

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金

2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年一月二十日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2018 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰融安多策略灵活配置混合
基金主代码	003516
交易代码	003516
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 3 日
报告期末基金份额总额	49,389,500.65 份
投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略等。 1、大类资产配置策略 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，并结合市场环境灵活运用多种投资策略，建立成长投资策略、价值投资策略、主题投资策略、事件驱动策略、定向增发策略、次新股投资策略等多策略体系，根据市场环境的变化进行针对性的运用。 （1）成长投资策略 本基金将关注成长型上市公司，重点关注中小市值股票中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司，在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将适度提高成长精选股票的风险水平，对优质成长型公司可给予适当估值溢价。 （2）价值投资策略 价值投资策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资，本基金将根据不同行业特征和市场特征，综合运用市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市销率（P/S）、（P/E）/G、EV/EBITDA 以及现金流折现模型（DCF）等估值指标，精选价值被低估的上市公司进行投资。 （3）主题投资策略 在我国的不同经济发展阶段，由于社会、文化、科技、国内外宏观经济、国家政策、资本市场发展情况不同，具有不同的投资主题。本基金通过深入研究经济发展和资本市场趋势变化，对影响经济发展或企业盈利的关键性驱动因素及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘中长期
--	---

	主题投资机会，并精选出符合投资主题的行业以及具有核心竞争力的上市公司。 （4）事件驱动策略 本基金将持续关注事件驱动投资机会，重点关注的事项包括：1）并购重组，通过对上市公司资产重组、资产注入、公司兼并收购、公司股权变动、公司再融资、上市公司管理层变动、公司股权激励计划、新产品研发等可能对公司的经营方向、行业地位、核心竞争力产生重要影响的事件进行合理细致的分析，选择基本面向好的企业进行投资；2）定增破发，即在预案期内或锁定期内跌破定增价格的定向增发项目，并结合对其基本面的分析及市场未来走势进行判断，精选价值被低估的定增项目进行投资。 （5）定向增发策略 本基金从发展前景和估值水平两个角度出发，通过定性和定量分析相结合的方法评价定向增发项目对上市公司未来价值的影响。结合定向增发一二级市场价差的大小，理性做出投资决策。在严格控制风险的前提下，对投资组合进行优化配置和动态调整。 （6）次新股投资策略 次新股泛指最近特定时间段内（如过去一年、过去半年）首次公开募集的股票。本基金将根据次新股的自身特征，从上市时间、市值、网上中签率、行业、主题、高送转预期、价格等多方面综合分析，充分挖掘成长性高、安全边际较高的次新股进行投资。 3、债券投资策略 本基金综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机
--	--

	会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。 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	$\text{沪深 300 指数收益率} \times 50\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 50\%$
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。

基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-1,883,068.63
2. 本期利润	-584,147.49
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0127
4. 期末基金资产净值	49,378,189.66
5. 期末基金份额净值	0.9998

