

国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)

[2015] 年度报告摘要

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
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

基金管理人的董事会、董事保证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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人根据法律法规的规定履行了监督职责，对本基金的投资组合比例、财务会计报告、投资组合报告等进行复核。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人认购、投资本基金，投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告年度报告摘要供基金份额持有人、投资人和潜在投资人了解情况，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金报告自2015年1月1日起至12月31日止。

\$ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)
场内简称	国泰商品
基金代码	160216
交易代码	160216
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月3日
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
报告期末基金总资产	1,382,562,523.19元
基金合同的存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金通过大宗商品品种的配置以及在商品类、固定收益类资产间的动态配置，力求有效控制净值波动率并获得稳定的收益。
投资策略	本基金的投研策略为基本面确定性配置比例，包括商品类、固定收益类资产的大类资产配置比例和商品品种的品种配比，然后以配置比例为参数构建投资组合，根据市场动态调整固定收益类资产比例，以求将投资组合的整体风险控制在特定的水平以内。
业绩比较基准	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的业绩比较基准为“人民币(一年化)”。因基金收益币种不同，因此本基金属于证券投资基金中的较高预期风险和预期收益的基金。
风险特征	本基金为股票型基金，基金管理人尽力使本基金在风险控制的前提下实现较高的收益。

2.3 基金管理人和基金托管人	
项目	基金管理人 基金托管人
名称	国泰基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人姓名	巴康 田青
联系电话	021-31016000 010-67050006
电子邮箱	tianqing@gtfund.com
客户服务电话	(021)31090000, 400-888-1688 010-67050006
传真	021-31018000 010-66275883

2.4 境外资产托管人	
项目	境外资产托管人
名称	State Street Bank and Trust Company
英文	State Street Bank and Trust Company
中文	美国国民银行
注册地址	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮编	02111

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址: <http://www.gtfund.com>

基金年度报告备置地点: 上海市徐汇区宜山路18号裕昌大厦16层-10层北京申银证券区域

上海市大沽路10号1楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标				
	金额单位:人民币元			
3.1.1 日间数据和指标	2015年 2014年 2013年			
本期已实现收益	-8,020,807.71	-3,273,055.69	-3,306,283.37	
本期利润	-51,861,560.72	-2,768,408.42	-7,701,897.12	
加权平均基金份额本期利润	-0.1739	-0.1098	-0.1732	
本期基金份额净值增长率	-30.62%	-17.39%	-16.36%	
3.1.2 期末数据和指标	2015年末 2014年末 2013年末			
期末可供分配基金份额利润	-0.0566	-0.3156	-0.1717	
期末基金净值	6,791,497.4012	11,899,696.67	28,176,414.73	
期末基金份额净值	0.6843	0.6286		

注: (1) 本期已实现收益指基金本期利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额,本期利润为当期已实现收益加上上期平均公允价值变动收益;
(2) 所述基金业业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金业业绩指标;

3.2 基金的基本情况

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 份额净值增长 基准收益率 基准收益率 (①-②)	①-③	②-④	
过去三个月	-21.63%	2.18%	-6.63%	0.91%
过去六个月	-38.04%	2.31%	-13.06%	0.98%
过去一年	-39.62%	2.01%	-14.36%	0.93%
过去三年	-58.26%	1.25%	-40.66%	0.74%
自基金合同生效起至今	-57.70%	1.14%	-40.40%	0.70%
注: (1) 本期份额净值增长率=当期已实现收益+上期平均公允价值变动收益;				
(2) 所述基金业业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金业业绩指标;				

3.2.2 基金合同生效以来基金业业绩指标

3.2.3 基金的财务指标

3.2.4 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 份额净值增长 基准收益率 基准收益率 (①-②)	①-③	②-④	
过去三个月	-21.63%	2.18%	-6.63%	0.91%
过去六个月	-38.04%	2.31%	-13.06%	0.98%
过去一年	-39.62%	2.01%	-14.36%	0.93%
过去三年	-58.26%	1.25%	-40.66%	0.74%
自基金合同生效起至今	-57.70%	1.14%	-40.40%	0.70%
注: (1) 本期份额净值增长率=当期已实现收益+上期平均公允价值变动收益;				
(2) 所述基金业业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的基金业业绩指标;				

3.2.5 基金的资产配置

3.2.6 基金的资产配置

3.2.7 基金的资产配置

3.2.8 基金的资产配置

3.2.9 基金的资产配置

3.2.10 基金的资产配置

3.2.11 基金的资产配置

3.2.12 基金的资产配置

3.2.13 基金的资产配置

3.2.14 基金的资产配置

3.2.15 基金的资产配置

3.2.16 基金的资产配置

3.2.17 基金的资产配置

3.2.18 基金的资产配置

3.2.19 基金的资产配置

3.2.20 基金的资产配置

3.2.21 基金的资产配置

3.2.22 基金的资产配置

3.2.23 基金的资产配置

3.2.24 基金的资产配置

3.2.25 基金的资产配置

3.2.26 基金的资产配置

3.2.27 基金的资产配置

3.2.28 基金的资产配置

3.2.29 基金的资产配置

3.2.30 基金的资产配置

3.2.31 基金的资产配置

3.2.32 基金的资产配置

3.2.33 基金的资产配置

3.2.34 基金的资产配置

3.2.35 基金的资产配置

3.2.36 基金的资产配置

3.2.37 基金的资产配置

3.2.38 基金的资产配置

3.2.39 基金的资产配置

3.2.40 基金的资产配置

3.2.41 基金的资产配置

3.2.42 基金的资产配置

3.2.43 基金的资产配置

3.2.44 基金的资产配置

3.2.45 基金的资产配置

3.2.46 基金的资产配置

3.2.47 基金的资产配置

3.2.48 基金的资产配置

3.2.49 基金的资产配置

3.2.50 基金的资产配置

3.2.51 基金的资产配置

3.2.52 基金的资产配置