

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年三月二十九日

重要提示
 基金管理人的董事、董事会秘书或投资决策机构负责人对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。本基金报告书经三分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
 基金托管人招行银行有限公司根据本基金合同规定，于2012年3月20日复核了本报告书，无异议。本报告书经复核后报出。
 报告期内，本基金的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，报告日期为2011年4月19日，基金合同生效日起至2011年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金简称	国泰保本混合	基金代码	020022
基金管理人	国泰基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2011年4月19日
报告期末基金份额总额	2,329,494,373.44份	基金总资产	2,329,494,373.44元

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰保本混合	基金代码	020022
基金管理人	国泰基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金运作方式	契约型开放式	基金合同生效日	2011年4月19日
报告期末基金份额总额	2,329,494,373.44份	基金总资产	2,329,494,373.44元

2.2 基金声明

在严格保护投资人合法权益的前提下，为投资人提供稳健资金安全的保证，并在此基础上力争最大利益。

本基金采用比例配售组合投资（CPP, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产的股票、债券及货币市场工具等投资品种的配置比例，以实现保本和增值的双重目标。

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，投资人投资于本基金时应仔细阅读该基金的招募说明书及其摘要。

报告期截至2011年4月19日，基金合同生效日起至2011年12月31日止。

§ 3 基金运作

在严格控制风险的前提下，为投资人提供稳健资金安全的保证，并在此基础上力争最大利益。

本基金采用比例配售组合投资（CPP, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产的股票、债券及货币市场工具等投资品种的配置比例，以实现保本和增值的双重目标。

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，投资人投资于本基金时应仔细阅读该基金的招募说明书及其摘要。

报告期截至2011年4月19日，基金合同生效日起至2011年12月31日止。

§ 4 基金投资

在严格控制风险的前提下，为投资人提供稳健资金安全的保证，并在此基础上力争最大利益。

本基金采用比例配售组合投资（CPP, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产的股票、债券及货币市场工具等投资品种的配置比例，以实现保本和增值的双重目标。

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，投资人投资于本基金时应仔细阅读该基金的招募说明书及其摘要。

报告期截至2011年4月19日，基金合同生效日起至2011年12月31日止。

§ 5 基金净值

在严格控制风险的前提下，为投资人提供稳健资金安全的保证，并在此基础上力争最大利益。

本基金采用比例配售组合投资（CPP, Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产的股票、债券及货币市场工具等投资品种的配置比例，以实现保本和增值的双重目标。

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，投资人投资于本基金时应仔细阅读该基金的招募说明书及其摘要。

报告期截至2011年4月19日，基金合同生效日起至2011年12月31日止。

§ 6 审计报告

本基金于2011年度财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师签章出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登录本公司网站的年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报告

会计主体：国泰保本混合型证券投资基金

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

报告期间：2011年4月19日至2011年12月31日

报告期金额：2,267,386,060.42元

报告期基金净值：0.974元

报告期基金份额：2,329,494,373.44份

报告期基金份额净值：0.974元

报告期基金份额净值增长率：-2.60%

报告期基金份额净值增长率标准差：-2.60%

报告期基金份额净值增长率相对标准差：-2.60%

报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差异：-2.60%

报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差异标准差：-2.60%

报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差异相对标准差：-2.60%

报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差异相对标准