

# 国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

公告日期：2025年7月4日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2020]2528号文《关于准予国泰金福三个月定期开放混合型发起式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《国泰金福三个月定期开放混合型发起式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1,009,998,000.00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0025号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2021年1月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,010,003,250.53份基金份额,其中认购资金利息折合5,250.53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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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》生效满三年后基金继续存续的,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2025年6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,无需召开基金份额持有人大会审议。

本基金清算期为2025年6月18日至2025年6月24日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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2025年6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

<b>1</b>	<b>重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
<b>2</b>	<b>基金概况</b> .....	<b>4</b>
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
<b>3</b>	<b>基金最后运作日财务会计报告（经审计）</b> .....	<b>5</b>
3.1	资产负债表.....	5
3.2	利润表.....	6
3.3	净资产变动表.....	7
<b>4</b>	<b>清盘事项说明</b> .....	<b>9</b>
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
<b>5</b>	<b>清算情况</b> .....	<b>11</b>
5.1	清算费用.....	11
5.2	资产处置情况.....	11
5.3	负债清偿情况.....	12
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.....	13
5.6	基金财产清算报告的告知安排.....	13
<b>6</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>13</b>
6.1	备查文件目录.....	13
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	国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	国泰金福三个月定期开放混合
基金主代码	010446
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
基金合同生效日	2021年1月7日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
2025年6月17日(基金最后运作日) 基金份额总额	10,005,301.76份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略：（1）大类资产配置策略；（2）股票投资策略；（3）债券投资策略；（4）资产支持证券投资策略；（5）股指期货投资策略；（6）国债期货投资策略；（7）信用衍生品投资策略；（8）融资与转融通证券出借投资策略。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险、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	兴业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李昇	冯萌
	联系电话	021-31081600转	021-52629999-213310
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95561
传真		021-31081800	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398号兴业银行大厦
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	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		200082	200120
法定代表人		周向勇	吕家进

### 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：国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025年6月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2025年6月17日 (基金最后运作日)	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	2,676,754.28	20,751,224.17
结算备付金	14,334.57	445,732.23
存出保证金	319,076.38	162,384.95
交易性金融资产	5,256,883.71	339,903,143.73
其中：股票投资	5,256,883.71	339,903,143.73
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	1,803,181.05
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,267,048.94	363,065,666.13
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末 2025年6月17日 (基金最后运作日)</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
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	-	19.25
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,605.14	360,297.48
应付托管费	200.30	20,016.52
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	68,540.53	474,549.94
负债合计	72,345.97	854,883.19
<b>净资产:</b>		
实收基金	10,005,301.76	502,577,983.68
未分配利润	-1,810,598.79	-140,367,200.74
净资产合计	8,194,702.97	362,210,782.94
负债和净资产总计	8,267,048.94	363,065,666.13

注：报告截止日 2025 年 6 月 17 日（基金最后运作日），基金份额总额 10,005,301.76 份，基金份额净值 0.8190 元。

### 3.2 利润表

会计主体：国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 6月17日（基金最后运作 日）止期间	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日止期间

一、营业总收入	17,969,386.64	66,029,236.04
1.利息收入	35,588.79	173,754.75
其中：存款利息收入	35,588.79	173,754.75
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	30,203,912.11	-33,403,988.75
其中：股票投资收益	30,348,327.30	-52,584,708.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	-144,415.19	19,180,719.27
其他投资收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-12,270,114.26	99,259,470.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、营业总支出	920,309.90	7,041,669.42
1. 管理人报酬	820,954.70	6,532,439.69
2. 托管费	45,608.64	362,913.28
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	-	-
8. 其他费用	53,746.56	146,316.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	17,049,076.74	58,987,566.62
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	17,049,076.74	58,987,566.62
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	17,049,076.74	58,987,566.62

### 3.3 净资产变动表

会计主体：国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6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	502,577,983.68	-140,367,200.74	362,210,782.94
二、本期期初净资产	502,577,983.68	-140,367,200.74	362,210,782.94
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-492,572,681.92	138,556,601.95	-354,016,079.97
（一）、综合收益总额	-	17,049,076.74	17,049,076.74
（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）	-492,572,681.92	121,507,525.21	-371,065,156.71
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-492,572,681.92	121,507,525.21	-371,065,156.71
（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	10,005,301.76	-1,810,598.79	8,194,702.97
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	1,191,894,881.82	-411,362,562.64	780,532,319.18
二、本期期初净资产	1,191,894,881.82	-411,362,562.64	780,532,319.18
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-689,316,898.14	270,995,361.90	-418,321,536.24
（一）、综合收益总额	-	58,987,566.62	58,987,566.62
（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）	-689,316,898.14	212,007,795.28	-477,309,102.86
其中：1.基金申购款	5.58	-1.60	3.98
2.基金赎回款	-689,316,903.72	212,007,796.88	-477,309,106.84
（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	502,577,983.68	-140,367,200.74	362,210,782.94

## 4 清盘事项说明

### 4.1 基金基本情况

国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2020]2528号文《关于准予国泰金福三个月定期开放混合型发起式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《国泰金福三个月定期开放混合型发起式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1,009,998,000.00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0025号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年1月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,010,003,250.53份基金份额,其中认购资金利息折合5,250.53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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的相关规定,本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金的封闭期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)起或自每一开放期结束之日次日(包括该日)起3个月的期间。本基金在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。每一开放期自封闭期结束之日后第一个工作日(包括该日)起最长不超过10个工作日,为了更好地满足投资者需求,基金管理人决定自2021年3月3日起调整本基金开放期设置,将每一开放期由最长不超过10个工作日调整为最长不超过20个工作日。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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,005,250.53份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和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(包含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、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)、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、现金、国债期货、股指期货、信用衍生品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

