

**国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 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：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b>                           | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| <b>4 管理人报告</b>                          | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13 |
| <b>5 托管人报告</b>                          | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 14 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 40 |
| 7.6 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      | 40 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 40 |
| 7.8 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贵金属投资明细   | 40 |
| 7.9 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      | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 41 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 42 |

|           |                                     |           |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.2       | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 42        |
| 8.3       | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 42        |
| <b>9</b>  | <b>开放式基金份额变动 .....</b>              | <b>42</b> |
| <b>10</b> | <b>重大事件揭示 .....</b>                 | <b>43</b> |
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 43        |
| 10.2      | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 43        |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 43        |
| 10.4      | 基金投资策略的改变 .....                     | 43        |
| 10.5      | 报告期内改聘会计师事务所情况 .....                | 43        |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 43        |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 43        |
| 10.8      | 其他重大事件 .....                        | 45        |
| <b>11</b> | <b>备查文件目录 .....</b>                 | <b>46</b> |
| 11.1      | 备查文件目录 .....                        | 46        |
| 11.2      | 存放地点 .....                          | 46        |
| 11.3      | 查阅方式 .....                          | 46        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 国泰策略收益灵活配置混合        |
| 基金主代码      | 000199              |
| 交易代码       | 000199              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2015 年 1 月 16 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        |
| 报告期末基金份额总额 | 42,701,829.56 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金力图通过灵活的大类资产配置，积极把握个股的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人依据 Melva 资产评估体系，通过考量宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关变量指标的变化，评估确定一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）盈利能力股票筛选</p> <p>本基金的股票资产投资主要以具有投资价值的股票作为投资对象，采取自下而上精选个股策略，利用 ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司，构成具有盈利能力的股票备选池。</p> <p>（2）价值评估分析</p> <p>本基金通过价值评估分析，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票池。价值评估分析主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、股息贴现模型等，基金管理人根据不同行业特征和市场特征灵活进行运用，努力为从估值层面持有人发掘价值。</p> <p>（3）实地调研</p> <p>对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过对上市公司的外部合作机构和相关行政管理部门进一步调研，对上述结论进行核实。</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>(4) 投资组合建立和调整 本基金将在案头分析和实地调研的基础上,建立和调整投资组合。在投资组合管理过程中,本基金还将注重投资品种的交易活跃程度,以保证整体组合具有良好的流动性。</p> <p>3、债券投资策略<br/>本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。</p> <p>4、权证投资策略<br/>本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资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,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下稳健的超额收益。</p> <p>5、资产支持证券投资策略<br/>本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。</p> <p>6、股指期货投资策略<br/>本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,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。 基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p> |
| 业绩比较基准 | 60%*沪深 300 指数收益率+40%*中证全债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的中高风险品种,本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。  |

### 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<br>负责人 | 姓名   | 李永梅                         | 田青                   |
|             | 联系电话 | 021-31081600转               | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com        | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | (021)31089000, 400-888-8688 | 010-67595096         |
| 传真          |      | 021-31081800                | 010-66275853         |
| 注册地址        |      | 上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼      | 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 | 唐建光                        | 王洪章               |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                   |
|----------------------|-----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》            |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gtfund.com                    |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                              |
|--------|------------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国泰基金管理有限公司登记注册中心 | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016年1月1日至2016年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | -2,723,939.79             |
| 本期利润          | -7,140,585.03             |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1540                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -12.42%                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -11.01%                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 20,895,846.77             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4893                    |
| 期末基金资产净值      | 56,978,449.93             |
| 期末基金份额净值      | 1.334                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 33.40%                    |

