

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  
报告期起止日期：2015年1月1日至2015年12月31日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事长、新任基金经理不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担责任。本公司保证本年度报告所披露的信息真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人的银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金合同生效后，基金管理人将不办理赎回，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及其更新。

本年度报告摘要由年度报告全文，投资者欲了解详细内容，阅读年度报告正文。

本报告所涉及的数据以审计报告、资产评估报告等书面形式载入年度报告。

本报告期间自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

### § 2 基金简介

#### 2.1 基金概况

基金名称 国泰保本混合型证券投资基金

基金代码 020022

交易代码 020022

契约型开放式

2011年4月19日

国泰基金管理有限公司

招商银行股份有限公司

报告期末份额总额 993,568,595份

基金份额净值 1.00元

定期

2.2 基金产品说明

本基金严格控制风险的前提下，为投资人提供资金安全的保证，并在此基础上力争基金资产的增值。

本基金采用恒定比例投资策略（Constant Proportion Portfolio Immunities），即投资组合的总资产在扣除应付赎回的现金后，不能低于总资产的95%，并保持不低于总资产5%的现金资产。

本基金在投资运作中主要通过资产配置策略来依据，动态调整资产的配置比例，以实现收益与风险的匹配。

（1）资产配置策略

本基金通过宏观经济分析、行业景气度分析、估值方法分析等手段来判断不同资产类别的预期收益率，从而决定资产配置的比例。

（2）股票投资策略

本基金通过深入研究上市公司的基本面，分享股票市场成长收益。

（3）债券投资策略

本基金通过深入研究宏观经济、利率走势、信用利差、流动性、资金面、政策面等多方面因素，选择具有较好投资价值的债券品种。

（4）权证投资策略

本基金通过深入研究权证的定价模型，把握权证的投资机会。

（5）货币市场工具投资策略

本基金通过深入研究货币市场的运行规律，选择具有较好投资价值的货币市场工具。

（6）衍生品投资策略

本基金通过深入研究衍生品的定价模型，选择具有较好投资价值的衍生品。

（7）其他投资策略

本基金通过深入研究其他金融产品的定价模型，选择具有较好投资价值的其他金融产品。

（8）投资限制

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（9）投资组合管理

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（10）投资决策流程

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（11）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（12）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（13）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（14）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（15）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（16）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（17）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（18）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（19）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（20）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（21）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（22）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（23）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（24）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（25）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（26）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（27）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（28）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（29）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（30）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（31）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（32）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（33）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（34）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（35）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（36）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（37）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（38）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（39）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（40）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（41）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（42）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（43）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（44）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（45）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（46）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（47）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（48）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（49）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（50）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（51）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（52）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（53）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（54）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（55）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（56）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（57）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（58）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（59）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（60）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（61）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（62）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（63）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（64）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（65）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定和自律规则，选择具有较好投资价值的法律法规允许投资的品种。

（66）投资决策委员会

本基金通过深入研究法律法规、监管规定