

# 国泰安心回报混合型证券投资基金

## 2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 月 5 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

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2018 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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》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。本基金已于 2018 年 8 月 29 日起暂停申购业务，但正常开放赎回业务。自 2018 年 9 月 6 日起，本基金将进入清算程序，清算期间不再办理申购、赎回等业务，不再收取基金管理费、基金托管费。基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。基金财产清算小组将按照法律法规、《基金合同》的规定以诚实信用、勤勉尽责的原则履行相关职责。基金财产清算结果将在报中国证监会备案后公告，并将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时分配，敬请投资者留意。具体可查阅本基金管理人于 2018 年 8 月 30 日披露的《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》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 5 日（基金最后运作日）止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰安心回报混合
------	----------

基金主代码	002204
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,838,458.26 份
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	<p>本基金采用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例，以实现本基金的投资目标。</p> <p>1、采用 CPPI 策略进行资产配置</p> <p>本基金以 3 年为一个投资周期滚动运作，每个投资周期以恒定比例组合保险策略为依据，动态调整风险资产和无风险资产的配置比例，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益。无风险资产一般是指固定收益类资产，风险资产一般是指股票等权益类资产。</p> <p>CPPI 是国际通行的一种投资组合保险策略，它主要是通过数量分析，根据市场的波动来调整、修正风险资产的可放大倍数（风险乘数），以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。本基金每个投资周期当期内净值收益率在 15%以内时，股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 40%；当期内净值收益率大于等于 15%时，股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 60%。</p> <p>本处净值收益率的计算方式如下：</p> <p>在该投资周期内任一时间 <math>t</math> (<math>t &gt; 0</math>)</p>

	<p>净值收益率 = <math>NAV_t / NAV_0 - 1</math></p> <p>NAV<sub>0</sub>: 该投资周期期初的基金份额累计净值</p> <p>NAV<sub>t</sub>: 该投资周期内任一时间 t 的基金份额累计净值</p> <p>通过前述投资方法,一方面由债券类资产为权益投资的波动提供安全垫,以争取为组合实现本金安全,另一方面,根据安全垫的厚度不同,以有限的不同比例投资于权益类资产,以争取为组合创造超额收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金注重对股市趋势的研究,根据 CPPI 策略,控制股票市场下跌风险,分享股票市场成长收益。</p> <p>本基金的股票投资以价值选股、组合投资为原则,通过选择高流动性股票,保证组合的高流动性;通过选择具有高安全边际的股票,保证组合的收益性;通过分散投资、组合投资,降低个股风险与集中度风险。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>1) 本基金核心债券资产按买入并持有方式操作以保证债券组合收益的稳定性,尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。</p> <p>2) 综合考虑收益性、流动性和风险性,进行积极投资。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会,利用杠杆原理以及各种衍生工具,增加盈利性、控制风险等等,以争取获得适当的超额收益,提高整体组合收益率。</p> <p>4、股指期货交易策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。</p>
--	---

	<p>(1) 套保时机选择策略</p> <p>根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析，决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。</p> <p>(2) 期货合约选择和头寸选择策略</p> <p>在套期保值的现货标的确认之后，根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约，运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸，对套期保值的现货标的 Beta 值进行动态的跟踪，动态的调整套期保值的期货头寸。</p> <p>(3) 展期策略</p> <p>当套期保值的时间较长时，需要对期货合约进行展期。理论上，不同交割时间的期货合约价差是一个确定值；现实中，价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差，选择合适的交易时机进行展期。</p> <p>(4) 保证金管理</p> <p>本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。</p> <p>(5) 流动性管理策略</p> <p>利用股指期货的现货替代功能和其金融衍生品交易成本低廉的特点，可以作为管理现货流动性风险的工具，降低现货市场流动性不足导致的交易成本过高的风险。在基金建仓期或面临大规模赎回时，大规模的股票现货买进或卖出交易会造市场的剧烈动荡产生较大的冲击成本，此时基金管理人将考虑运用股指期货来化解冲击成本的风险。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p>
--	--

	<p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>7、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p>
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。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	<p>报告期</p> <p>(2018 年 7 月 1 日-2018 年 9 月 5 日)</p>
--------	---

1. 本期已实现收益	-52,567.42
2. 本期利润	-49,777.42
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0111
4. 期末基金资产净值	1,838,991.80
5. 期末基金份额净值	1.000

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（3）本报告期间为2018年7月1日至2018年9月5日（基金最后运作日）。