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

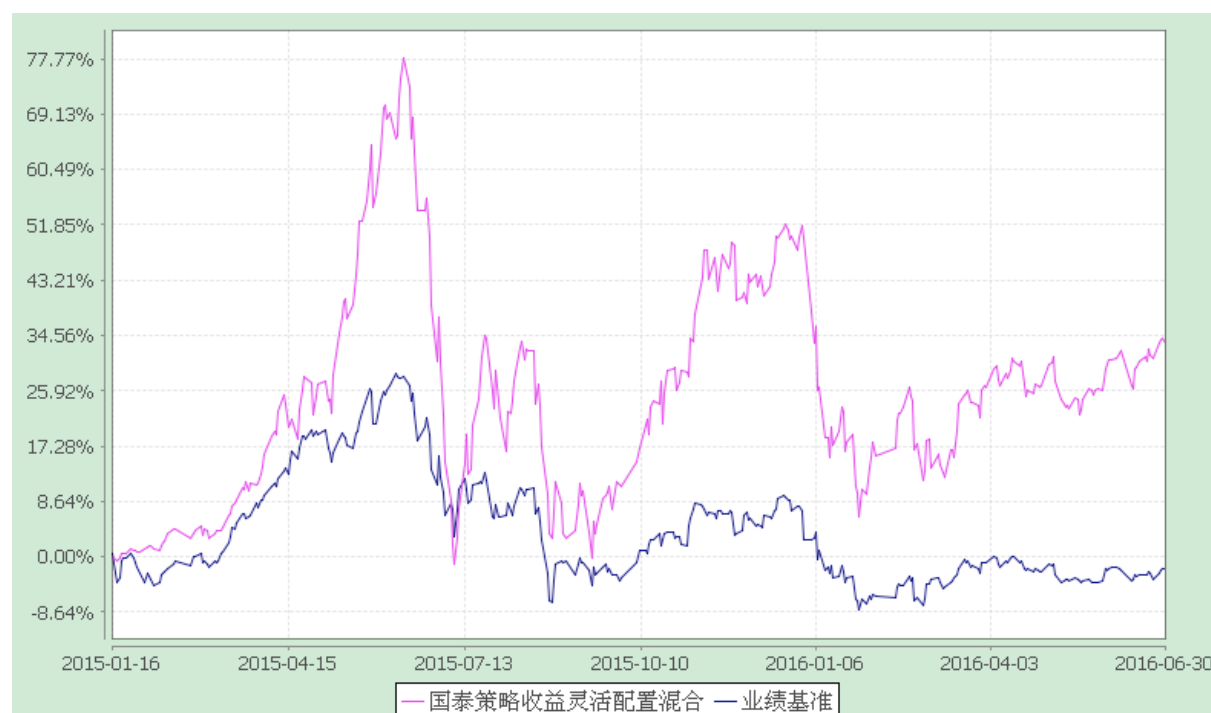
| 阶段       | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月    | 3.09%    | 1.28%       | 0.01%      | 0.59%         | 3.08%  | 0.69% |
| 过去三个月    | 5.37%    | 1.28%       | -0.98%     | 0.61%         | 6.35%  | 0.67% |
| 过去六个月    | -11.01%  | 2.28%       | -8.55%     | 1.11%         | -2.46% | 1.17% |
| 过去一年     | -2.98%   | 2.72%       | -15.31%    | 1.38%         | 12.33% | 1.34% |
| 自基金转型起至今 | 33.40%   | 2.57%       | -1.93%     | 1.38%         | 35.33% | 1.19% |

#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额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

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 1 月 16 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：本基金的合同生效日为 2015 年 1 月 16 日，本基金在 3 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 62 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰中证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型

证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来，自 2016 年 7 月 1 日起转型为国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF））。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
|     |   | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 邱晓华 | 本基金的基金经理（原国泰目标收益保本混合）、国泰安康养老定期支付混合、国泰保本混合、国泰新目标收益保本混合、国泰鑫保本混合、国泰民福保本混合、国泰事件驱动混合、国泰民利保本混合的基金经理 | 2015-01-16      | -    | 15 年   | 硕士研究生。曾任职于新华通讯社、北京首都国际投资管理有限公司、银河证券。2007 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。2011 年 4 月至 2014 年 6 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011 年 6 月至 2016 年 6 月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2013 年 8 月至 2015 年 1 月 15 日兼任国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 5 月起兼任国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 11 月至 2015 年 12 月兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理； |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>2015 年 1 月 16 日起兼任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(原国泰目标收益保本混合型证券投资基金)的基金经理; 2015 年 4 月起兼任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理; 2015 年 4 月至 2016 年 6 月兼任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理; 2015 年 12 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 3 月起兼任国泰民福保本混合型证券投资基金的基金经理; 2016 年 4 月起兼任国泰事件驱动策略混合型证券投资基金的基金经理; 2016 年 7 月起兼任国泰民利保本混合型证券投资基金基金的基金经理。</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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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，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。

#### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

#### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

#### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，股票市场先是在美联储加息预期升温、离岸人民币贬值速度加快等因素下经历了一轮快速下跌，在 2、3 月份反弹之后，二季度市场又面临更为复杂的宏观环境，包括 4 月份经济数据低于预期、债券市场信用风险频发、监管层严控跨界并购重组、5 月份美国非农就业数据低于预期导致美联储加息预期延后、A 股未被纳入 MSCI、英国脱欧成真，多空事件交织、但整体来看以风险事件为主，股票市场二季度呈现出区间震荡的态势。

上半年我们强调资产配置的重要性，在一季度的市场底部进行了小幅加仓，二季度严格控制仓位，同时精选有较好成长性、弹性较高的个股进行配置。股票配置的方向包括新能源汽车、先进制造业、医疗、娱乐传媒行业等。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2016 年上半年的净值增长率为-11.01%，同期业绩比较基准为-8.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为目前市场风险已经得到较大程度的释放。英国脱欧使得美联储加息概率进一步降低，国内经济增速能够稳住，流动性仍然会维持在较为宽松的状态，人民币贬值幅度尚在市场预期范围之内，通胀压力较小。因此站在目前时点，我们认为股票市场机会大于风险。当然中期来看我们认为仍然需要密切观察关键指标的变化。

指数大概率仍会维持区间震荡的态势。在不出现黑天鹅事件的情况下，指数大幅向下的概率不大。我们认为市场存在结构性机会，因此投资策略上将会维持仓位中性、精选个股、加大波段操作力度。我们会在看好的行业中精选具备高成长性的个股，这些行业包括品牌消费、娱乐传媒、智能装备制造、医疗、环保等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履

