

# 国泰丰益灵活配置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：宁波银行股份有限公司

公告日期：2019年3月11日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金(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]2376号《关于准予国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册募集,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《国泰丰益灵活配置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201,007,099.03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(2016)第1619号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,007,152.93份基金份额,其中认购资金利息折合53.90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,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地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《关于终止国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。会议投票表决时间为2018年8月2日起至2018年9月4日17:00止。本次会议议案于2018年9月5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9月6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《国泰丰益灵活配置混合型证券投资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2018年9月6日起进入清算期。

本基金清算期为2018年9月6日到2019年2月13日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人宁波银行股份有限公司、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9月6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。

## 2 基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称 国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 国泰丰益灵活配置混合

基金主代码 003686

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年12月9日

基金管理人 国泰基金管理有限公司

基金托管人 宁波银行股份有限公司

2018年9月5日基金份额总额 35,877,918.85份

下属份额类别的基金简称 国泰丰益灵活配置混合 A 国泰丰益灵活配置混合 C

下属份额类别的交易代码 003686 003687

2018年9月5日下属份额类别的份额

总额 35,855,709.81 份 22,209.04 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

本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

#### 2、股票投资策略

本基金主要根据上市公司获利能力、成长能力以及估值水平来进行个股选择。运用定性和定量相结合的方法，综合分析其投资价值和成长能力，确定投资标的股票，构建投资组合。

#### 3、固定收益类投资工具投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

#### 4、中小企业私募债投资策略

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。

#### 5、资产支持证券投资策略

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。

#### 6、权证投资策略

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。

#### 7、股指期货投资策略

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、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%

风险收益特征 本基金为混合型基金，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 宁波银行股份有限公司

信息披露负

责人

姓名 李永梅 王海燕

联系电话 021-31081600 转 0574-89103171

电子邮箱 xinzipilu@gtfund.com wanghaiyan@nbc.cn

客户服务电话 (021) 31089000, 400-888-8688 95574

传真 021-31081800 0574-89103213

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 中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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 中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号

邮政编码 200082 315100

法定代表人 陈勇胜 陆华裕

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: 国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2018 年 9 月 5 日(基金最后运作日)

单位: 人民币元

资 产

本期末

2018 年 9 月 5 日

(基金最后运作日)

上年度末

2017 年 12 月 31 日

资 产:

银行存款 289,134,046.76 697,966.45

存出保证金 36,491.55 9,033.13

交易性金融资产 34,660,851.41 395,684,685.41

其中: 股票投资 5,335,851.41 63,404,274.41

债券投资 29,325,000.00 330,849,411.00

资产支持证券投资 -1,431,000.00

买入返售金融资产 -30,000,165.00

应收利息 949,173.15 6,404,760.78

应收申购款 -435.00

资产总计 324,780,562.87 432,797,045.77

负债和所有者权益

负 债:

应付证券清算款 -5,000.00

应付赎回款 284,940,845.50 9,156.78

应付管理人报酬 27,325.81 220,193.14

应付托管费 4,554.31 36,698.87

应付销售服务费 0.61 22.63

应付交易费用 44,789.77 29,872.24

应交税费 14,375.40 -

其他负债 201,000.00 120,000.00

负债合计 285,232,891.40 420,943.66

所有者权益:

实收基金 35,877,918.85 392,201,496.82  
未分配利润 3,669,752.62 40,174,605.29  
所有者权益合计 39,547,671.47 432,376,102.11  
负债和所有者权益总计 324,780,562.87 432,797,045.77

注：报告截止日 2018 年 9 月 5 日（基金最后运作日），国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金的份额净值 1.1023 元，国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金的份额净值 1.1009 元。国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 35,877,918.85 份，其中国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金的份额总额 35,855,709.81 份，国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金的份额总额 22,209.04 份。

### 3.2 利润表

会计主体：国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 5 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

一、收入 2,921,539.16 45,109,620.59  
利息收入 8,032,611.67 13,595,238.82  
其中：存款利息收入 364,331.97 799,292.03  
债券利息收入 7,636,518.14 12,363,677.44  
资产支持证券利息收入 7,423.92 186,509.86  
买入返售金融资产收入 24,337.64 245,759.49  
投资收益 11,155,736.02 18,166,697.27  
其中：股票投资收益 7,915,158.32 18,457,273.44  
债券投资收益 2,320,958.80 -2,023,518.83  
股利收益 919,618.90 1,732,942.66  
公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -16,266,922.22 13,336,619.27  
其他收入 113.69 11,065.23  
减：二、费用 2,553,788.57 4,270,079.58  
管理人报酬 1,625,416.00 2,718,469.60  
托管费 270,902.72 453,078.18  
销售服务费 115.51 590.42  
交易费用 224,565.27 174,074.84  
利息支出 175,103.96 471,166.54  
其中：卖出回购金融资产支出 175,103.96 471,166.54  
税金及附加 18,785.11 -  
其他费用 238,900.00 452,700.00  
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 367,750.59 40,839,541.01  
减：所得税费用 --  
四、净利润(净亏损以“-”号填列) 367,750.59 40,839,541.01

### 3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 5 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9月5日(基金最后运作日)

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) 392,201,496.82 40,174,605.29 432,376,102.11

二、本期经营活动产生的基金净值变动

数(本期利润) - 367,750.59 367,750.59

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) -356,323,577.97 -36,872,603.26 -393,196,181.23

