国泰金泰平衡混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。投资有风险,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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料经审计,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 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰金泰平衡混合
基金主代码	519020
交易代码	519020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月24日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,314,071,201.30份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	国泰金泰平衡混合A / 国泰金泰平衡混合C
下属分级基金的交易代码	519020 / 519022
报告期末下属分级基金的份额总额	167,115,324.45份 / 1,146,955,876.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,追求相对稳定的回报。
投资策略	(一)大类资产配置 本基金的资产配置分为二个层次,首先应用投资时钟,分析当前所处的经济周期,以确定大类资产的配置比例;其次是在确定大类资产的配置比例后,应用Melva资产评估系统进行日常的动态股票资产配置。 (二)股票投资策略 本基金个股选择主要是从两个角度考虑,一个角度是选择盈利能力强、确定性高、估值安全的上市公司;另一个角度是根据事件驱动策略选择受益于事件因素或市场估值未能充分体现事件影响的上市公司。 (三)债券投资策略 本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握,基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪,灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略、可转债策略、回购交易套利策略等多种投资策略,构建债券资产组合,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,动态的对债券投资组合进行调整。 (四)股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。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。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,混合型基金的风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、相对较高预期收益的品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	巴立康	洪渊
	联系电话	021-31081600转	010-66105799
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		(021)31089000,400-888-9688	95588
传真		021-31081800	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

§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期间数据和指标	2015年		2014年		2013年	
	国泰金泰平衡混合A	国泰金泰平衡混合C	国泰金泰平衡混合A	国泰金泰平衡混合C	国泰金泰平衡混合A	国泰金泰平衡混合C
本期已实现收益	145,092,146.45	1,005,104.06	7,123,506.75	-	7,930,463.32	-
本期利润	149,078,418.07	9,914,169.22	21,482,926.94	-	-5,007,607.34	-
加权平均基金份额本期利润	0.0836	0.0072	0.0632	-	-0.0054	-
本期基金份额净值增长率	10.09%	0.70%	7.43%	-	-2.94%	-
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	国泰金泰平衡混合A	国泰金泰平衡混合C	国泰金泰平衡混合A	国泰金泰平衡混合C	国泰金泰平衡混合A	国泰金泰平衡混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0073	0.0944	-0.0472	-	-0.1170	-
期末基金资产净值	191,590,820.10	1,315,111,668.88	272,739,890.62	-	425,521,387.69	-
期末基金份额净值	1.146	1.147	1.041	-	0.969	-

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、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)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

1. 国泰金泰平衡混合A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.43%	0.37%	1.21%	0.02%	4.22%	0.35%
过去六个月	4.37%	0.38%	2.51%	0.01%	1.86%	0.37%
过去一年	10.09%	0.29%	5.37%	0.02%	4.72%	0.27%
过去三年	25.25%	0.47%	17.84%	0.02%	7.41%	0.45%
自基金合同生效起至今	25.25%	0.46%	17.98%	0.02%	7.27%	0.44%

2. 国泰金泰平衡混合C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自新增C类份额以来	0.70%	0.05%	0.57%	0.01%	0.13%	0.04%

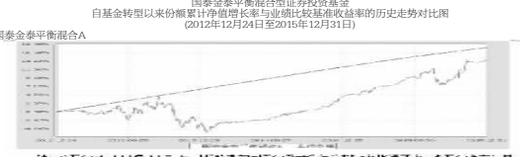
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

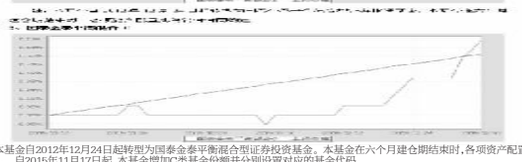
国泰金泰平衡混合型证券投资基金

自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年12月24日至2015年12月31日)

1.国泰金泰平衡混合A





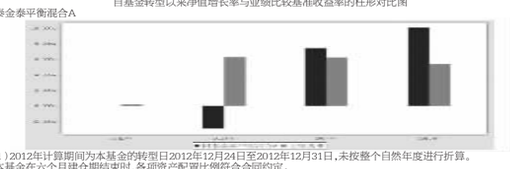
注:本基金自2012年12月24日起转型为国泰金泰平衡混合型证券投资基金,本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。自2015年11月17日起,本基金增加C类基金份额并分别设置对应的基金代码。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰金泰平衡混合型证券投资基金