行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         | -                      | -                        |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 17,921,496.95          | 1,833,502.59             |
| 结算备付金      |         | 1,232,371.22           | 1,408,401.40             |
| 存出保证金      |         | 7,545.69               | 27,108.25                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 43,963,754.99          | 68,369,557.18            |
| 其中：股票投资    |         | 43,963,754.99          | 53,701,477.98            |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | -                      | 14,668,079.20            |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收证券清算款    |         | 1,327,288.53           | -                        |
| 应收利息       | 6.4.7.5 | 5,986.96               | 333,800.92               |
| 应收股利       |         | -                      | -                        |
| 应收申购款      |         | 16,073.24              | 374,599.29               |
| 递延所得税资产    |         | -                      | -                        |

|                   |            |                                |                                  |
|-------------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其他资产              | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>64,474,517.58</b>           | <b>72,346,969.63</b>             |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 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            | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款         |            | -                              | 2,900,000.00                     |
| 应付证券清算款           |            | 6,482,623.11                   | 100,571.67                       |
| 应付赎回款             |            | 609,113.61                     | 895,452.56                       |
| 应付管理人报酬           |            | 71,511.08                      | 78,708.51                        |
| 应付托管费             |            | 11,918.52                      | 13,118.08                        |
| 应付销售服务费           |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用            | 6.4.7.7    | 21,136.20                      | 32,873.70                        |
| 应交税费              |            | -                              | -                                |
| 应付利息              |            | -                              | -                                |
| 应付利润              |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债           |            | -                              | -                                |
| 其他负债              | 6.4.7.8    | 299,765.13                     | 360,318.08                       |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>7,496,067.65</b>            | <b>4,381,042.60</b>              |
| <b>所有者权益：</b>     |            | -                              | -                                |
| 实收基金              | 6.4.7.9    | 36,082,603.16                  | 38,311,808.71                    |
| 未分配利润             | 6.4.7.10   | 20,895,846.77                  | 29,654,118.32                    |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>56,978,449.93</b>           | <b>67,965,927.03</b>             |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>64,474,517.58</b>           | <b>72,346,969.63</b>             |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.334 元，基金份额总额 42,701,829.56 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目          | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 16 日(基<br>金合同生效日) 至<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|--|--|
| <b>一、收入</b> |          | <b>-6,362,109.57</b>                     | <b>23,810,435.60</b>   |
| 1.利息收入      |          | 165,757.14                               | 922,745.33   |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 37,619.07                                | 32,345.92  |
| 债券利息收入      |          | 128,138.07                               | 883,411.26   |
| 资产支持证券利息收入  |          | -  | -  |
| 买入返售金融资产收入  |          | -  | 6,988.15   |

|                            |          |                      |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 其他利息收入                     |          | -                    | -                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | -2,259,432.52        | 27,376,685.98        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | -2,325,184.31        | 27,488,511.94        |
| 基金投资收益                     |          | -                    | -                    |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | -39,812.80           | -17,675.81           |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                    | -                    |
| 贵金属投资收益                    |          | -                    | -                    |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                    | -227,021.54          |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 105,564.59           | 132,871.39           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -4,416,645.24        | -4,751,415.54        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                    | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 148,211.05           | 262,419.83           |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>778,475.46</b>    | <b>1,260,324.87</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 428,973.80           | 514,214.08           |
| 2. 托管费                     |          | 71,495.67            | 85,702.35            |
| 3. 销售服务费                   |          | -                    | -                    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 59,099.33            | 388,951.68           |
| 5. 利息支出                    |          | 20,496.85            | 46,949.67            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 20,496.85            | 46,949.67            |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 198,409.81           | 224,507.09           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-7,140,585.03</b> | <b>22,550,110.73</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-7,140,585.03</b> | <b>22,550,110.73</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）                   | 38,311,808.71                         | 29,654,118.32 | 67,965,927.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | -7,140,585.03 | -7,140,585.03 |
| 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） | -2,229,205.55                         | -1,617,686.52 | -3,846,892.07 |
| 其中：1.基金申购款                        | 19,066,735.12                         | 8,669,128.72  | 27,735,863.84 |



|  |   |                |                |
|--|---|----------------|----------------|
| 2.基金赎回款                                | -21,295,940.67                            | -10,286,815.24 | -31,582,755.91 |
| 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）                        | 36,082,603.16                             | 20,895,846.77  | 56,978,449.93  |
| 项目                                     | 上年度可比期间                                   |                |                |
|  | 2015 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 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）                        | 64,325,687.82                             | 11,741,494.80  | 76,067,182.62  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 22,550,110.73  | 22,550,110.73  |
| 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）      | -23,994,291.01                            | -9,000,437.17  | -32,994,728.18 |
| 其中：1.基金申购款                             | 35,617,113.23                             | 21,640,360.76  | 57,257,473.99  |
| 2.基金赎回款                                | -59,611,404.24                            | -30,640,797.93 | -90,252,202.17 |
| 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）                        | 40,331,396.81                             | 25,291,168.36  | 65,622,565.17  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：李辉，会计机构负责人：倪莹

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。根据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定以及本基金的基金管理人发布的《关于国泰目标收益保本混合型证券投资基金保本期提前到期处理规则及变更为国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的公告》，截止 2014 年 12 月 12 日止，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率已连续 15 个工作日达到或超过首个保本期的预设目标收益率 15%，触发提前到期条款，国泰目标收益保本混合型证券投资基金首个保本期提

