，以上费用于 2022 年 10 月 27 日根据最终确定的清算审计合同及信披费合同进行了调整，最终确定审计费 39,000.00 元，信息披露费 60,000.00 元，以上款项已于 2022 年 11 月 4 日支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 18 日（基金清算起始日）至 2022 年 11 月 4 日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	-5,355.14
1.利息收入	1,737.87
其中：存款利息收入	1,737.87
债券利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-140,172.99
其中：股票投资收益	-65,172.61
债券投资收益	-75,000.38
基金投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	133,169.06
4.其他收入（损失以“-”号填列）	-89.08
二、清算费用	-1,189.26
1. 税金及附加	0.04
1. 其他费用	-1,189.30

三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-4,165.88
---------------------	-----------

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 2022 年 11 月 4 日本基金剩余财产为人民币 9,001,388.49 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 2022 年 10 月 18 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 2022 年 10 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 2022 年 11 月 4 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本金余额共人民币 9,106,532.13 元，其中人民币 150,000.00 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、《国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 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《国泰招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。

国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年十一月四日