(上接B135版)

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:2015年1月16日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月16日至2015年12月31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)	64,325,687.92	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)	–	24,787,700.08	24,787,700.08
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)	-26,013,879.11	-6,875,076.56	-32,888,956.67
其中:1.基金申购款	70,040,279.51	40,503,379.73	110,543,660.24
2.基金赎回款	-96,054,158.62	-47,378,456.29	-143,432,614.91
四、本期内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)	38,311,808.71	29,654,118.32	67,965,927.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.2.1至7.2.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:张峰,主管会计工作负责人:李辉,会计机构负责人:倪蓥

7.2.4报表附注

7.2.4.1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%×沪深300指数收益率+40%×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3月25日批准报出。

7.2.4.2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》和在财务报表附注7.2.4.4所列示的中国证监会、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。

7.2.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年1月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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2015年12月31日的财务状况以及2015年1月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年1月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

7.2.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.2.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.2.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.2.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.2.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.2.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.2.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.2.4.5.2会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.2.4.5.3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。

7.2.4.6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[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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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。

7.2.4.7关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司	基金管理人的控股股东
申万宏源集团股份有限公司("申万宏源")	受基金管理人的控股股东(中国建投)控制的公司
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
国泰金球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.本报告期内,申银万国证券股份有限公司吸收合并了基金管理人原关联方宏源证券股份有限公司,并更名为申万宏源集团股份有限公司(以下简称"申万宏源")。申万宏源为基金管理人控股股东中国建银投资有限责任公司的控股子公司。

7.2.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.8.1.1股票交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月16日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	16,441,832.89	4.85%

7.2.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.2.4.8.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月16日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源	11,790,421.53	13.70%

7.2.4.8.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月16日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
申万宏源	120,800,000.00	24.10%

7.2.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月16日至2015年12月31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	14,990.89	4.84%	1,032.66	3.05%

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。

7.2.4.8.2关联方报酬

7.2.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月16日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	928,963.94
其中:支付销售机构的客户维护费	424,628.64

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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.2.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月16日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	154,827.30

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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.2.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2.4.8.4.2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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.2.4.8.5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 2015年1月16日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,833,502.69	28,393.71

注:本基金的活期银行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。

7.2.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.2.4.9期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.2.4.9.2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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300088	长信科技	2015-12-14	重大事项	14.03	2016-02-29	12.63	75,894.00	1,140,196.49	1,064,792.82	–

注:本基金截至2015年12月31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。

7.2.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.9.3.1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。

7.2.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,900,000.00元,于2016年1月4日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.2.4.10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2015年12月31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52,636,685.16元,属于第二层次的余额为15,732,872.02元,无属于第三层次的余额。

(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和债券,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和债券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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金于2015年3月25日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.2.4. 5.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 国泰目标收益保本混合型证券投资基金

8.1.1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	9,722,070.85	12.15
	其中:股票	9,722,070.85	12.15
2	固定收益投资	48,852,622.00	61.04
	其中:债券	48,852,622.00	61.04
	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	10,000,000.00	12.49
	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	4,471,018.92	5.59
7	其他各项资产	6,989,413.80	8.73
8	合计	80,035,125.57	100.00

8.1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	2,566,206.24	3.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	877,450.00	1.15
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	162,030.10	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	1,102,404.33	1.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,648,471.18	4.80
J	金融业	1,363,374.78	1.79
K	房地产业	5,623.56	0.01
L	租赁和商务服务业	6,516.66	0.01
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	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	9,722,070.85	12.79

8.1.3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

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	002148	北纬通信	100,000	1,915,000.00	2.52
2	300359	全通教育	14,000	1,461,320.00	1.92
3	601688	华泰证券	52,019	1,353,534.38	1.78
4	600754	锦江股份	43,903	1,102,404.33	1.45
5	600366	宁波韵升	50,000	908,500.00	1.19
6	000685	中山公用	40,250	877,450.00	1.15
7	002475	立讯精密	16,594	533,497.10	0.70
8	002236	大华股份	14,157	366,383.16	0.48
9	002366	丹甫股份	10,000	357,100.00	0.47
10	600037	歌华有线	13,552	229,028.80	0.30