前到期，保本期到期日为 2014 年 12 月 29 日。首个保本期提前到期后进入过渡期，过渡期为 2014 年 12 月 30 日至 2015 年 1 月 15 日。过渡期结束后的下一日起，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。自 2015 年 1 月 16 日起，修订后的《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰策略收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，包括国内上市交易的股票(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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资范围为：股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%以上，其中，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，本基金保留的现金或者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%。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2016 年 8 月 24 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动

情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2016年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 17,921,496.95     |
| 定期存款 | -                 |
| 其他存款 | -                 |
| 合计   | 17,921,496.95     |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016年6月30日 |               |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 46,379,944.77     | 43,963,754.99 | -2,416,189.78 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场             | -             | -             |
|               | 银行间市场             | -             | -             |
|               | 合计                | -             | -             |
| 资产支持证券        | -                 | -             | -             |
| 基金            | -                 | -             | -             |
| 其他            | -                 | -             | -             |
| 合计            | 46,379,944.77     | 43,963,754.99 | -2,416,189.78 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,741.11               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 2,242.45               |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 3.40                   |
| 合计         | 5,986.96               |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 21,136.20              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 21,136.20              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 751.75                 |
| 预提费用        | 299,013.38             |
| 合计          | 299,765.13             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 45,340,697.54                         | 38,311,808.71  |
| 本期申购          | 22,564,074.96                         | 19,066,735.12  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -25,202,942.94                        | -21,295,940.67 |
| 本期末           | 42,701,829.56                         | 36,082,603.16  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 27,010,763.93  | 2,643,354.39  | 29,654,118.32  |
| 本期利润           | -2,723,939.79  | -4,416,645.24 | -7,140,585.03  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,354,669.84  | -263,016.68   | -1,617,686.52  |
| 其中：基金申购款       | 13,055,758.45  | -4,386,629.73 | 8,669,128.72   |
| 基金赎回款          | -14,410,428.29 | 4,123,613.05  | -10,286,815.24 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 22,932,154.30  | -2,036,307.53 | 20,895,846.77  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 6,287.56                              |
| 其他        | 89.49                                 |
| 合计        | 37,619.07                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
|            | 卖出股票成交总额                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 22,811,847.88                         |
| 买卖股票差价收入   | -2,325,184.31                         |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 15,090,072.90              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 14,672,812.80              |
| 减：应收利息总额               | 457,072.90                 |
| 买卖债券差价收入               | -39,812.80                 |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 105,564.59                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 105,564.59                 |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | -4,416,645.24              |
| ——股票投资     | -4,421,378.84              |
| ——债券投资     | 4,733.60                   |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——基金投资     | -                          |
| ——贵金属投资    | -                          |
| ——其他       | -                          |
| 2.衍生工具     | -                          |
| ——权证投资     | -                          |
| 3.其他       | -                          |
| 合计         | -4,416,645.24              |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|    |    |

|         | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------|
| 基金赎回费收入 | 139,812.20           |
| 转换费收入   | 8,398.85             |
| 合计      | 148,211.05           |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 59,099.33                  |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 59,099.33                  |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 29,835.26                  |
| 信息披露费   | 149,178.12                 |
| 银行汇划费用  | 596.43                     |
| 债券账户服务费 | 18,000.00                  |
| 上清所查询费  | 600.00                     |
| 上清所证书费  | 200.00                     |
| 合计      | 198,409.81                 |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方



| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 国泰基金管理有限公司             | 基金管理人、基金销售机构        |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)   | 受基金管理人控股股东中国建投控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同生效日）<br>至2015年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期股票成交总额的比例 |
| 申万宏源  | 1,328,735.09               | 3.51%        | 8,862,553.29                                  | 3.44%        |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同生效日）<br>至2015年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期债券成交总额的比例 |
| 申万宏源  | -                          | -            | 9,777,530.57                                  | 23.80%       |

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同生效日）<br>至2015年6月30日 |                |
|-------|----------------------------|----------------|---|----------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 申万宏源  | 6,000,000.00               | 4.03%          | 22,000,000.00                                 | 7.11%          |

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日                |            |          |              |
|-------|---|------------|----------|--------------|
|       | 当期佣金                                      | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 申万宏源  | 1,237.48                                  | 3.51%      | 1,237.48 | 5.85%        |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |            |          |              |
|       | 当期佣金                                      | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 申万宏源  | 8,068.42                                  | 3.44%      | 8,068.42 | 4.60%        |

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 428,973.80                 | 514,214.08                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 176,212.63                 | 246,129.92                                |

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 |           | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同<br>生效日）至2015年6月30日 |           |
|----------------|--------------------------------|-----------|---|-----------|
|                | 期末余额                           | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 当期发生的基金应支付的托管费 |                                | 71,495.67 |   | 85,702.35 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2015年1月16日（基金合同生效<br>日）至2015年6月30日 |           |
|--------|----------------------------|-----------|---|-----------|
|        | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 中国建设银行 | 17,921,496.9<br>5          | 31,242.02 | 6,215,273.12                                  | 17,571.44 |