将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，但在每个开放期的前 10 个交易日、开放期及开放期结束后 10 个交易日期间内，基金投资不受上述投资组合比例的限制。在开放期内，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，应当保留的现金或者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%，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，但在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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%。

#### 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》生效满三年后基金继续存续的，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 2025 年 6 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，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### 4.3 清算起始日

本基金清算期为 2025 年 6 月 18 日至 2025 年 6 月 24 日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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 2025 年 6 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。

由于本基金于清算结束日仍持有流通受限股票导致部分资产未变现，因此需要进行二次或多次清算，待至本基金所持流通受限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。

## 5 清算情况

自 2025 年 6 月 18 日至 2025 年 6 月 24 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剩余财产中支付。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 6 月 24 日），各项资产处置情况如下（单位：人民币元）：

（1）本基金最后运作日，活期存款 2,676,754.28 元，结算备付金 14,334.57 元，存出保证金 319,076.38 元。截至清算结束日，活期存款 7,539,105.40 元，结算备付金 14,179.13 元，存出保证金 318,827.64 元。

（2）本基金最后运作日，交易性金融资产 5,256,883.71 元，均为交易性股票投资，其中流通受限股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	估值单价 (人民币元)	估值金额 (人民币元)
1	688411	海博思创	560.00	74.61	41,781.60
2	688545	兴福电子	994.00	25.73	25,575.62
3	688583	思看科技	175.00	105.97	18,544.75
4	688757	胜科纳米	536.00	17.68	9,476.48
5	688758	赛分科技	777.00	15.64	12,152.28
6	301173	毓恬冠佳	173.00	41.16	7,120.68
7	301275	汉朔科技	332.00	54.00	17,928.00
8	301479	弘景光电	182.00	61.03	11,107.46
9	301501	恒鑫生活	316.00	42.95	13,572.20
10	301535	浙江华远	734.00	14.37	10,547.58
11	301585	蓝宇股份	273.00	34.34	9,374.82
12	301601	惠通科技	342.00	34.06	11,648.52
13	301602	超研股份	658.00	24.86	16,357.88

14	301658	首航新能	437.00	21.53	9,408.61
15	301662	宏工科技	32.00	80.58	2,578.56
16	301665	泰禾股份	393.00	24.54	9,644.22
17	603072	天和磁材	226.00	53.42	12,072.92
18	603120	肯特催化	22.00	29.69	653.18
19	603124	江南新材	88.00	33.26	2,926.88
20	603194	中力股份	291.00	41.96	12,210.36
21	603210	泰鸿万立	286.00	15.31	4,378.66
22	603257	中国瑞林	78.00	36.63	2,857.14
23	603271	永杰新材	126.00	34.25	4,315.50
24	603409	汇通控股	100.00	32.45	3,245.00
25	001335	信凯科技	80.00	27.73	2,218.40
26	001356	富岭股份	709.00	14.25	10,103.25
27	001382	新亚电缆	366.00	15.43	5,647.38
28	001391	国货航	2,954.00	6.79	20,057.66
29	001395	亚联机械	80.00	46.37	3,709.60

截至清算结束日，交易性金融资产 299,179.22 元，均为交易性股票投资，由于本基金于清算结束日仍持有流通受限股票导致部分资产未变现，因此需要进行二次或多次清算，待至本基金所持流通受限股票变现后将及时进行再次分配。

(3) 截至清算结束日，应收证券清算款 94,368.92 元（由于清算期间股票变现产生），将于 2025 年 6 月 25 日清算交收。

### 5.3 负债清偿情况

截至本次清算期结束日（2025 年 6 月 24 日），各项负债清偿情况如下（单位：人民币元）：

(1) 本基金最后运作日，应付管理人报酬 3,605.14 元，应付托管费 200.30 元。截至清算结束日，以上费用均已支付。

(3) 本基金最后运作日，其他负债 68,540.53 元，其中应付佣金 19,142.89 元、预提审计费用 6,000.00 元、预提信披费用 43,397.64 元。清算期间，已于 2025 年 6 月 20 日支付审计费用，由于股票变现产生应付佣金 2,266.91 元。截至清算结束日，其他负债 64,807.44 元，其中应付佣金 21,409.80 元、预提信披费用 43,397.64 元，待至日后支付。

### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 6 月 18 日（基金清算起始日）起至 2025 年 6 月 24 日（基金清算结束日）止期间

<b>一、资产处置损益</b>	<b>6,149.90</b>
1.利息收入	329.80
其中：存款利息收入	329.80
2.投资收益（损失以“-”填列）	379,983.05
其中：股票投资收益	383,835.84
股利收益	-3,852.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-374,162.95
<b>二、清算费用</b>	<b>-</b>
<b>三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>6,149.90</b>

### 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 6 月 24 日，本基金剩余财产为 8,200,852.87 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 2025 年 6 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。

截至 2025 年 6 月 24 日日终，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 7,539,105.40 元。

### 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、《国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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《国泰金福三个月定期开放混合型发起式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。

国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二五年六月二十四日