其中: 1.基金申购款 75,154.71 8,315.97 83,470.68

2.基金赎回款(以“-”号填列) -356,398,732.68 -36,880,919.23 -393,279,651.91

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) 35,877,918.85 3,669,752.62 39,547,671.47

项目

上年度可比期间

2017年1月1日至2017年12月31日

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) 200,996,129.76 327,070.55 201,323,200.31

二、本期经营活动产生的基金净值变动

数(本期利润) - 40,839,541.01 40,839,541.01

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) 191,205,367.06 -992,006.27 190,213,360.79

其中: 1.基金申购款 392,122,290.57 8,288,729.81 400,411,020.38

2.基金赎回款(以“-”号填列) -200,916,923.51 -9,280,736.08 -210,197,659.59

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) 392,201,496.82 40,174,605.29 432,376,102.11

#### 4 清盘事项说明

##### 4.1 基金基本情况

国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金(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]2376号《关于准予国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册募集,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《国泰丰益灵活配置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201,007,099.03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(2016)第1619号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,007,152.93份基金份额,其中认购资金利息折合53.90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,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用、

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。在投资者认购/申购时收取前端认购/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，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，称为C类基金份额。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰丰益灵活配置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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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)、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、权证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0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

根据市场环境变化，为更好地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《关于终止国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。会议投票表决时间为2018年8月2日起至2018年9月4日17:00止。本次会议议案于2018年9月5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9月6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《国泰丰益灵活配置混合型证券投资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2018年9月6日起进入清算期。

本基金清算期为2018年9月6日到2019年2月13日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人宁波银行股份有限公司、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9月6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《关于终止国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

#### 4.3 清算起始日

根据生效的本基金基金份额持有人大会决议，本基金于2018年9月6日起进入清算期，清算期为2018年9月6日至2019年2月13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 9 月 6 日至 2019 年 2 月 13 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《国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

#### 5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日活期存款人民币 289,134,046.76 元，截至清算结束日 2019 年 2 月 13 日余额为人民币 32,383,985.11 元，其中包含基金管理人于 2019 年 1 月 29 日划入的垫付资金人民币 200,000.00 元。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 36,491.55 元，截至清算结束日 2019 年 2 月 13 日余额为人民币 26,619.80 元，将于后期调回托管户。

#### (3) 本基金所持停牌股票处置情况

本基金最后运作日持有的停牌股票资产为人民币 5,335,851.41 元。本基金所持的停牌股票已复牌并变现，具体处置情况如下：

序号	股票	代码	股票名称	复牌日期	变现日期	最后运作日（2018 年 9 月 5 日）估值金额（人民币元）	变现金额（人民币元）
1	600335	国机汽车	2018-10-9	2018-10-12	5,335,851.41	4,447,111.85	

#### (4) 本基金所持债券处置情况

本基金最后运作日持有的债券资产为人民币 29,325,000.00 元，该债券已于 2019 年 2 月 12 日全部卖出完毕，累计变现金额为 22,507,806.88 元(含应收利息)。

(5) 本基金最后运作日应收活期存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、直销申购款利息及债券利息合计人民币 949,173.15 元，2018 年 9 月 21 日结息到账总金额为人民币 186,223.14 元，2018 年 9 月 26 日直销申购款结息到账人民币 1.31 元，2018 年 10 月 29 日债券派息到账人民币 1,134,000.00 元，截至清算结束日 2019 年 2 月 13 日余额为 21,101.70 元。

#### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 27,325.81 元，该款项已于 2018 年 10 月 10 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,554.31 元，该款项已于 2018 年 10 月 10 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.61 元，该款项已于 2018 年 10 月 10 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 44,789.77 元，于 2018 年 9 月 13 日和 2018 年 9 月 18 日支付银行间费用，于 2018 年 11 月 20 日支付佣金。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 14,375.40 元，截至清算结束日 2019 年 2 月 13 日已支付完毕。

(6) 本基金最后运作日预提费用为人民币 201,000.00 元，包含审计费用、信披费、律师费和银行间账户维护费，皆于 2018 年 9 月 13 日支付完毕。

(7) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 284,940,845.50 元, 该款项已于 2018 年 9 月 7 日支付完毕。

#### 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 9 月 6 日(基金清算起始日)至 2019 年 2 月 13 日(基金清算结束日)止期间

一、资产处置损益 -7,305,571.78

1.利息收入 635,655.14

其中: 存款利息收入 58,870.59

债券利息收入 576,784.55

2.投资收益(损失以“-”填列) -10,558,293.99

其中: 股票投资收益 -3,358,899.37

债券投资收益 -7,199,394.62

基金投资收益 -

股利收益 -

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 2,617,067.07

4.其他收入(损失以“-”号填列) -

二、清算费用 10,393.08

1. 交易费用 8,489.73

2. 税金及附加 1,903.35

3. 其他费用 -

三、清算净损益(净亏损以“-”号填列) -7,315,964.86

#### 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 2019 年 2 月 13 日本基金剩余财产为人民币 32,231,706.61 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 9 月 6 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 2019 年 1 月 29 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 2019 年 2 月 13 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 32,383,985.11 元, 其中人民币 200,000.00 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、《国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 5 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《国泰丰益灵活配置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 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。

国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

二〇一九年二月十三日