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |          |          |          |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 300520               | 科大国创 | 2016-06-30 | 2016-07-08 | 网下新股   | 10.05 | 10.05  | 369.00   | 3,708.45 | 3,708.45 | -  |
| 002805               | 丰元股份 | 2016-06-29 | 2016-07-07 | 网下新股   | 5.80  | 5.80   | 637.00   | 3,694.60 | 3,694.60 | -  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(单位：股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|------------|--------------|--------------|----|
| 002672 | 东江环保 | 2016-05-23 | 重大事项 | 17.33  | 2016-07-15 | 19.06  | 134,442.00 | 2,632,389.16 | 2,329,879.86 | -  |
| 300450 | 先导智能 | 2016-03-14 | 重大事项 | 44.44  | 2016-07-20 | 41.59  | 47,400.00  | 1,217,947.50 | 2,106,456.00 | -  |
| 002313 | 日海通讯 | 2016-06-20 | 重大事项 | 13.59  | 2016-07-04 | 14.95  | 63,484.00  | 1,053,186.86 | 862,747.56   | -  |
| 002712 | 思美传媒 | 2016-04-11 | 重大事项 | 38.02  | 2016-08-17 | 41.82  | 14,400.00  | 271,709.12   | 547,488.00   | -  |
| 300508 | 维宏股份 | 2016-06-30 | 临时停牌 | 254.50 | 2016-07-06 | 242.00 | 295.00     | 5,923.60     | 75,077.50    | -  |
| 300503 | 昊志机电 | 2016-06-30 | 临时停牌 | 84.72  | 2016-07-05 | 82.99  | 830.00     | 6,407.60     | 70,317.60    | -  |

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为灵活配置混合型基金，是证券投资基金中较高预期风险和较高预期收益的产品。基金的预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在严格控制风险的前提下，谋求基金资产长期稳健增值”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2015 年 12 月 31 日：同）

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的所有金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期

现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的部分金融资产和金融负债不计息，同时也投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2016年6月30日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|-------------------|---------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                |               |      |      |               |               |
| 银行存款              | 17,921,496.95 | -    | -    | -             | 17,921,496.95 |
| 结算备付金             | 1,232,371.22  | -    | -    | -             | 1,232,371.22  |
| 存出保证金             | 7,545.69      | -    | -    | -             | 7,545.69      |
| 交易性金融资产           | -             | -    | -    | 43,963,754.99 | 43,963,754.99 |
| 应收证券清算款           | -             | -    | -    | 1,327,288.53  | 1,327,288.53  |
| 应收利息              | -             | -    | -    | 5,986.96      | 5,986.96      |
| 应收申购款             | -             | -    | -    | 16,073.24     | 16,073.24     |
| 资产总计              | 19,161,413.86 | -    | -    | 45,313,103.72 | 64,474,517.58 |
| 负债                |               |      |      |               |               |
| 应付证券清算款           | -             | -    | -    | 6,482,623.11  | 6,482,623.11  |
| 应付赎回款             | -             | -    | -    | 609,113.61    | 609,113.61    |
| 应付管理人报酬           | -             | -    | -    | 71,511.08     | 71,511.08     |

|                             |               |       |       |               |               |
|-----------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 应付托管费                       | -             | -     | -     | 11,918.52     | 11,918.52     |
| 应付交易费用                      | -             | -     | -     | 21,136.20     | 21,136.20     |
| 其他负债                        | -             | -     | -     | 299,765.13    | 299,765.13    |
| 负债总计                        | -             | -     | -     | 7,496,067.65  | 7,496,067.65  |
| 利率敏感度缺口                     | 19,161,413.86 | -     | -     | 37,817,036.07 | 56,978,449.93 |
| 上年度末<br>2015 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                          |               |       |       |               |               |
| 银行存款                        | 1,833,502.59  | -     | -     | -             | 1,833,502.59  |
| 结算备付金                       | 1,408,401.40  | -     | -     | -             | 1,408,401.40  |
| 存出保证金                       | 27,108.25     | -     | -     | -             | 27,108.25     |
| 交易性金融资产                     | 14,668,079.20 | -     | -     | 53,701,477.98 | 68,369,557.18 |
| 应收利息                        | -             | -     | -     | 333,800.92    | 333,800.92    |
| 应收申购款                       | -             | -     | -     | 374,599.29    | 374,599.29    |
| 资产总计                        | 17,937,091.44 | -     | -     | 54,409,878.19 | 72,346,969.63 |
| 负债                          |               |       |       |               |               |
| 卖出回购金融资产款                   | 2,900,000.00  | -     | -     | -             | 2,900,000.00  |
| 应付赎回款                       | -             | -     | -     | 895,452.56    | 895,452.56    |
| 应付管理人报酬                     | -             | -     | -     | 78,708.51     | 78,708.51     |
| 应付托管费                       | -             | -     | -     | 13,118.08     | 13,118.08     |
| 应付交易费用                      | -             | -     | -     | 32,873.70     | 32,873.70     |
| 其他负债                        | -             | -     | -     | 360,318.08    | 360,318.08    |
| 应付证券清算款                     | -             | -     | -     | 100,571.67    | 100,571.67    |
| 负债总计                        | 2,900,000.00  | -     | -     | 1,481,042.60  | 4,381,042.60  |
| 利率敏感度缺口                     | 15,037,091.44 | -     | -     | 52,928,835.59 | 67,965,927.03 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除利率外其他市场条件不变 |                                  |      |
|----|--------------|----------------------------------|------|
| 分析 | 相关风险变量的变动    | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币万元） |      |
|    |              | 本期末                              | 上年度末 |



|           | 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|-----------------|------------------|
| 利率下降 25BP | -               | 增加约 1            |
| 利率上升 25BP | -               | 减少约 1            |

