

国泰添福一年定期开放债券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：南京银行股份有限公司

公告日期：2026年3月4日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2020]570号《关于准予国泰添福一年定期开放债券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《国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“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。根据基金合同的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日(含基金合同生效日)起或自每一开放期结束之日次日(包括该日)起一年的期间内,本基金采取封闭运作模式。本基金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,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。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。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币209,999,000.00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(2020)第0676号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2020年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为209,999,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地维护基金份额持有人利益,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,本基金基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人南京银行股份有限公司协商一致,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议了《关于终止国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。大会投票表决起止时间为自2025年12月29日起至2026年2月2日17:00止。本次会议议案于2026年2月3日表决通过,自该日起本次持有人大会决议生效。基金管理人于2026年2月4日在《中国证券报》和基金管理人网站刊登了《国泰添福一年定期开放债券型发起式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2026年2月4日起进入清算期。

本基金清算期为2026年2月4日至2026年2月10日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人南京银行股份有限公司、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2026年2月4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

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.....	5
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	净资产变动表.....	7
4	清盘事项说明	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.....	10
5	清算情况	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.....	12
5.6	基金财产清算报告的告知安排.....	12
6	备查文件目录	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	国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国泰添福一年定期开放债券
基金主代码	009444
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	2020年8月3日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司
2026年2月3日（基金最后运作日） 基金份额总额	4,922,430.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略：本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易策略、资产支持证券投资策略、信用衍生品投资策略等多种投资策略，构建资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态地对投资组合进行调整。</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	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	南京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	王峰
	联系电话	021-31081600转	021-24198808
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wangf@njcbtg.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95302
传真		021-31081800	025-86776189
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	南京市建邺区江山大街88号
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	南京市建邺区江山大街88号
邮政编码		200082	210019
法定代表人		周向勇	谢宁

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：国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年2月3日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2026年2月3日 (基金最后运作日)	上年度末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	477,747.23	85,812.17
结算备付金	-	-
存出保证金	241.81	188.07
交易性金融资产	4,572,435.76	5,071,300.16
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,572,435.76	5,071,300.16
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	-	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	9,300.00	-
资产总计	5,059,724.80	5,157,300.40
负债和净资产	本期末 2026年2月3日 (基金最后运作日)	上年度末 2025年12月31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	-	-
应付清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,447.93	1,281.37
应付托管费	482.66	427.15
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	16.25
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	22,563.41	124,126.72
负债合计	24,494.00	125,851.49
净资产:		
实收基金	4,922,430.91	4,922,430.91
未分配利润	112,799.89	109,018.00
净资产合计	5,035,230.80	5,031,448.91
负债和净资产总计	5,059,724.80	5,157,300.40

注：报告截止日 2026 年 2 月 3 日（基金最后运作日），基金份额总额 4,922,430.91 份，基金份额净值 1.0229 元。

3.2 利润表

会计主体：国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 2 月 3 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026 年2月3日（基金最后运 作日）止期间	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年 12月31日止期间
一、营业总收入	5,712.48	4,300,233.96
1.利息收入	156.71	508,964.41
其中：存款利息收入	156.71	62,889.42
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	-	446,074.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	8,704.97	17,207,435.47
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,704.97	17,207,435.47
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	-	-
其他投资收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,149.20	-13,416,165.92
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	1,930.59	2,341,347.76
1. 管理人报酬	1,447.93	1,300,134.26
2. 托管费	482.66	433,378.00
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	-	425,328.92
其中：卖出回购金融资产支出	-	425,328.92
6.信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	-	23,276.36
8. 其他费用	-	159,230.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,781.89	1,958,886.20
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,781.89	1,958,886.20
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	3,781.89	1,958,886.20