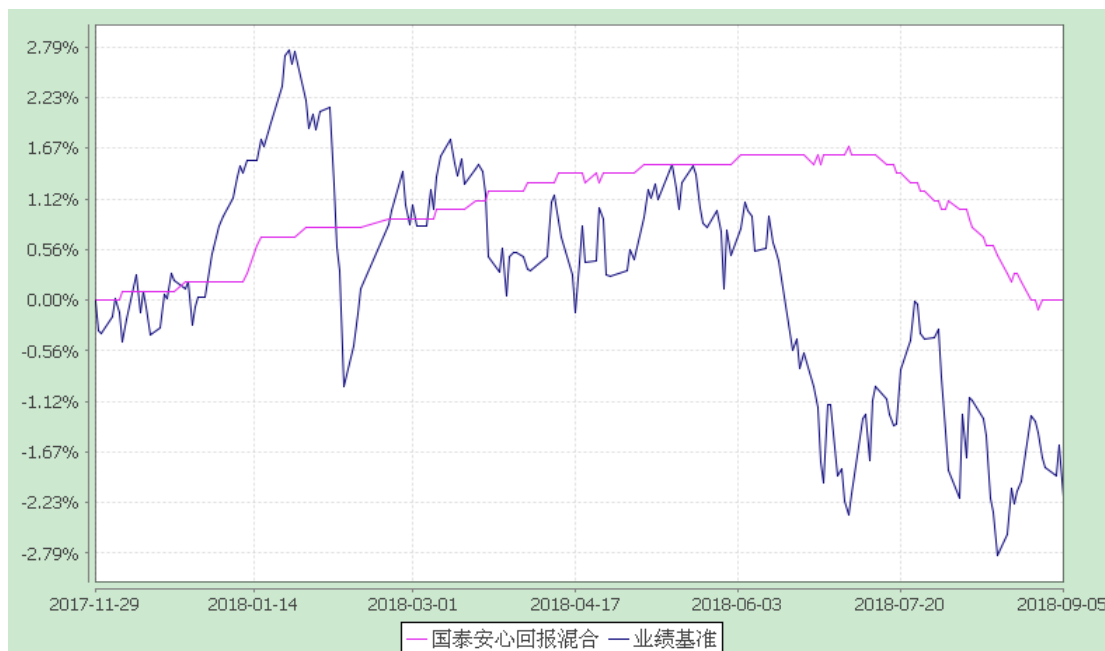
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018年7月1日至2018年9月5日（基金最后运作日）	-1.57%	0.07%	-1.03%	0.41%	-0.54%	-0.34%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰安心回报混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2017年11月29日至2018年9月5日）



注：（1）本基金合同生效日为2017年11月29日，截止至2018年9月5日，本基金运作时间未  
满一年；

（2）本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定；

（3）本报告期间为2018年7月1日至2018年9月5日（基金最后运作日）。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴晨	本基金的基金经理、国泰金龙债券、国泰信用互利分级债券、国泰双利债券、国泰新	2017-11-29	2018-09-05	16 年	硕士研究生，CFA，FRM。2001 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004 年 9 月至 2005 年 10 月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005 年 10 月至 2008 年 3 月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008 年 4 月至 2009 年 3 月在长信基金管理有限公司



	<p>目标收益保本混合、国泰鑫保本混合、国泰民安增益纯债债券、国泰中国企业信用精选债券（QDII）、国泰招惠收益定期开放债券、国泰瑞和纯债债券的基金经理、绝对收益投资（事业）部总监、固收投资总监</p>			<p>从事债券研究；2009 年 4 月至 2010 年 3 月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010 年 4 月起任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理；2010 年 9 月至 2011 年 11 月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2011 年 12 月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理；2012 年 9 月至 2013 年 11 月任国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 10 月起兼任国泰双利债券证券投资基金的基金经理；2016 年 1 月起兼任国泰新目标收益保本混合型证券投资基金和国泰鑫保本混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 4 月任国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 4 月任国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 8 月任国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 9 月起兼任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）的基金经理，2017 年 11 月至 2018 年 9 月任国泰安心回报混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月至 2018 年 8 月任国泰安惠收益定期开放</p>
--	---	--	--	--