自基金转型以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

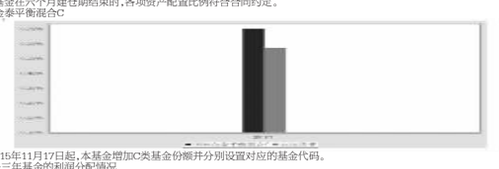
1.国泰金泰平衡混合A



注:(1)2012年计算期间为本基金的转型日2012年12月24日至2012年12月31日,未按整个自然年度进行折算。

(2)本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

2.国泰金泰平衡混合C



注:自2015年11月17日起,本基金增加C类基金份额并分别设置对应的基金代码。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1.国泰金泰平衡混合A:

本基金过去三年未进行利润分配。

2.国泰金泰平衡混合C:

本基金自2015年11月17日增加C类基金份额以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日,是经中国证监会证监基字[1998]5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币,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,本基金管理人共管理58只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金(包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鼎保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鑫价值精选混合型证券投资基金(由金鼎证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金、国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(由金盛证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰信经典混合型证券投资基金(LOF)、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期满端转换而来)、上证50交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰海金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰期限收动灵活配置混合型证券投资基金、国泰成益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金(由国泰6个月短期债券型证券投资基金转型而来)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰价益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金(中中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来)、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保保本混合型证券投资基金。另外,本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金投资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格,2008年2月14日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
奥利安	本基金的基金经理(原国泰金泰封闭)、国泰信益灵活配置混合型(LOF)、国泰商政灵活配置混合、国泰纳利特型灵活配置混合、国泰国策动能混合、国泰兴益灵活配置混合、国泰生益灵活配置混合、国泰睿吉灵活配置混合的基金经理、研究部副总监	2015-06-30	-	10年	硕士,曾任职上海鑫地投资管理有限公司,天治基金管理有限公司等。2010年7月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年10月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原国泰海新灵活配置混合型证券投资基金)、和国泰政益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年1月起需任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年3月起需任国泰纳国策动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年5月起需任国泰纳国策动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年5月起需任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金(原金泰证券投资基金)的基金经理,2015年5月起任研究部副总监。
程洲	本基金的基金经理(原国泰金泰封闭)、国泰聚信价值优势、国泰金牛创新混合(原国泰金牛创新灵活)的基金经理	2012-12-24	-	16年	硕士研究生,CFA,曾任职于中银万国证券研究所。2004年4月加盟国泰基金管理有限公司,历任高级策略分析师、基金经理助理;2008年4月至2014年3月任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理,2008年12月至2012年12月兼任金鑫证券投资基金的基金经理,2010年2月至2011年12月兼任国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的基金经理,2012年12月起兼任国泰金泰平衡混合型证券投资基金(原国泰金牛创新成长股票型证券投资基金)的基金经理,2015年1月起需任国泰金牛创新成长混合型证券投资基金(原国泰金牛创新灵活股票型证券投资基金)的基金经理。2012年2月至2014年3月任基金管理部总监助理。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日,首任基金经理,任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人在报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定,严格遵守基金合同和招募说明书约定,本着诚实信用、勤勉尽责,最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,未发生损害基金份额持有人利益的行为,未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为,信息披露及时、准确、完整,本基金与本基金管理人所管理的其他基金产、投资组合与公司资产之间严格分开,公平对待,基金管理小组保持独立运作,并通过科学决策、规范运作、精心管理和建立内控体系,有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求,制定了《公平交易管理制度》,制度规范了公司各部门相关岗位职责,适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,包括投资、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,旨在规范交易行为,严禁利益输送,保证公平交易,保护投资者合法权益。

(一)公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程,提高投资决策的科学性和客观性,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境。

(二)公司制定投资授权机制,明确各投资决策主体的职责和权限划分,合理确定各投资组合经理的投资权限,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

(三)公司对各投资组合信息进行有效的保密管理,不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

(四)公司实行集中交易制度,严格隔离投资管理职能与交易执行职能,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

(五)公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

(六)公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析,并评估是否存在公平交易原则。

(七)公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度,对交易过程进行定期检查,并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制,确保公平对待所管理的所有基金和投资组合,切实防范利益输送行为。

(一)本基金管理人所管理的基金组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见,我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析,我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下,且大部分溢价率均值通过95%置信度下等于0的检验。

(二)扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取T=-3和T=+5作为扩展时间窗口,将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均,并以此为依据,进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对(样本数≥30),溢价率均值大部分在1%数量级及以下。

