

国泰诚益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：招商银行股份有限公司

公告日期：2025年1月15日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰诚益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[2021]1061号文《关于准予国泰诚益混合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《国泰诚益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 304,724,374.50 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(2021)第 0432 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰诚益混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 304,791,773.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 67,398.67 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:“《基金合同》生效后,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,基金合同终止,不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”

截至 2024 年 12 月 16 日日终,本基金的基金资产净值连续 50 个工作日低于 5000 万元,已触发基金合同终止的上述情形,本基金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。

本基金清算期为2024年12月18日至2025年1月2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、立信会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2024年12月18日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由立信会计师事务所(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.....	3
2	基金概况	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
3	基金最后运作日财务会计报告（经审计）	5
3.1	资产负债表.....	5
3.2	利润表.....	6
3.3	净资产变动表.....	7
4	清盘事项说明	9
4.1	基金基本情况.....	9
4.2	清算原因.....	10
4.3	清算起始日.....	10
4.4	清算报表编制基础.....	10
5	清算情况	10
5.1	清算费用.....	11
5.2	资产处置情况.....	11
5.3	负债清偿情况.....	11
5.4	清算期间的清算损益情况.....	12
5.5	资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况.....	12
5.6	基金财产清算报告的告知安排.....	12
6	备查文件目录	13
6.1	备查文件目录.....	13
6.2	存放地点.....	13
6.3	查阅方式.....	13

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰诚益混合型证券投资基金	
基金简称	国泰诚益混合	
基金主代码	011995	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年5月7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	
2024年12月17日(基金最后运作日)基金份额总额	9,374,469.93 份	
下属分级基金的基金简称	国泰诚益混合 A	国泰诚益混合 C
下属分级基金的交易代码	011995	011996
2024年12月17日(基金最后运作日)下属分级基金的份额总额	6,630,683.60 份	2,743,786.33 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	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、港股通标的股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	张姗
	联系电话	021-31081600 转	400-61-95555
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	400-61-95555
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 15-20 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	周向勇	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：国泰诚益混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 12 月 17 日 (基金最后运作日)	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产:		
货币资金	11,103,048.65	20,359,432.10
结算备付金	476,551.18	168,660.23
存出保证金	7,268.90	29,042.61
交易性金融资产	4,870,285.61	153,784,427.18
其中：股票投资	673,363.97	37,422,288.88
基金投资	-	-
债券投资	4,196,921.64	116,362,138.30
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	2,272,793.90	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	18,729,948.24	174,341,562.12
负债和净资产	本期末 2024 年 12 月 17 日 (基金最后运作日)	上年度末 2023 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	-	-
应付清算款	-	1,041,890.98
应付赎回款	9,229,832.92	-
应付管理人报酬	8,064.54	87,971.72
应付托管费	2,016.14	21,992.93
应付销售服务费	2,029.72	2,210.06
应付投资顾问费	-	-
应交税费	226.08	7,475.22
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	120,972.57	216,267.52
负债合计	9,363,141.97	1,377,808.43
净资产：	-	-
实收基金	9,374,469.93	178,438,909.41
未分配利润	-7,663.66	-5,475,155.72
净资产合计	9,366,806.27	172,963,753.69
负债和净资产总计	18,729,948.24	174,341,562.12

注：1.报告截止日 2024 年 12 月 17 日（基金最后运作日），基金份额总额 9,374,469.93 份，其中国泰诚益混合型证券投资基金 A 类基金份额的份额净值 1.0067 元，A 类基金份额 6,630,683.60 份；国泰诚益混合型证券投资基金 C 类基金份额的份额净值 0.9810 元，C 类基金份额 2,743,786.33 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 17 日（基金最后运作日）。

3.2 利润表

会计主体：国泰诚益混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 17 日（基金最后运作日）止 期间	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间
一、营业总收入	2,453,862.24	-3,051,323.35
1. 利息收入	120,501.65	130,538.01
其中：存款利息收入	65,885.49	75,744.20
债券利息收入	845.90	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	53,770.26	54,793.81
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以	-713,219.42	-2,250,445.86

“-” 填列)		
其中：股票投资收益	-1,964,438.62	-5,730,642.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,344,681.89	2,783,748.74
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-99,041.99	-
股利收益	5,579.30	696,448.31
其他投资收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,016,021.43	-931,500.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	30,558.58	85.40
减：二、营业总支出	933,362.33	1,805,820.00
1. 管理人报酬	483,549.97	1,224,784.28
2. 托管费	120,887.50	306,196.00
3. 销售服务费	130,648.15	41,986.07
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	31,874.40	8,013.80
其中：卖出回购金融资产支出	31,874.40	8,013.80
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	4,263.23	12,302.32
8. 其他费用	162,139.08	212,537.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,520,499.91	-4,857,143.35
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,520,499.91	-4,857,143.35
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	1,520,499.91	-4,857,143.35

