

# 国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接 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：中国建设银行股份有限公司

公告日期：2018 年 11 月 30 日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2013]11 号《关于核准上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,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《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,206,038,942.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司予以验证。经向中国证监会备案,《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于 2013 年 3 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,206,309,191.14 份基金份额,其中认购资金利息折合 270,249.11 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为维护基金份额持有人利益,基金管理人根据《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》和《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《关于终止国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。会议投票表决时间为 2018 年 9 月 17 日起至 2018 年 10 月 15 日 17:00 止。本次会议议案于 2018 年 10 月 16 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 2018 年 10 月 17 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《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接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,本基金的最后运作日定为 2018 年 10 月 16 日,并于 2018 年 10 月 17 日进入财产清算期。

本基金清算期为 2018 年 10 月 17 日到 2018 年 11 月 8 日。由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、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 2018 年 10 月 17 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

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金概况</b>	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	5
<b>3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）</b>	5
3.1 资产负债表	5
3.2 利润表	7
3.3 所有者权益（基金净值）变动表	8
<b>4 清盘事项说明</b>	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	11
<b>5 清算情况</b>	11
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	13
5.6 基金财产清算报告的告知安排	13
<b>6 备查文件目录</b>	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	国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	国泰上证 5 年期国债 ETF 联接
基金代码	国泰上证 5 年期国债 ETF 联接 A: 020035 国泰上证 5 年期国债 ETF 联接 C: 020036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 7 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
2018 年 10 月 16 日基金份额总额	8,534,643.87 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	511010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 5 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 25 日
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标 ETF。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	上证 5 年期国债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于债券基金，其预期收益及风险水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金属于国债指数基金，是债券基金中投资风险较低的品种。属于低风险、低收益的开放式基金。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，采用优化抽样复制法。通过对标的指数中各成份国债的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的国债构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证 5 年期国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券基金，其预期收益及风险水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金属于国债指数基金，是债券基金中投资风险较低的品种。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪上证 5 年期国债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李永梅
	联系电话	021-31081600转
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com
客户服务电话	(021) 31089000, 400-888-8688	010-67595096
传真	021-31081800	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码	200082	100033
法定代表人	陈勇胜	田国立

## 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：国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 10 月 16 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2018年10月16日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	15,218.19	1,048,778.20
结算备付金	2,105.42	21,550.31
存出保证金	1,947.37	1,354.89
交易性金融资产	8,453,329.34	8,364,387.10
其中：股票投资	-	-
基金投资	7,900,414.34	7,885,155.10
债券投资	552,915.00	479,232.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
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	12,166.72	10,864.89
应收股利	-	-
应收申购款	-	286,189.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>8,484,767.04</b>	<b>9,733,124.39</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018年10月16日 (基金最后运作日)</b>	<b>上年度末 2017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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	173,906.69	405,087.49
应付管理人报酬	76.09	228.75
应付托管费	25.32	76.29
应付销售服务费	462.29	778.66
应付交易费用	-	-
应交税费	175.59	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	36,022.47	20,011.76
<b>负债合计</b>	<b>210,668.45</b>	<b>426,182.95</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-

实收基金	8,534,643.87	9,835,976.27
未分配利润	-260,545.28	-529,034.83
<b>所有者权益合计</b>	<b>8,274,098.59</b>	<b>9,306,941.44</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>8,484,767.04</b>	<b>9,733,124.39</b>

注：报告截止日 2018 年 10 月 16 日（基金最后运作日），国泰上证 5 年期国债 ETF 联接 A 基金份额净值 0.960 元，国泰上证 5 年期国债 ETF 联接 C 基金份额净值 0.981 元；基金份额总额 8,534,643.87 份，国泰上证 5 年期国债 ETF 联接 A 基金的份额总额 4,702,604.58 份，国泰上证 5 年期国债 ETF 联接 C 基金的份额总额 3,832,039.29 份。

### 3.2 利润表

会计主体：国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 16 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 16 日（基金最后运作 日）止期间	上年度可比期间 2017 年度
<b>一、收入</b>	<b>331,826.53</b>	<b>-103,237.70</b>
1.利息收入	14,810.64	11,330.41
其中：存款利息收入	5,520.62	5,450.35
债券利息收入	9,290.02	5,880.06
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）	75,039.78	-21,584.45
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	74,271.78	-22,849.45
债券投资收益	768.00	1,265.00
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）	191,410.54	-125,507.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	50,565.57	32,523.98
<b>减：二、费用</b>	<b>130,488.03</b>	<b>169,648.87</b>
1. 管理人报酬	2,229.57	2,402.25
2. 托管费	743.03	800.79
3. 销售服务费	7,780.27	9,044.78
4. 交易费用	0.56	1.05

5. 利息支出	899.95	-
其中：卖出回购金融资产支出	899.95	-
6. 税金及附加	249.65	-
7. 其他费用	118,585.00	157,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>201,338.50</b>	<b>-272,886.57</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>201,338.50</b>	<b>-272,886.57</b>