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合资产配置比例：股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%以上，其中，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，本基金保留的现金或者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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----|------------------------|--------------------------|
|    |                        |                          |

|               | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 43,963,754.99 | 77.16         | 53,701,477.98 | 79.01         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -             | -             | -             | -             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -             | -             | -             | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -             | -             | -             |
| 其他            | -             | -             | -             | -             |
| 合计            | 43,963,754.99 | 77.16         | 53,701,477.98 | 79.01         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                                |                          |
|----|-------------------------|--------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元) |                          |
|    |                         | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 增加约 272                        | -                        |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | 减少约 272                        | -                        |

注: 于 2015 年 12 月 31 日, 本基金成立尚未满一年, 无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于

第一层次的余额为 37,971,788.47 元，属于第二层次的余额为 5,991,966.52 元，无属于第三层次的余额。(2015 年 12 月 31 日：第一层次为 52,636,685.16 元，第二层次 15,732,872.02 元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目       | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资     | 43,963,754.99 | 68.19         |
|    | 其中：股票    | 43,963,754.99 | 68.19         |
| 2  | 固定收益投资   | -             | -             |
|    | 其中：债券    | -             | -             |
|    | 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      | 19,153,868.17 | 29.71  |
| 7 | 其他各项资产            | 1,356,894.42  | 2.10   |
| 8 | 合计                | 64,474,517.58 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 138,009.12    | 0.24         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 34,574,741.30 | 60.68        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 50,417.39     | 0.09         |
| F  | 批发和零售业           | 31,256.72     | 0.05         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,633,598.05  | 4.62         |
| J  | 金融业              | 27,842.49     | 0.05         |
| K  | 房地产业             | 779,713.02    | 1.37         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 547,488.00    | 0.96         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 2,329,879.86  | 4.09         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,771,667.76  | 4.86         |
| S  | 综合               | 79,141.28     | 0.14         |
|    | 合计               | 43,963,754.99 | 77.16        |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 002436 | 兴森科技 | 130,080 | 2,964,523.20 | 5.20         |
| 2  | 002675 | 东诚药业 | 61,300  | 2,852,289.00 | 5.01         |
| 3  | 002672 | 东江环保 | 134,442 | 2,329,879.86 | 4.09         |
| 4  | 300207 | 欣旺达  | 89,924  | 2,308,349.08 | 4.05         |
| 5  | 300097 | 智云股份 | 44,819  | 2,243,190.95 | 3.94         |
| 6  | 300450 | 先导智能 | 47,400  | 2,106,456.00 | 3.70         |
| 7  | 002551 | 尚荣医疗 | 83,123  | 1,943,415.74 | 3.41         |
| 8  | 300326 | 凯利泰  | 70,000  | 1,749,300.00 | 3.07         |
| 9  | 002332 | 仙琚制药 | 150,000 | 1,680,000.00 | 2.95         |
| 10 | 600666 | 奥瑞德  | 45,906  | 1,595,692.56 | 2.80         |
| 11 | 000967 | 盈峰环境 | 70,000  | 1,553,300.00 | 2.73         |
| 12 | 300252 | 金信诺  | 46,067  | 1,526,199.71 | 2.68         |
| 13 | 300113 | 顺网科技 | 40,000  | 1,518,400.00 | 2.66         |
| 14 | 002008 | 大族激光 | 64,710  | 1,477,976.40 | 2.59         |
| 15 | 300144 | 宋城演艺 | 59,286  | 1,476,814.26 | 2.59         |
| 16 | 002055 | 得润电子 | 46,118  | 1,412,133.16 | 2.48         |
| 17 | 002123 | 荣信股份 | 50,267  | 1,045,050.93 | 1.83         |
| 18 | 300088 | 长信科技 | 64,420  | 957,925.40   | 1.68         |
| 19 | 300145 | 中金环境 | 40,000  | 875,200.00   | 1.54         |
| 20 | 002313 | 日海通讯 | 63,484  | 862,747.56   | 1.51         |
| 21 | 300224 | 正海磁材 | 36,165  | 819,860.55   | 1.44         |
| 22 | 600366 | 宁波韵升 | 33,968  | 810,816.16   | 1.42         |
| 23 | 600872 | 中炬高新 | 62,917  | 776,395.78   | 1.36         |
| 24 | 300357 | 我武生物 | 19,397  | 730,491.02   | 1.28         |
