

国泰创利债券型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告日期:二〇一五年十月二十六日

重要提示

基金管理人的董事、监事及本基金的财务顾问不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对基金内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和组合报告等内容，保证复核的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信义务、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金过往的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告书的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:国泰创利债券

基金代码:020202

交易代码:020202

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014年10月14日

报告期末基金净值总额:0.791,726.06份

投资目标:本基金主要投资于固定收益类金融工具，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增长。

显示，非农就业数据进一步回落并大幅低于市场预期，美联储加息概率不断下降；国内市场方面，经济依然低迷，而油价从高位价格重新回落，通胀风险有所缓解。同时人民币贬值预期有所改善，因此宽松货币政策将待降，季度利率将适度降低，市场流动性整体无余。

债市方面，尽管近期债市出现下跌趋势，但整体收益率仍较低，各期限品种收益齐齐走低，收益率均持续下行，牛市行情得以延续。国债利率也进一步走低，收益率也呈现逐步走低的趋势。从历史的低位，信用品种收益率下幅超过30BP，信用品种收益率也呈现逐步走低的趋势。从历史的低位，信用品种收益率下幅超过30BP，信用品种收益率也呈现逐步走低的趋势。

本基金维持中长期策略，受市场波动影响较小，本基金前三季度在债券方面继续卖出，为基金补充流动性。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内的业绩评价为2.07%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

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2015年四季度，宏观经济数据仍不容乐观，9月以来油价指数屡创新低，通胀风险有所缓解。同时人民币贬值预期有所改善，因此宽松货币政策将待降，季度利率将适度降低，市场流动性整体无余。

债市方面，尽管近期债市出现下跌趋势，但整体收益率仍较低，各期限品种收益齐齐走低，收益率均持续下行，牛市行情得以延续。国债利率也进一步走低，收益率也呈现逐步走低的趋势。从历史的低位，信用品种收益率下幅超过30BP，信用品种收益率也呈现逐步走低的趋势。

本基金在报告期内的业绩评价为2.07%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金已超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千元。

§ 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	股权投资	-	-
2	其他投资	-	-
3	固收类投资	8,291,169.00	90.04
4	其中:债券	8,291,169.00	90.04
5	货币市场基金	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,243,564.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合

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十名股票投资明细

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

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十名贵金属投资明细

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十名权证投资明细

5.9 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指期货投资明细

5.10 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国债期货投资明细

5.11 投资组合报告附注

5.12 基金转型以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

5.13 主要财务指标和基金净值表现

5.14 报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 基本份额本期未持有股票。

5.17 基本份额本期未持有贵金属。

5.18 基本份额本期未持有权证。

5.19 基本份额本期未持有股指期货。

5.20 基本份额本期未持有国债期货。

5.21 基本份额本期未持有股票期权的投资。

5.22 本基金转型以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

5.23 基本份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.24 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.25 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.26 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.27 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.28 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.29 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.30 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.31 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.32 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.33 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.34 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.35 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.36 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.37 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.38 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.39 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.40 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.41 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.42 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.43 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.44 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.45 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.46 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.47 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.48 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.49 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.50 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.51 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.52 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.53 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.54 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.55 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.56 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.57 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.58 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.59 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.60 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.61 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.62 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.63 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年12月31日至2015年9月30日)

5.64 基本份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图