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

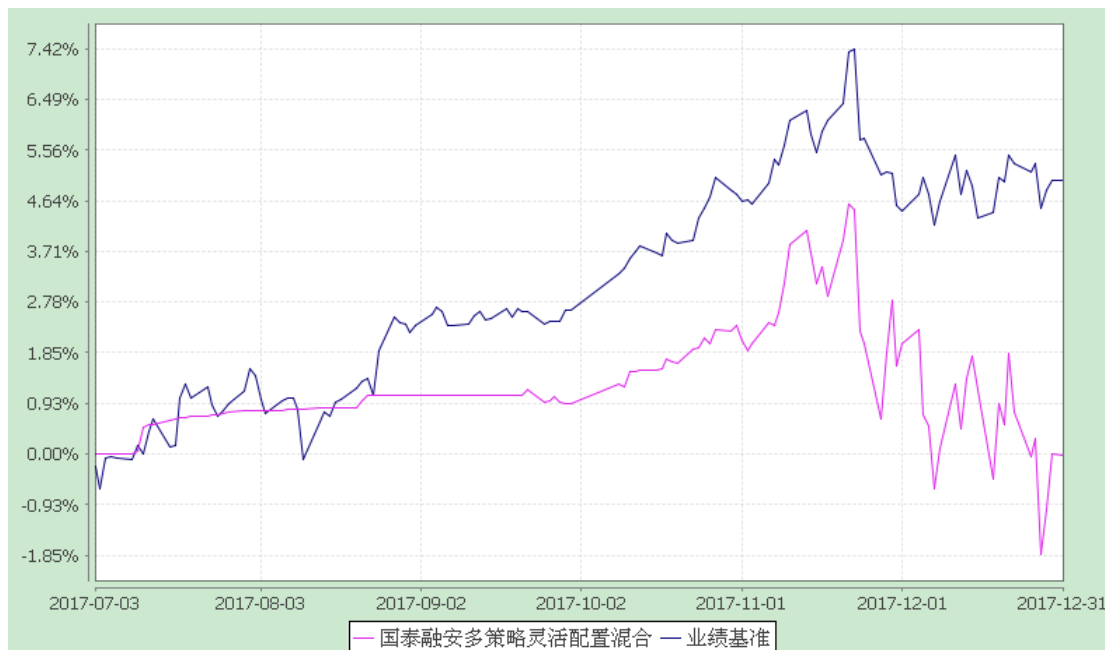
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.93%	0.78%	2.31%	0.41%	-3.24%	0.37%

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

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 7 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：（1）本基金合同生效日为2017年7月3日，截止至2017年12月31日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
樊利安	本基金的基金经理、国泰民益灵活配置混合（LOF）、国	2017-07-03	-	11 年	硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新

	泰浓益 灵活配 置混合、 国泰结 构转型 灵活配 置混合、 国泰国 策驱动 混合、 国泰兴 益灵活 配置混 合、国 泰生益 灵活配 置混合、 国泰睿 吉灵活 配置混 合、国 泰融丰 外延增 长灵活 配置混 合 (LOF)、国 泰添益 灵活配 置混合、 国泰福 益灵活 配置混 合、国 泰丰益 灵活配 置混合、 国泰景 益灵活 配置混 合、国 泰鑫益 灵活配			灵活配置混合型证券投资 基金)和国泰浓益灵活配 置混合型证券投资基金的 基金经理,2015 年 1 月起 兼任国泰结构转型灵活配 置混合型证券投资基金的 基金经理,2015 年 3 月起 兼任国泰国策驱动灵活配 置混合型证券投资基金的 基金经理,2015 年 5 月起 兼任国泰兴益灵活配置混 合型证券投资基金的基金 经理,2015 年 6 月起兼任 国泰生益灵活配置混合型 证券投资基金和国泰睿吉 灵活配置混合型证券投资 基金的基金经理,2015 年 6 月至 2017 年 1 月任国泰 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)的基金经理, 2016 年 5 月至 2017 年 11 月兼任国泰融丰定增灵 活配置混合型证券投资基 金的基金经理,2016 年 8 月起兼任国泰添益灵活配 置混合型证券投资基金的 基金经理,2016 年 10 月起 兼任国泰福益灵活配置混 合型证券投资基金的基金 经理,2016 年 11 月起兼任 国泰鸿益灵活配置混合型 证券投资基金的基金经理, 2016 年 12 月起兼任国泰丰 益灵活配置混合型证券投资 基金、国泰景益灵活配 置混合型证券投资基金、 国泰鑫益灵活配置混合型 证券投资基金、国泰泽益 灵活配置混合型证券投资 基金、国泰信益灵活配置 混合型证券投资基金、国 泰普益灵活配置混合型证 券投资基金、国泰安益灵
--	--	--	--	---