### 3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 16 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 16 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）	9,835,976.27	-529,034.83	9,306,941.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		201,338.50	201,338.50
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）	-1,301,332.40	67,151.05	-1,234,181.35
其中：1.基金申购款	50,898,202.84	-1,865,455.35	49,032,747.49
2.基金赎回款	-52,199,535.24	1,932,606.40	-50,266,928.84
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,534,643.87	-260,545.28	8,274,098.59
项目	上年度可比期间 2017 年度		
	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）	10,413,992.49	-274,810.97	10,139,181.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-272,886.57	-272,886.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-578,016.22	18,662.71	-559,353.51



值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	37,987,974.82	-1,816,515.36	36,171,459.46
2.基金赎回款	-38,565,991.04	1,835,178.07	-36,730,812.97
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)	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值)	9,835,976.27	-529,034.83	9,306,941.44

#### 4 清盘事项说明

##### 4.1 基金基本情况

国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2013]11 号《关于核准上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，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《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,206,038,942.03 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司予以验证。经向中国证监会备案，《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 3 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,206,309,191.14 份基金份额，其中认购资金利息折合 270,249.11 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，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；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，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金类别称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金是上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金，目标 ETF 是主要采用优化抽样复制法实现对上证 5 年期国债指数紧密跟踪的被动指数基金，本基

金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF、标的指数即上证 5 年期国债指数成份国债和备选成份国债，还可投资于国内依法发行上市的债券、货币市场工具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的相关规定)。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例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。本基金业绩比较基准为上证 5 年期国债指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，基金管理人根据《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》和《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《关于终止国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。会议投票表决时间为 2018 年 9 月 17 日起至 2018 年 10 月 15 日 17:00 止。本次会议议案于 2018 年 10 月 16 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 2018 年 10 月 17 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《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接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，本基金的最后运作日定为 2018 年 10 月 16 日，并于 2018 年 10 月 17 日进入财产清算期。

本基金清算期为 2018 年 10 月 17 日到 2018 年 11 月 8 日。由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、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 2018 年 10 月 17 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《关于终止国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。

#### 4.3 清算起始日

根据基金管理人发布的《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2018 年 10 月 17 日起进入清算期。清算期

为 2018 年 10 月 17 日至 2018 年 11 月 8 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 2018 年 10 月 17 日至 2018 年 11 月 8 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《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》“十九、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) 本基金最后运作日活期存款人民币 15,218.19 元，截至清算结束日 2018 年 11 月 8 日余额为 8,317,358.27 元，其中包括基金管理人于 2018 年 11 月 2 日划入的垫付资金 30,000.00 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 2,105.42 元，已于 2018 年 11 月 2 日全部划回托管户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金人民币 1,947.37 元，截至清算结束日 2018 年 11 月 8 日余额为 3,617.42 元。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 12,166.72 元。其中银行存款、结算备付金和保证金利息为 1,116.69 元，截至清算结束日 2018 年 11 月 8 日余额为 3,050.13 元；应收债券利息 11,050.03 元，已于债券卖出时变现。

(5) 本基金最后运作日持有交易性金融资产人民币 8,453,329.34 元，此交易性金融资产已于 2018 年 10 月 31 日前变现结束，资金已划入托管账户。

#### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 173,906.69 元，该款项已于 2018 年 10 月 18 日支

付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币 22.47 元，该款项已于 2018 年 10 月 18 日支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 76.09 元，该款项已于 2018 年 11 月 5 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 25.32 元，该款项已于 2018 年 11 月 5 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 462.29 元，该款项已于 2018 年 11 月 5 日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 175.59 元，该款项已于 2018 年 11 月 7 日支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债人民币 36,000.00 元，该款项为预提银行间账户维护费和审计费，已于 2018 年 10 月 19 日和 2018 年 10 月 29 日支付银行间账户维护费共 6,000.00 元，已于 2018 年 11 月 1 日支付审计费 30,000.00 元。

#### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 10 月 17 日（基金清算起始日）至 2018 年 11 月 8 日（基金清算结束日）止期间
<b>一、资产处置损益</b>	<b>21,035.82</b>
1. 利息收入	2,673.90
其中：存款利息收入	1,933.44
债券利息收入	740.46
2. 投资收益（损失以“-”填列）	209,692.93
其中：股票投资收益	-
债券投资收益	-965.00
基金投资收益	210,657.93
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-185,195.34
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	-6,135.67
<b>二、清算费用</b>	<b>700.49</b>
1. 交易费用	0.56
2. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-

3. 其他费用	699.93
<b>三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>20,335.33</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，于 2018 年 11 月 8 日本基金剩余财产为人民币 8,294,025.82 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 2018 年 10 月 17 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 2018 年 11 月 2 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 2018 年 11 月 8 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 8,317,358.27 元，其中人民币 30,000.00 元系基金管理人代垫资金。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、《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 16 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《国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告》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。

国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金财产清算小组

二〇一八年十一月八日