3.3 净资产变动表

会计主体：国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年2月3日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年2月3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	4,922,430.91	109,018.00	5,031,448.91
二、本期期初净资产	4,922,430.91	109,018.00	5,031,448.91
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-	3,781.89	3,781.89
（一）、综合收益总额	-	3,781.89	3,781.89
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	4,922,430.91	112,799.89	5,035,230.80
项目	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	584,909,444.71	26,057,485.66	610,966,930.37
二、本期期初净资产	584,909,444.71	26,057,485.66	610,966,930.37
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-579,987,013.80	-25,948,467.66	-605,935,481.46
（一）、综合收益总额	-	1,958,886.20	1,958,886.20
（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）	-579,987,013.80	-8,897,797.48	-588,884,811.28
其中：1.基金申购款	4,922,218.77	76,786.55	4,999,005.32
2.基金赎回款	-584,909,232.57	-8,974,584.03	-593,883,816.60
（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）	-	-19,009,556.38	-19,009,556.38
四、本期期末净资产	4,922,430.91	109,018.00	5,031,448.91

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2020]570号《关于准予国泰添福一年定期开放债券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《国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“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。根据基金合同的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日(含基金合同生效日)起或自每一开放期结束之日次日(包括该日)起一年的期间内,本基金采取封闭运作模式。本基金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,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。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。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币209,999,000.00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(2020)第0676号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2020年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为209,999,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00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,包括债券(含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期的前1个月、开放期及开放期结束后1个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内本基金持有的现金或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。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率。

4.2 清算原因

根据市场环境变化，为更好地维护基金份额持有人利益，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，本基金基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人南京银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议了《关于终止国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。大会投票表决起止时间为自2025年12月29日起至2026年2月2日17:00止。本次会议议案于2026年2月3日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。基金管理人于2026年2月4日在《中国证券报》和基金管理人网站刊登了《国泰添福一年定期开放债券型发起式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2026年2月4日起进入清算期。

4.3 清算起始日

本基金清算期为2026年2月4日至2026年2月10日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人南京银行股份有限公司、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2026年2月4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。

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 2026 年 2 月 4 日至 2026 年 2 月 10 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，本基金清算期间的清算费用由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2026 年 2 月 10 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 477,747.23 元，存出保证金 241.81 元。截至清算结束日，活期存款 5,132,560.90 元，包含基金管理人于 2026 年 2 月 10 日划入的垫付资金 100,000.00 元，结算备付金 2,541.41 元，存出保证金 241.81 元。

（2）本基金最后运作日，交易性金融资产 4,572,435.76 元，均为交易性债券投资。截至清算结束日，以上资产均已变现。

（3）本基金最后运作日，其他资产 9,300 元，均为其他应收款，系基金资产先行支付的应由基金管理人承担的账户维护费。截至清算结束日，以上资产已经收到。

5.3 负债清偿情况

截至本次清算期结束日（2026 年 2 月 10 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 1,447.93 元，应付托管费 482.66 元。截至清算结束日，以上费用均已支付。

（2）本基金最后运作日，其他负债 22,563.41 元，其中应付交易费用 150.50 元、预提审计费用 22,412.91 元。清算期间，已于 2026 年 2 月 6 日付清审计费用，由于债券变现产生应付交易费用 310.00 元，已于 2026 年 2 月 10 日支付交易费用 450.00 元。截至清算结束日，应付交易费用 10.50 元，待日后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月4日（基金清算起始日）起至 2026年2月10日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	102.82
1.利息收入	293.07
其中：存款利息收入	293.07
2.投资收益（损失以“-”填列）	-6,268.25
其中：债券投资收益	-6,268.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,078.00
二、清算费用	-
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	102.82

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 2026 年 2 月 10 日，本基金剩余财产为 5,035,333.62 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 2026 年 2 月 4 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，由基金管理人以自有资金垫付并已于 2026 年 2 月 10 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 2026 年 2 月 10 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 5,132,560.90 元，包含基金管理人垫付资金 100,000.00 元。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、《国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 2 月 3 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《国泰添福一年定期开放债券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。

国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年二月十日