					<p>债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月起兼任国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理，2018 年 9 月起兼任国泰瑞和纯债债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月至 2015 年 5 月任绝对收益投资（事业）部总监助理，2015 年 5 月至 2016 年 1 月任绝对收益投资（事业）部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作），2017 年 7 月起任固收投资总监，2018 年 7 月起任绝对收益投资（事业）部总监。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年 7 月下旬，国务院常委会释放从“稳信用”转向“宽信用”的信号，叠加央行对 MPA 考核参数的松口进一步推升了对信用宽松的预期，市场风险偏好有所修复，但短端受流动性充裕影响收益率快速下行，期限利差走阔；7 月末融资增速再度下行，基建投资增速大幅下滑拖累固定资产投资，经济悲观预期受到数据印证，收益率小幅回调后继续下行；8 月中旬以来，非洲猪瘟和寿光水灾、租金大幅上涨引发再通胀担忧，地方债集中供给冲击以及传闻地方债风险权重调整，市场对宽信用政策的落地效果仍保持相对谨慎，收益率震荡上行；9 月末，美联储加息靴子落地，国内央行并未跟随上调公开市场利率，货币市场通过 MLF、降准等超预期投放资金，基本面走弱得到政策确认，收益率转而下行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自 2018 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 5 日（基金最后运作日）的净值增长率为-1.57%，同期业绩比较基准收益率为-1.03%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，资管新规相关配套政策相继平稳发布，对市场冲击有限，未来影响市场的核心因素仍在于基本面。9 月中采、汇丰 PMI 纷纷下滑，显示生产需求双双走弱，宽信用传导不畅，叠加海外局势动荡，基本面压力仍大。目前来看，地方政府债务及地产融资未有放松，政策对经济的托底效果存疑。10 月仍有大量地方政府专项债待发，后续基建投资的改善有待观察。近期美债收益率再次飙升，中美利差收窄至近 10 年低点，资本外流担

忧加剧，叠加通胀仍有上行压力，短期或对市场情绪有所影响。但考虑到经济下行压力下，通胀及汇率对货币政策制约有限，货币政策预计仍将保持宽松，短期利空更多是情绪冲击，不改利率下行趋势。信用市场方面负面事件频发，宽货币向宽信用传导不畅，市场风险偏好、企业融资环境未有明显改善。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金已超过连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元。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》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。本基金的最后运作日定为 2018 年 9 月 5 日。自 2018 年 9 月 6 日起，本基金将进入清算程序，基金财产清算结果将在报中国证监会备案后公告，并将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分配，敬请投资者留意。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,406,720.00	64.67
	其中：债券	1,406,720.00	64.67
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	741,847.00	34.10
7	其他各项资产	26,744.98	1.23
8	合计	2,175,311.98	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,406,720.00	76.49
	其中：政策性金融债	1,406,720.00	76.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,406,720.00	76.49

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开 1701	14,000	1,406,720.00	76.49

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	373.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,371.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,744.98

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	13,053,787.79
报告期基金总申购份额	31,349.38
减：报告期基金总赎回份额	11,246,678.91

报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,838,458.26

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,023,080.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	9,023,080.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2018-07-02	1,051,000.00	-1,067,282.09	0.05%
2	赎回	2018-07-03	946,000.00	-960,655.43	0.05%
3	赎回	2018-07-04	851,000.00	-864,183.69	0.05%
4	赎回	2018-07-05	766,000.00	-777,866.87	0.05%
5	赎回	2018-07-06	690,000.00	-701,379.13	0.05%
6	赎回	2018-07-09	621,000.00	-630,620.53	0.05%
7	赎回	2018-07-10	558,000.00	-566,644.54	0.05%
8	赎回	2018-07-11	503,000.00	-510,792.48	0.05%
9	赎回	2018-07-12	452,000.00	-459,002.38	0.05%
10	赎回	2018-07-13	407,000.00	-413,305.24	0.05%
11	赎回	2018-07-16	366,000.00	-371,670.07	0.05%
12	赎回	2018-07-17	550,000.00	-557,970.87	0.05%
13	赎回	2018-07-18	500,000.00	-507,246.25	0.05%
14	赎回	2018-07-19	450,000.00	-456,521.62	0.05%
15	赎回	2018-07-20	312,080.00	-316,290.90	0.05%
合计			9,023,080.00	-9,161,432.09	

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------



类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份 额	申购份 额	赎回份 额	持有份 额	份 额占比
机构	1	2018 年 7 月 1 日 至 2018 年 7 月 17 日	9,023, 080.00	-	9,023,08 0.00	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》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。本基金已于 2018 年 8 月 29 日起暂停申购业务，但正常开放赎回业务。自 2018 年 9 月 6 日起，本基金将进入清算程序，清算期间不再办理申购、赎回等业务，不再收取基金管理费、基金托管费。基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。基金财产清算小组将按照法律法规、《基金合同》的规定以诚实信用、勤勉尽责的原则履行相关职责。基金财产清算结果将在报中国证监会备案后公告，并将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时分配，敬请投资者留意。具体可查阅本基金管理人于 2018 年 8 月 30 日披露的《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》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰安心回报混合型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰安心回报混合型证券投资基金基金合同
- 3、国泰安心回报混合型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

## 9.2 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 层-19 层。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼。

## 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一八年十月二十五日