	置混合、 国泰泽 益灵活 配置混 合、国 泰信益 灵活配 置混合、 国泰普 益灵活 配置混 合、国 泰鸿益 灵活配 置混合、 国泰嘉 益灵活 配置混 合、国 泰安益 灵活配 置混合、 国泰众 益灵活 配置混 合、国 泰融信 定增灵 活配置 混合、 国泰稳 益定期 开放灵 活配置 混合、 国泰宁 益定期 开放灵 活配置 混合的 基金经 理、研 究部副 总监				活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金和国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月起兼任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金和国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月起任研究部副总监（主持工作）。
--	---	--	--	--	---

	(主持工作)				
高楠	本基金的基金经理	2017-11-24	-	5 年	硕士研究生。2007 年 7 月至 2008 年 12 月在中期期货有限公司工作，任分析师。2012 年 7 月至 2017 年 7 月在平安资产管理有限责任公司工作，历任分析师、投资经理。2017 年 8 月加入国泰基金管理有限公司，拟任基金经理。2017 年 11 月起任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和

利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年四季度，白马蓝筹股持续了年度的相对优势。最终上证指数下跌 1.25%，深证成指下跌 0.42%，创业板指下跌 6.12%，大小盘股风格分化再次增强。从行业来看，食品饮料、房地产、交运等行业涨幅较大，而有色、钢铁、纺织服装、电子等板块下跌，部分股票跌幅较大。

四季度宏观经济相比三季度略有下滑，低估值、业绩确定性强的白酒等行业涨幅较大；受制于宏观经济表现，周期股有明显回调。

本基金以绝对收益策略为主，保持了一定仓位参与新股申购，其余资金配置短久期债券以及货币化管理，今年以来取得了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2017 年第四季度的净值增长率为-0.93%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从四季度宏观数据来看，宏观经济相比三季度略有下滑，但是整体较为稳定。

2017 年以来，国内经济政策的重点从稳增长转向防风险和促改革，2018 年的基调保持一致。我们认为 2018 年宏观经济将持续平稳：受益于海外经济复苏，出口端有望稳中向好；国内地产投资增速相比 2017 年预计有所下行，但是下行幅度较小；消费平稳。我们看好以下几个方向：一是确定性较强、具有抗通胀属性的消费股，包括白酒、调味品等；二是基本面向好趋势确立的保险、银行、玻璃等行业；三是成长趋势较为确立、估值具有安全边际的优质地产白马；四是前期跌幅较大、估值具有安全边际的部分成长股。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现过超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	45,999,925.00	90.04
	其中：股票	45,999,925.00	90.04
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	5,065,701.25	9.92
7	其他各项资产	23,989.22	0.05
8	合计	51,089,615.47	100.00

5.2 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	1,916,140.00	3.88
B	采矿业	—	—
C	制造业	19,269,877.00	39.03

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,006,302.00	2.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,232,946.00	6.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,069,410.00	4.19
J	金融业	10,404,148.00	21.07
K	房地产业	4,020,910.00	8.14
L	租赁和商务服务业	3,011,712.00	6.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,068,480.00	2.16
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	45,999,925.00	93.16

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	473,600	3,637,248.00	7.37
2	002027	分众传媒	213,900	3,011,712.00	6.10
3	600519	贵州茅台	3,600	2,510,964.00	5.09
4	601398	工商银行	403,900	2,504,180.00	5.07
5	601601	中国太保	59,400	2,460,348.00	4.98
6	300170	汉得信息	173,900	2,069,410.00	4.19
7	600048	保利地产	144,600	2,046,090.00	4.14
8	601636	旗滨集团	320,700	2,001,168.00	4.05
9	000902	新洋丰	202,600	1,981,428.00	4.01
10	601155	新城控股	67,400	1,974,820.00	4.00

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“分众传媒”“新洋丰”公告其违规情况外），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。

中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）于 2017 年 4 月 17 日至 5 月 12 日对分众传媒进行了年报及重组上市事项现场检查，并于 2017 年 6 月 2 日向公司出具了《关于对分众传媒信息技术股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2017]14 号）。警示内容主要有两项：

