

国泰现金宝货币市场基金清算报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

公告日期：2017年11月22日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰现金宝货币市场基金(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]2291号《关于准予国泰现金宝货币市场基金注册的批复》注册,由基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称基金管理人)向社会公开募集,《国泰现金宝货币市场基金基金合同》于2017年3月8日正式生效。本基金的基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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》和《国泰现金宝货币市场基金基金合同》(以下简称《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《关于终止国泰现金宝货币市场基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会投票表决起止时间为自2017年9月12日起至2017年10月16日17:00止,本次会议议案于2017年10月17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2017年10月18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《国泰现金宝货币市场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2017年10月18日起进入清算期。

本基金清算期为2017年10月18日至2017年10月23日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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2017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 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 所有者权益(基金净值)变动表 7

4 清盘事项说明 7

4.1 基金基本情况 7

4.2 清算原因 8

4.3 清算起始日 8

4.4 清算报表编制基础 8

5 清算情况 9

5.1 清算费用 9

5.2 资产处置情况 9

5.3 负债清偿情况 9

5.4 清算期间的清算损益情况 10

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况 10

5.6 基金财产清算报告的告知安排 10

6 备查文件目录 11

6.1 备查文件目录 11

6.2 存放地点 11

6.3 查阅方式 11

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称 国泰现金宝货币市场基金

基金简称 国泰现金宝货币

基金主代码 003552

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年3月8日

基金管理人 国泰基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

2017年10月18日基金份额总额 138,282.68份

2.2 基金产品说明

投资目标 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。

业绩比较基准 同期七天通知存款利率（税后）。

风险收益特征 本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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 交通银行股份有限公司

信息披露负责人 姓名 李永梅 陆志俊

联系电话 021-31081600 转 95559

电子邮箱 xinxipilu@gtfund.com luzj@bankcomm.com

客户服务电话 (021) 31089000, 400-888-8688 95559

传真 021-31081800 021-62701216

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 上海市浦东新区银城中路188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 上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码 200082 200120

法定代表人 陈勇胜 牛锡明

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：国泰现金宝货币市场基金

报告截止日：2017年10月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产 本期末

2017年10月17日

(基金最后运作日)

资产： -

银行存款 590,842.65

结算备付金 -

存出保证金 -
交易性金融资产 -
其中：股票投资 -
债券投资 -
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 1,131.98
应收股利 -
应收申购款 -
递延所得税资产 -
其他资产 -
资产总计 591,974.63
负债和所有者权益 本期末
2017年10月17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 448,437.81
应付管理人报酬 65.20
应付托管费 17.18
应付销售服务费 85.77
应付交易费用 -
应交税费 -
应付利息 -
应付利润 30.24
递延所得税负债 -
其他负债 5,000.00
负债合计 453,636.20
所有者权益： -
实收基金 138,338.43
未分配利润 -
所有者权益合计 138,338.43
负债和所有者权益总计 591,974.63

注：1、报告截止日 2017 年 10 月 17 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 138,338.43 份，均为 A 类基金份额。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 8 日（合同生效日）至 2017 年 10 月 17 日（基金最后运作日）。

3.2 利润表

会计主体：国泰现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 3 月 8 日（合同生效日）至 2017 年 10 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目 本期

2017年3月8日（合同生效日）至2017年10月17日（基金最后运作日）止期间

一、收入 96,455,612.85

1.利息收入 96,465,713.39

其中：存款利息收入 45,945,497.00

债券利息收入 46,219,382.93

资产支持证券利息收入 -

买入返售金融资产收入 4,300,833.46

其他利息收入 -

2.投资收益（损失以-填列） -10,100.54

其中：股票投资收益 -

基金投资收益 -

债券投资收益 -10,100.54

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 6,028,419.66

1. 管理人报酬 4,072,323.92

2. 托管费 1,071,664.21

3. 销售服务费 218,782.27

4. 交易费用 -

5. 利息支出 349,301.18

其中：卖出回购金融资产支出 349,301.18

6. 其他费用 316,348.08

三、利润总额（亏损总额以-号填列） 90,427,193.19

减：所得税费用 -

四、净利润（净亏损以-号填列） 90,427,193.19

3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰现金宝货币市场基金

本报告期：2017年3月8日（合同生效日）至2017年10月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目 本期

