

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

基金名称:国泰金马稳健回报证券投资基金
基金简称:国泰金马稳健回报
基金代码:020006
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年06月18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:1,631,162,304.89元
基金合同终止日期:不定期

2.1 基金基本情况

基金名称:国泰金马稳健回报

基金代码:020006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年06月18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:1,631,162,304.89元

基金合同终止日期:不定期

2.2 基金产品说明

投资目标:通过选股、债券资产和现金类资产的合理配置,高度适应中国经济经济的发展变化,同时不追求过高收益,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金在投资策略上主要根据中国经济的长期发展和变化,通过不同时间期限的长期和短期的配置,通过投资组合的深入研究,在经历长期大幅震荡后,长线投资者对A股市场的信心恢复还需要一定的时间,虽然大量资金在A股市场的投资热情依然高涨,但A股市场的估值已经相对较高,因此在长线投资的框架下,本基金将主要配置在金融、环保和二线蓝筹,四季度将侧重于中小板和创业板上。

基金经理:承诺以诚信、勤勉尽责的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利。

基金年度报告摘要:正文中对基金年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告为财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

2.3 基金简介

基金名称:国泰金马稳健回报

基金代码:020006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年06月18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:1,631,162,304.89元

基金合同终止日期:不定期

2.4 基金产品说明

投资目标:通过选股、债券资产和现金类资产的合理配置,高度适应中国经济经济的发展变化,同时不追求过高收益,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金在投资策略上主要根据中国经济的长期发展和变化,通过不同时间期限的长期和短期的配置,通过投资组合的深入研究,在经历长期大幅震荡后,长线投资者对A股市场的信心恢复还需要一定的时间,虽然大量资金在A股市场的投资热情依然高涨,但A股市场的估值已经相对较高,因此在长线投资的框架下,本基金将主要配置在金融、环保和二线蓝筹,四季度将侧重于中小板和创业板上。

基金经理:承诺以诚信、勤勉尽责的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利。

基金年度报告摘要:正文中对基金年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告为财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

2.5 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

姓名 巴立勋 田青

信息披露负责人 联系电话 021-51081600 电子邮箱 xinxilb@gtfund.com

客户服务电话 (021)31989000,400-888-0668 传真 010-67596096

021-31081800

010-67625853

2.6 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:上海市虹口区公平路18号10号楼嘉富大厦16层-19层

3.3 主要财务指标及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标 2015年 2014年 2013年

本期已实现收益 1,196,569,339.00 -181,280,873.72 15,102,197.67

本期利润 740,509,389.12 318,719,066.00 -66,239,971.01

加权平均基金份额本期利润 0.03030 0.00666 -0.01115

本期基金份额净值增长率 8.79% 11.37% -25.3%

3.2 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 0.05916 0.02296 0.02698

期末基金资产净值 1,373,740,040.14 3,228,403,224.37 3,616,806,228.00

期末基金份额总额 0.842 0.074 0.069

期末基金资产净值增长率 -3.00% 30.76% -33.76% 0.59%

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.所列财务指标未包括持有人认购或申购本基金的各项费用,扣认费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 基金净值表现

份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2004年6月18日至2015年12月31日)

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

4.1 基金管理人及其管理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金情况

全国性基金管理公司之一,公司注册资本为1亿元人民币,公司注册地为上海,并在北京和深圳设有分公司。

截至2015年12月31日,基金管理人共管理的基金资产总额为1,631,162,304.89元。

4.2 基金管理人对基金的管理

4.2.1 基金管理人对基金的管理

4.2.2 基金管理人对基金的托管

4.2.3 基金管理人对基金的销售

4.2.4 基金管理人对基金的估值

4.2.5 基金管理人对基金的份额分级

4.2.6 基金管理人对基金的定期报告

4.2.7 基金管理人对基金的临时报告

4.2.8 基金管理人对基金的年度报告

4.2.9 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.10 基金管理人对基金的季度报告

4.2.11 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.12 基金管理人对基金的年度报告

4.2.13 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.14 基金管理人对基金的年度报告

4.2.15 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.16 基金管理人对基金的年度报告

4.2.17 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.18 基金管理人对基金的年度报告

4.2.19 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.20 基金管理人对基金的年度报告

4.2.21 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.22 基金管理人对基金的年度报告

4.2.23 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.24 基金管理人对基金的年度报告

4.2.25 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.26 基金管理人对基金的年度报告

4.2.27 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.28 基金管理人对基金的年度报告

4.2.29 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.30 基金管理人对基金的年度报告

4.2.31 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.32 基金管理人对基金的年度报告

4.2.33 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.34 基金管理人对基金的年度报告

4.2.35 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.36 基金管理人对基金的年度报告

4.2.37 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.38 基金管理人对基金的年度报告

4.2.39 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.40 基金管理人对基金的年度报告

4.2.41 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.42 基金管理人对基金的年度报告

4.2.43 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.44 基金管理人对基金的年度报告

4.2.45 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.46 基金管理人对基金的年度报告

4.2.47 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.48 基金管理人对基金的年度报告

4.2.49 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.50 基金管理人对基金的年度报告

4.2.51 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.52 基金管理人对基金的年度报告

4.2.53 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.54 基金管理人对基金的年度报告

4.2.55 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.56 基金管理人对基金的年度报告

4.2.57 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.58 基金管理人对基金的年度报告

4.2.59 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.60 基金管理人对基金的年度报告

4.2.61 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.62 基金管理人对基金的年度报告

4.2.63 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.64 基金管理人对基金的年度报告

4.2.65 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.66 基金管理人对基金的年度报告

4.2.67 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.68 基金管理人对基金的年度报告

4.2.69 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.70 基金管理人对基金的年度报告

4.2.71 基金管理人对基金的半年度报告

4.2.72 基金管理人对基金的年度报告

4.2.73 基金管理人对基金的半年度报告