一、分众传媒部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整，2015 年年报信息披露存在遗漏

具体情况：

（一）公司 2015 年年报财务报表附注“货币资金—使用有限制的货币资金”中未披露上海分众德峰广告传播有限公司银行账户被有权机关冻结的情况。

（二）公司披露与方源资本成立体育基金暨关联交易进展情况的时间晚于相关媒体发布会的时间。

（三）公司披露下属子公司与 WME/IMG 中国签订商业合作协议的公告，公告中关于协议的主要内容的表述过于简单，未将协议中主要条款进行充分披露。

整改措施： 公司将严格按照《上市公司信息披露管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等规定履行信息披露义务，同时公司将加强相关责任人员对证监会及深圳证券交易所相关法律、法规、规则的学习，进一步提升信息披露水平，提高信息披露质量。

二、分众传媒未在股东大会授权范围内购买银行理财产品

具体情况： 2016 年，经公司股东大会审议通过的相关《关于使用自有闲置资金购买银行理财产品的议案》均同意公司可以使用不超过一定额度的人民币的自有闲置资金购买安全性高、流动性好的、由商业银行发行的保证收益型的保本型理财产品，并授权公司总裁、财务负责人根据上述原则行使具体理财产品的购买决策权，并由财务部负责具体购买事宜。但公司实际购买的属于非保本

型浮动收益银行理财产品，公司未在股东大会授权范围内购买银行理财产品。

整改措施： 2017 年 6 月 6 日、2017 年 6 月 23 日，公司第六届董事会第十五次会议及公司 2017 年第一次临时股东大会审议通过了《公司关于使用自有闲置资金购买理财产品的议案》，同意公司使用不超过 100 亿元人民币的自有闲置资金购买安全性高、流动性好的理财产品，期限为自股东大会审议通过之日起一年内有效，在上述额度内资金可以滚动使用。同时，经公司第六届董事会第十五次会议审议通过，修订了《公司理财产品业务管理制度》。截止目前，上述未在股东大会授权范围内购买银行理财产品的情形已不存在。

公司将进一步强化公司使用闲置自有资金购买理财产品的业务流程管理与监督，公司将加强相关责任人员对证监会及深圳证券交易所相关法律、法规、规则的学习，严格按照《上市规则》等相关法律法规履行审批程序，并在有效的授权范围内开展公司的各项工作。

本基金管理人此前投资分众传媒股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就分众传媒被出具警示函事件进行了及时分析和研究，认为分众传媒存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

湖北洋丰集团股份有限公司（简称新洋丰）存在以下违规事实：一、信息披露违法违规；二、短线交易，洋丰集团的上述行为违反了《股票上市规则

（2014 年修订）》第 1.4 条、第 3.1.8 条的规定，洋丰集团时任董事长、法定代表人杨才学未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，违反了《股票上市规则

（2014 年修订）》第 1.4 条、第 2.3 条规定，对洋丰集团上述违规行为负有重要责任。证监会决定：一、对湖北洋丰集团股份有限公司给予公开谴责的处分；二、对湖北洋丰集团股份有限公司时任董事长、法定代表人杨才学给予公开谴责的处分。

本基金管理人此前投资新洋丰股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充

分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就新洋丰受处罚事件进行了及时分析和研究，认为新洋丰存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,423.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,565.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,989.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	38,317,585.16
报告期基金总申购份额	14,683,922.60
减：报告期基金总赎回份额	3,612,007.11
报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	49,389,500.65

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	19,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	19,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	40.49

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年10月1日至2017年12月31日	19,999,000.00	—	—	19,999,000.00	40.49%
	2	2017年10月	9,999,	—	—	9,999,000.00	20.25%

		1 日至 2017 年 12 月 31 日	000.00			0	
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、国泰国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一八年一月二十日