2017年3月8日（合同生效日）至2017年10月17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） 200,076,619.86 - 200,076,619.86

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） - 90,427,193.19 90,427,193.19

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） -199,938,281.43 - -199,938,281.43

其中：1.基金申购款 8,703,702,988.39 - 8,703,702,988.39

2.基金赎回款 -8,903,641,269.82 - -8,903,641,269.82

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） --90,427,193.19 -90,427,193.19

五、期末所有者权益（基金净值） 138,338.43 - 138,338.43

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

本基金经中国证监会证监许可[2016]2291号《关于准予国泰现金宝货币市场基金注册的批复》注册，由基金管理人国泰基金管理有限公司向社会公开募集，《国泰现金宝货币市场基金基金合同》于2017年3月8日正式生效。本基金的基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰现金宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期7天通知存款利率（税后）。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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》和《国泰现金宝货币市场基金基金合同》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《关于终止国泰现金宝货币市场基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会投票表决起止时间为自2017年9月12日起至2017年10月16日17:00止，本次会议议案于2017年10月17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2017年10月18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《国泰现金宝货币市场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2017年10月18日起进入清算期。

本基金清算期为2017年10月18日至2017年10月23日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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2017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

本基金基金份额持有人大会审议通过《关于终止国泰现金宝货币市场基金基金合同有关事项的议案》。

4.3 清算起始日

根据生效的本基金份额持有人大会决议，本基金于2017年10月18日起进入清算期，清算期为2017年10月18日至2017年10月23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2017年10月18日至2017年10月23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《国泰现金宝货币市场基金基金合同》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。

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，本基金的清算费用由基金管理人代为支付。

5.2 资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款人民币590,842.65元，于2017年10月18日支付赎回款39.25元，并产生银行费用5.00元，于2017年10月19日支付赎回款448,436.30元，于2017年10月20日支付赎回款48.25元，支付管理费、托管费和销售服务费共168.15元。

（2）本基金最后运作日应收利息人民币1,131.98元，该款项由基金管理人国泰基金管理有限公司以自有资金垫付，并于2017年10月17日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日期孳生的利息归基金所有。

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 448,437.81 元, 该款项已于 2017 年 10 月 18 日支付 1.51 元, 于 2017 年 10 月 19 日支付 448,436.30 元。

(2) 本基金最后运作日应付基金管理人报酬为人民币 65.20 元, 该款项已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费人民币 17.18 元, 该款项已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费人民币 85.77 元, 该款项已于 2017 年 10 月 20 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付利润人民币 30.24 元, 该款项已于 2017 年 10 月 18 日红利再投为基金份额。

(6) 本基金最后运作日其他负债人民币 5,000.00 元, 该款项为基金管理人垫付资金, 用于垫付未变现的应收银行存款利息。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目 本期

2017 年 10 月 18 日(基金开始清算日)至 2017 年 10 月 23 日(基金结束清算日)止期间

一、资产处置损益 26.03

1.利息收入 26.03

其中: 存款利息收入 26.03

2.投资收益(损失以-填列) -

其中: 股票投资收益 -

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 5.00

1. 交易费用 -

2. 其他费用 5.00

三、清算净损益(净亏损以-号填列) 21.03

注: 其他费用为银行汇划费用。

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 2017 年 10 月 23 日本基金剩余财产为人民币 138,300.87 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 2017 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 2017 年 10 月 17 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、《国泰现金宝货币市场基金 2017 年 3 月 8 日(合同生效日)至 2017 年 10 月 17 日(基金最后运作日)止期间的特殊目的财务报表及审计报告》

2、通力律师事务所关于《国泰现金宝货币市场基金基金清算报告》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。

国泰现金宝货币市场基金基金财产清算小组

二〇一七年十月二十三日