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.1.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1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	600366	宁波韵升	851,904.97	0.91
2	002366	丹甫股份	359,879.00	0.38

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。

8.1.4.2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

本基金本报告期无累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票。

8.1.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	1,211,783.97
卖出股票的收入(成交)总额	

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。

8.1.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,013,500.00	6.59
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	23,476,122.00	31.13
5	企业短期融资券	20,163,000.00	26.51
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	其他	–	–
9	合计	48,852,622.00	64.22

8.1.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1280089	12联泰债	200,000	20,942,000.00	27.53
2	041456022	14新中泰集CP001	100,000	10,095,000.00	13.27
3	041464042	14糖业元CP001	100,000	10,068,000.00	13.24
4	019407	14国债07	50,000	5,013,500.00	6.59
5	122830	11无锡债	25,600	2,627,328.00	3.46

8.1.7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。

8.1.8 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。

8.1.9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。

8.1.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1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。

8.1.10.2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。

8.1.11 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。

8.1.12投资组合报告附注

8.1.12.1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。

8.1.12.2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。

8.1.12.3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	56,543.17
2	应收证券清算款	5,000,839.83
3	应收股利	–
4	应收利息	1,932,030.93
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,989,413.80

8.1.12.4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。

8.1.12.5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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002148	北纬通信	1,915,000.00	2.52	非公开发行
2	300359	全通教育	1,461,320.00	1.92	重大事项
3	600754	锦江股份	1,102,404.33	1.45	重大事项

8.2 国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

8.2.1 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	53,701,477.98	74.23
	其中:股票	53,701,477.98	74.23
2	固定收益投资	14,668,079.20	20.27
	其中:债券	14,668,079.20	20.27
	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	3,241,903.99	4.48
7	其他各项资产	735,508.46	1.02
8	合计	72,346,969.63	100.00

8.2.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	168,843.50	0.23
B	采矿业	–	–
C	制造业	35,505,219.28	52.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,621.70	0.04
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	418,800.00	0.62
J	金融业	–	–
K	房地产业	6,656,200.00	9.79
L	租赁和商务服务业	640,000.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,823,800.00	4.15
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	3,400,033.50	5.00
S	综合	4,068,960.00	5.99
	合计	53,701,477.98	79.01

8.2.3 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	000532	力合股份	147,000	4,068,960.00	5.99
2	600325	华发股份	220,000	3,586,000.00	5.28
3	000671	阳 光 城	340,000	3,070,200.00	4.52
4	002675	东诚药业	54,000	3,024,540.00	4.45
5	300097	智云股份	64,667	3,003,782.15	4.42
6	002561	尚荣医疗	86,478	2,851,779.66	4.20
7	002672	东江环保	140,000	2,823,800.00	4.15
8	300457	赢合科技	40,000	2,660,000.00	3.91
9	002436	兴森科技	135,371	2,605,891.75	3.83
10	000673	当代东方	69,915	2,440,033.50	3.59
11	002466	天齐锂业	17,000	2,392,750.00	3.52
12	600666	奥瑞德	47,733	2,254,906.92	3.32
13	002229	鸿博股份	74,000	2,202,240.00	3.24
14	002008	大族激光	76,435	1,978,902.15	2.91
15	002366	丹甫电子	47,917	1,852,471.22	2.73
16	002123	梦饷股份	56,400	1,421,010.00	2.09
17	300450	先导智能	14,000	1,391,460.00	2.05
18	300088	长信科技	75,894	1,064,792.82	1.57
19	600651	飞乐音响	70,000	1,032,500.00	1.52
20	600872	中炬高新	65,527	1,025,497.55	1.51
21	300357	我武生物	20,000	1,014,000.00	1.49
22	002739	万达院线	8,000	960,000.00	1.41
23	300224	正海磁材	40,490	942,380.40	1.39
24	600366	宁波韵升	40,000	873,600.00	1.29
25	002712	思美传媒	5,000	640,000.00