| 25 | 002739 | 万达院线 | 9,000   | 719,100.00   | 1.26         |
| 26 | 000671 | 阳光城  | 118,443 | 703,551.42   | 1.23         |
| 27 | 300383 | 光环新网 | 18,199  | 689,742.10   | 1.21         |
| 28 | 000673 | 当代东方 | 45,950  | 575,753.50   | 1.01         |
| 29 | 002712 | 思美传媒 | 14,400  | 547,488.00   | 0.96         |
| 30 | 300259 | 新天科技 | 42,847  | 541,157.61   | 0.95         |
| 31 | 300457 | 赢合科技 | 6,176   | 478,084.16   | 0.84         |
| 32 | 300253 | 卫宁健康 | 13,580  | 335,426.00   | 0.59         |
| 33 | 601777 | 力帆股份 | 25,483  | 299,934.91   | 0.53         |
| 34 | 600118 | 中国卫星 | 8,421   | 282,945.60   | 0.50         |
| 35 | 600965 | 福成股份 | 8,343   | 108,292.14   | 0.19         |
| 36 | 002588 | 史丹利  | 7,600   | 93,860.00    | 0.16         |
| 37 | 002466 | 天齐锂业 | 1,904   | 81,281.76    | 0.14         |
| 38 | 000532 | 力合股份 | 4,358   | 79,141.28    | 0.14         |
| 39 | 600325 | 华发股份 | 6,880   | 76,161.60    | 0.13         |
| 40 | 300508 | 维宏股份 | 295     | 75,077.50    | 0.13         |
| 41 | 300474 | 景嘉微  | 491     | 74,077.17    | 0.13         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 42 | 300503 | 昊志机电 | 830   | 70,317.60 | 0.12 |
| 43 | 300471 | 厚普股份 | 966   | 46,213.44 | 0.08 |
| 44 | 002179 | 中航光电 | 1,000 | 43,320.00 | 0.08 |
| 45 | 300505 | 川金诺  | 641   | 38,754.86 | 0.07 |
| 46 | 002798 | 帝王洁具 | 430   | 37,281.00 | 0.07 |
| 47 | 300510 | 金冠电气 | 469   | 31,685.64 | 0.06 |
| 48 | 002788 | 鹭燕医药 | 484   | 31,256.72 | 0.05 |
| 49 | 300506 | 名家汇  | 569   | 30,060.27 | 0.05 |
| 50 | 300511 | 雪榕生物 | 446   | 29,716.98 | 0.05 |
| 51 | 002797 | 第一创业 | 689   | 27,842.49 | 0.05 |
| 52 | 300515 | 三德科技 | 587   | 27,512.69 | 0.05 |
| 53 | 002793 | 东音股份 | 376   | 24,443.76 | 0.04 |
| 54 | 002795 | 永和智控 | 357   | 24,304.56 | 0.04 |
| 55 | 300512 | 中亚股份 | 240   | 23,980.80 | 0.04 |
| 56 | 002789 | 建艺集团 | 284   | 20,357.12 | 0.04 |
| 57 | 002799 | 环球印务 | 432   | 18,852.48 | 0.03 |
| 58 | 002790 | 瑞尔特  | 360   | 17,082.00 | 0.03 |
| 59 | 002791 | 坚朗五金 | 267   | 14,356.59 | 0.03 |
| 60 | 300518 | 盛讯达  | 240   | 11,244.00 | 0.02 |
| 61 | 002802 | 洪汇新材 | 553   | 8,339.24  | 0.01 |
| 62 | 300520 | 科大国创 | 369   | 3,708.45  | 0.01 |
| 63 | 002805 | 丰元股份 | 637   | 3,694.60  | 0.01 |
| 64 | 002381 | 双箭股份 | 147   | 1,933.05  | 0.00 |
| 65 | 600765 | 中航重机 | 1     | 14.58     | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 300207 | 欣旺达  | 2,274,391.43 | 3.35            |
| 2  | 300326 | 凯利泰  | 1,739,607.00 | 2.56            |
| 3  | 300144 | 宋城演艺 | 1,727,038.74 | 2.54            |
| 4  | 002332 | 仙琚制药 | 1,695,865.00 | 2.50            |
| 5  | 300252 | 金信诺  | 1,561,369.00 | 2.30            |
| 6  | 300113 | 顺网科技 | 1,524,194.00 | 2.24            |
| 7  | 000967 | 盈峰环境 | 1,471,515.00 | 2.17            |
| 8  | 002313 | 日海通讯 | 1,161,286.00 | 1.71            |
| 9  | 300145 | 中金环境 | 882,508.00   | 1.30            |
| 10 | 300383 | 光环新网 | 822,061.00   | 1.21            |
| 11 | 002675 | 东诚药业 | 311,691.00   | 0.46            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 002672 | 东江环保 | 306,712.00 | 0.45 |
| 13 | 002551 | 尚荣医疗 | 298,615.00 | 0.44 |
| 14 | 002436 | 兴森科技 | 291,109.00 | 0.43 |
| 15 | 002466 | 天齐锂业 | 280,583.00 | 0.41 |
| 16 | 600666 | 奥瑞德  | 237,256.00 | 0.35 |
| 17 | 002055 | 得润电子 | 167,508.00 | 0.25 |
| 18 | 300450 | 先导智能 | 153,108.00 | 0.23 |
| 19 | 600872 | 中炬高新 | 109,388.00 | 0.16 |
| 20 | 002739 | 万达院线 | 100,552.00 | 0.15 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 002466 | 天齐锂业 | 3,197,891.30 | 4.71            |
| 2  | 600325 | 华发股份 | 2,567,190.44 | 3.78            |
| 3  | 300457 | 赢合科技 | 2,438,252.24 | 3.59            |
| 4  | 000532 | 力合股份 | 2,044,672.77 | 3.01            |
| 5  | 002229 | 鸿博股份 | 1,829,234.95 | 2.69            |
| 6  | 000671 | 阳光城  | 1,461,639.38 | 2.15            |
| 7  | 000673 | 当代东方 | 1,218,884.01 | 1.79            |
| 8  | 600651 | 飞乐音响 | 1,120,250.95 | 1.65            |
| 9  | 300097 | 智云股份 | 927,738.70   | 1.37            |
| 10 | 002672 | 东江环保 | 396,533.23   | 0.58            |
| 11 | 002436 | 兴森科技 | 363,361.36   | 0.53            |
| 12 | 002551 | 尚荣医疗 | 333,173.38   | 0.49            |
| 13 | 300144 | 宋城演艺 | 291,014.76   | 0.43            |
| 14 | 002008 | 大族激光 | 249,651.07   | 0.37            |
| 15 | 600666 | 奥瑞德  | 247,253.53   | 0.36            |
| 16 | 002055 | 得润电子 | 241,922.26   | 0.36            |
| 17 | 600093 | 禾嘉股份 | 222,060.23   | 0.33            |
| 18 | 300252 | 金信诺  | 213,758.22   | 0.31            |
| 19 | 600872 | 中炬高新 | 141,429.70   | 0.21            |
| 20 | 300088 | 长信科技 | 131,462.82   | 0.19            |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 17,495,503.73 |
|---------------|---------------|

