

国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

[2015] 第二季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

基金管理人的董事会及监事保证本基金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。
基金托管人宁波银行股份有限公司承诺,在本报告书中披露的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息,保证复核无误不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人和基金托管人对本基金的定期报告出具意见,认为复核无误,但不保证基金净值。基金的过往业绩并不代表未来的业绩,投资者应谨慎选择。

本报告期:2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
场内简称	
基金主代码	160220
交易代码	160220
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月30日
报告期末基金份额总额	8,733,386,817.00
投资目标	通过资产配置,在控制风险的前提下,追求资产的长期增值。

投资策略

1. 大类资产配置策略:本基金的大类资产配置主要是通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策及货币资金的环境、证券市场的走势分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评估未来一段时期内,债券、股票、商品等大类资产的预期收益,从而决定大类资产的配置比例。

2. 股票投资策略:本基金将充分运用定量分析的方法,从公司基本面出发,运用基金管理人研究部对上市公司估值的方法,结合行业估值和个股估值,挑选出估值水平较低且成长性较高的股票进行投资。

3. 债券投资策略:本基金将充分运用定量分析的方法,从公司基本面出发,运用基金管理人研究部对上市公司估值的方法,结合行业估值和个股估值,挑选出估值水平较低且成长性较高的债券进行投资。

4. 投资操作策略:本基金将充分运用定量分析的方法,从公司基本面出发,运用基金管理人研究部对上市公司估值的方法,结合行业估值和个股估值,挑选出估值水平较低且成长性较高的股票进行投资。

5. 权证投资策略:本基金将充分运用定量分析的方法,从公司基本面出发,运用基金管理人研究部对上市公司估值的方法,结合行业估值和个股估值,挑选出估值水平较低且成长性较高的股票进行投资。

6. 其他投资策略:本基金将充分运用定量分析的方法,从公司基本面出发,运用基金管理人研究部对上市公司估值的方法,结合行业估值和个股估值,挑选出估值水平较低且成长性较高的股票进行投资。

7. 行业配置策略:本基金将充分运用定量分析的方法,从公司基本面出发,运用基金管理人研究部对上市公司估值的方法,结合行业估值和个股估值,挑选出估值水平较低且成长性较高的股票进行投资。

8. 风险收益特征:本基金为混合型基金,其风险收益特征介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益特征的基金。

9. 基金的申购赎回原则:本基金的申购赎回遵循“未知价”原则,即申购价格以提交申请当日的基金份额净值为基准计算;赎回价格以赎回申请当日的基金份额净值为基准计算。

10. 基金的登记机构:国泰基金管理有限公司。

11. 基金销售机构:宁波银行股份有限公司。

12. 基金的上市交易场所:深圳证券交易所。

13. 基金的登记机构:国泰基金管理有限公司。

14. 基金的过户、登记及清算机构:国泰基金管理有限公司。

15. 基金的会计年度:每年度的12月31日。

16. 基金的估值频率:每工作日。

17. 基金的开放日:除法律法规另有规定外,本基金管理人不得拒绝持有人的申购和赎回申请。

18. 基金的交易时间:本基金管理人公告的基金交易时间。

19. 基金的认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资业务:本基金管理人公告的基金认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资业务。

20. 基金的非交易过户:本基金管理人公告的基金非交易过户。

21. 基金的冻结、解冻:本基金管理人公告的基金冻结、解冻。

22. 基金的质押:本基金管理人公告的基金质押。

23. 基金的定期报告:本基金管理人公告的基金定期报告。

24. 基金的临时报告:本基金管理人公告的基金临时报告。

25. 基金的清算:本基金管理人公告的基金清算。

26. 基金的终止:本基金管理人公告的基金终止。

27. 基金的报告期:本基金管理人公告的基金报告期。

28. 基金的管理人:国泰基金管理有限公司。

29. 基金的托管人:宁波银行股份有限公司。

30. 基金的份额净值:基金单位资产净值。

31. 基金的申购:指投资人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望成为基金持有人的行为。

32. 基金的赎回:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望退出基金的行为。

33. 基金的转换:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望变更基金品种,将持有的基金份额从一个基金转换到另一个基金的行为。

34. 基金的定期定额投资:指投资人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地购买基金的行为。

35. 基金的非交易过户:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望将持有的基金份额从一个账户转移到另一个账户的行为。

36. 基金的冻结:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望将持有的基金份额冻结的行为。

37. 基金的解冻:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望将持有的基金份额解冻的行为。

38. 基金的质押:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望将持有的基金份额质押给基金管理人,并由基金管理人向第三方提供担保的行为。

39. 基金的定期报告:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

40. 基金的临时报告:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

41. 基金的报告期:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

42. 基金的管理人:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

43. 基金的托管人:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

44. 基金的份额净值:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

45. 基金的定期定额投资:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

46. 基金的非交易过户:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

47. 基金的冻结:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

48. 基金的解冻:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

49. 基金的质押:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

50. 基金的定期报告:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

51. 基金的临时报告:指基金持有人根据基金章程的规定向基金管理人提出,希望定期、定时地了解基金投资运作情况,并由基金管理人向基金持有人报告的行为。

52. 基金的产品概况

53. 主要财务指标和基金净值表现

54. 管理人报告

55. 投资组合报告

56. 开放式基金份额变动

57. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

58. 2015年第二季度报告附注

59. 基金管理人对本基金运作的说明

60. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

61. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

62. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

63. 基金管理人对本基金的合规经营声明

64. 基金管理人对本基金的监督情况

65. 基金管理人对本基金的客户投诉情况

66. 基金管理人对本基金的人员管理情况

67. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

68. 基金管理人对本基金的信息披露情况

69. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

70. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

71. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

72. 基金管理人对本基金的合规经营声明

73. 基金管理人对本基金的监督情况

74. 基金管理人对本基金的人员管理情况

75. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

76. 基金管理人对本基金的信息披露情况

77. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

78. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

79. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

80. 基金管理人对本基金的合规经营声明

81. 基金管理人对本基金的监督情况

82. 基金管理人对本基金的人员管理情况

83. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

84. 基金管理人对本基金的信息披露情况

85. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

86. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

87. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

88. 基金管理人对本基金的合规经营声明

89. 基金管理人对本基金的监督情况

90. 基金管理人对本基金的人员管理情况

91. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

92. 基金管理人对本基金的信息披露情况

93. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

94. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

95. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

96. 基金管理人对本基金的合规经营声明

97. 基金管理人对本基金的监督情况

98. 基金管理人对本基金的人员管理情况

99. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

100. 基金管理人对本基金的信息披露情况

101. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

102. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

103. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

104. 基金管理人对本基金的合规经营声明

105. 基金管理人对本基金的监督情况

106. 基金管理人对本基金的人员管理情况

107. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

108. 基金管理人对本基金的信息披露情况

109. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

110. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

111. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

112. 基金管理人对本基金的合规经营声明

113. 基金管理人对本基金的监督情况

114. 基金管理人对本基金的人员管理情况

115. 基金管理人对本基金的监察稽核情况

116. 基金管理人对本基金的信息披露情况

117. 基金管理人对本基金的内部控制制度的说明

118. 基金管理人对本基金的公平交易制度的说明

119. 基金管理人对本基金的异常交易行为的说明

120. 基金管理人对本基金的合规经营声明

121. 基金管理人对本基金的监督情况