3.3 净资产变动表

会计主体：国泰诚益混合型证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12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	178,438,909.41	-5,475,155.72	172,963,753.69

二、本期期初净资产	178,438,909.41	-5,475,155.72	172,963,753.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-169,064,439.48	5,467,492.06	-163,596,947.42
（一）、综合收益总额		1,520,499.91	1,520,499.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-169,064,439.48	3,946,992.15	-165,117,447.33
其中：1.基金申购款	188,096,822.09	-5,742,018.13	182,354,803.96
2.基金赎回款	-357,161,261.57	9,689,010.28	-347,472,251.29
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	9,374,469.93	-7,663.66	9,366,806.27
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	334,054,655.98	1,842,105.90	335,896,761.88
二、本期期初净资产	334,054,655.98	1,842,105.90	335,896,761.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-155,615,746.57	-7,317,261.62	-162,933,008.19
（一）、综合收益总额	-	-4,857,143.35	-4,857,143.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-155,615,746.57	-2,460,118.27	-158,075,864.84
其中：1.基金申购款	176,773.32	-4,545.98	172,227.34
2.基金赎回款	-155,792,519.89	-2,455,572.29	-158,248,092.18

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	178,438,909.41	-5,475,155.72	172,963,753.69

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰诚益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[2021]1061号文《关于准予国泰诚益混合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《国泰诚益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 304,724,374.50 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(2021)第 0432 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰诚益混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 304,791,773.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 67,398.67 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《国泰诚益混合型证券投资基金基金合同》和《国泰诚益混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费/申购费用和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金份额时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,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。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《国泰诚益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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、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、地方政府债、政府支持机构债券、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)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、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相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-40%，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 40%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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。本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债综合指数收益率×80%。

4.2 清算原因

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：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 12 月 16 日日终，本基金的基金资产净值连续 50 个工作日低于 5000 万元，已触发基金合同终止的上述情形，本基金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。

4.3 清算起始日

本基金清算期为2024年12月18日至2025年1月2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、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2024年12月18日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（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。

4.4 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。

5 清算情况

自 2024 年 12 月 18 日至 2025 年 1 月 2 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《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，本基金清算期间的律师费由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2025年1月2日），各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日活期存款余额人民币 11,103,048.65 元，结算备付金余额 476,551.18 元，存出保证金余额 7,268.90 元。截至清算结束日 2025 年 1 月 2 日，活期存款余额 6,326,356.14 元，包含基金管理人于 2024 年 12 月 25 日划入的垫付资金 100,000.00 元，结算备付金余额 70,883.76 元，存出保证金余额 7,245.88 元。

（2）本基金最后运作日交易性金融资产余额人民币 4,870,285.61 元，截至清算结束日 2025 年 1 月 2 日，以上资产均已变现，实际变现金额为 4,864,334.69 元。

（3）本基金最后运作日应收清算款人民币 2,272,793.90 元。截至清算结束日 2025 年 1 月 2 日以上清算款已全部交收。

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 9,229,832.92 元，截至清算结束日 2025 年 1 月 2 日，以上应付赎回款已全部划出。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 8,064.54 元，应付托管费人民币 2,016.14 元，应付销售服务费人民币 2,029.72 元，应交税费人民币 226.08 元。截至清算结束日 2025 年 1 月 2 日以上费用已全部支付。

（3）本基金最后运作日其他负债人民币 120,972.57 元，包括应付赎回费 575.00 元，应付券商佣金人民币 8,743.54 元，应付银行间交易费用人民币 1,283.05 元，应付银行汇划手续费人民币 436.19 元，预提审计费人民币 6,000.00 元，预提信息披露费人民币 103,934.79 元。截至清算结束日除银行汇划手续费、审计费、信披费将于近期支付外其他费用已全部支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年12月18日（基金清算起始日）至2025 年1月2日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	-5,646.03
1.利息收入	1,072.64
其中：存款利息收入	1,072.64
债券利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	128,939.48
其中：股票投资收益	15,853.17
基金投资收益	-
债券投资收益	113,553.76
股利收益	-467.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-135,664.23
4.其他业务收入	6.08
二、清算费用	362.94
1.其他费用	362.94
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-6,008.97

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，截至清算结束日2025年1月2日本基金剩余财产为人民币6,194,114.80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2024年12月18日至最终清算款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，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2024年12月25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2025年1月2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6,326,356.14元，其中人民币100,000.00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、《国泰诚益混合型证券投资基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 17 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《国泰诚益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 15-20 层。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

国泰诚益混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二五年一月二日