|               |               |
|---------------|---------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 20,486,663.57 |
|---------------|---------------|

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。



### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 7,545.69     |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,327,288.53 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,986.96     |
| 5  | 应收申购款   | 16,073.24    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,356,894.42 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 002672 | 东江环保 | 2,329,879.86    | 4.09             | 重大事项         |
| 2  | 300450 | 先导智能 | 2,106,456.00    | 3.70             | 重大事项         |

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |            |               |            |
|----------|---------------|-------|------------|---------------|------------|
|          |               | 机构投资者 |            | 个人投资者         |            |
|          |               | 持有份额  | 占总份额<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 47,880   | 891.85        | 0.84  | 0.00%      | 42,701,828.72 | 100.00%    |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 4.00      | 0.00%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2015年1月16日）基金份额总额 | 64,325,687.82 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 45,340,697.54 |
| 本报告期基金总申购份额               | 22,564,074.96 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 25,202,942.94 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额              | 42,701,829.56 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，聘任李永梅女士担任公司督察长；

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理，且不再代为履行督察长职务；

2016 年 6 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过，张峰先生不再担任本基金管理人总经理，由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务。

2016 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理，公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|----|------|-----------|----|
|      |    |      |           |    |

|      | 单元数量 | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |   |
|------|------|---------------|--------------|-----------|------------|---|
| 渤海证券 | 1    | -             | -            | -         | -          | - |
| 民族证券 | 1    | -             | -            | -         | -          | - |
| 银河证券 | 1    | -             | -            | -         | -          | - |
| 兴业证券 | 2    | 25,601,574.58 | 67.63%       | 23,842.68 | 67.63%     | - |
| 海通证券 | 2    | 5,060,057.34  | 13.37%       | 4,712.36  | 13.37%     | - |
| 国金证券 | 1    | 3,585,956.71  | 9.47%        | 3,339.66  | 9.47%      | - |
| 国泰君安 | 2    | 2,279,640.00  | 6.02%        | 2,123.03  | 6.02%      | - |
| 申万宏源 | 2    | 1,328,735.09  | 3.51%        | 1,237.48  | 3.51%      | - |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 回购交易           |              | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|----------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 渤海证券 | -    | -            | -              | -            | -    | -            |
| 民族证券 | -    | -            | -              | -            | -    | -            |
| 银河证券 | -    | -            | -              | -            | -    | -            |
| 兴业证券 | -    | -            | -              | -            | -    | -            |
| 海通证券 | -    | -            | -              | -            | -    | -            |
| 国金证券 | -    | -            | 142,700,000.00 | 95.97%       | -    | -            |

|      |   |   |              |       |   |   |
|------|---|---|--------------|-------|---|---|
| 国泰君安 | - | - | -            | -     | - | - |
| 申万宏源 | - | - | 6,000,000.00 | 4.03% | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                        | 法定披露日期     |
|----|--|-------------------------------|------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司关于指数熔断当日调整旗下部分基金开放时间及申购、赎回等业务安排的临时公告 | 公司官网                          | 2016-01-04 |
| 2  | 国泰基金管理有限公司关于指数熔断当日调整旗下部分基金开放时间及申购、赎回等业务安排的临时公告 | 公司官网                          | 2016-01-07 |
| 3  | 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-01-14 |
| 4  | 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-02-24 |
| 5  | 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-03-22 |
| 6  | 国泰基金管理有限公司督察长任职公告                              | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-03-26 |
| 7  | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-03-26 |
| 8  | 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2016-04-23 |
| 9  | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-06-08 |
| 10 | 国泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型公告                         | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-06-18 |
| 11 | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2016-07-12 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰目标收益保本混合型证券投资基金托管协议
- 3、中国证监会批准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的文件
- 4、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 5、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、法律法规要求备查的其他文件

### 11.2 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。

### 11.3 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  
二〇一六年八月二十六日