(三)基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的检验的基金组合配对,对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对,已要求基金经理对价差作出了解释,根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年的中国证券市场经历了史上最为跌宕起伏的一年。上半年,在货币持续宽松、市场利率下行以及改革预期的推动下,以创业板为首的中小盘股票带领市场大幅上涨,创业板指数最大涨幅高达177%,市场进入疯狂状态。随着6月份开始清查违规用融,泡沫被刺破,市场大幅下挫,创业板在6-7月最大跌幅达到40%。8月份汇改之后,创业板再度下跌30%,四季度进入反弹。

全年来看,上证指数最终上涨9.4%,深证综指上涨63.2%,创业板全年涨幅达到106.6%,分化明显。从行业表现来看,表现最好的是计算机、传媒、通信等新兴成长行业股票以及轻工、纺织服装等转型力度较大的传统行业,其中计算机行业全年涨幅达到100%。全年仅有非银金融、银行、采掘三个行业下跌,其中非银金融下跌16.9%。

本基金以绝对收益为目标,以新股申购策略为主,在2015年取得了不错的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金泰平衡混合A在2015年度净值增长率为10.09%,同期业绩比较基准为5.37%。

国泰金泰平衡混合C在2015年度净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准为0.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观层面来看,2016年经济下行趋势不变,汇率继续承压,受制于汇率影响,利率下行空间不大,但存款准备金率仍有下调空间。以制造业为代表的实体经济投资收益率持续下滑,企业投资意愿不强,银行保险等金融机构在资产端收益率下行。政府提出供给侧改革的思路,加大煤炭钢铁等过剩产能出清力度,加快房地产库存消化。

2016年伊始市场再度下跌,一周之内就经历了两次熔断,下跌的主要诱因是人民币再次贬值,加大了市场的贬值预期。其本质是人民币贬值压力限制了货币进一步宽松空间。我们认为2016年市场资金面基本平衡,仍然是存量博弈,由于2015年股分股票激幅过大,2016年可能呈宽幅振荡的态势。供给侧改革短期无法完成产能出清,对于周期股可能带来仅仅是脉冲式行情;创业板等中小票在2016年是估值消化的一年,我们更看好低估值、高分红的蓝筹股,以及部分有隐藏资产和具有兼并价值的个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策,执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责,成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干,均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或者有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末,根据本基金合同和相关法律法规的规定,本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对国泰金泰平衡混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,国泰金泰平衡混合型证券投资基金的管理人——国泰基金管理有限公司在国泰金泰平衡混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金分红额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,国泰金泰平衡混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国泰基金管理有限公司编制和披露的国泰金泰平衡混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 许康玮 胡逸嵘签字出具了普华永道中天审字(2016)第20784号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国泰金泰平衡混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	345,350,072.33	11,161,375.78
结算备付金	5,893,066.54	9,587,814.49
存出保证金	144,186.16	185,827.23
交易性金融资产	551,964,266.67	194,274,244.00
其中:股票投资	43,605,558.47	1,546,344.00
基金投资	-	-
债券投资	508,358,698.20	192,727,900.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	600,051,900.08	52,000,000.00
应收证券清算款	3,105,978.19	-
应收利息	3,332,244.70	4,383,315.16
应收股利	-	-
应收申购款	110,334.43	10,000,982.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,509,952,039.10	281,593,558.84
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	7,000,000.00
应付赎回款	134,994.51	1,127,881.60
应付管理人报酬	2,303,735.97	340,533.50
应付托管费	383,956.00	56,755.61
应付销售服务费	137,408.41	-
应付交易费用	129,387.67	233,789.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,067.56	94,708.14
负债合计	3,249,550.12	8,853,668.22
所有者权益:	-	-
实收基金	1,328,591,070.51	284,354,673.48
未分配利润	178,111,418.47	-11,614,782.86
所有者权益合计	1,506,702,488.98	272,739,890.62
负债和所有者权益总计	1,509,952,039.10	281,593,558.84

注:报告截止日2015年12月31日,基金A类份额净值1.146元,基金C类份额净值1.147元,国泰金泰平衡混合基金基金份额总额1,314,071,201.30份,其国泰金泰平衡混合基金A类份额167,115,324.45份,国泰金泰平衡混合基金C类份额1,146,955,876.85份。

7.2 利润表

会计主体:国泰金泰平衡混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	197,382,182.11	29,921,615.44
1.利息收入	25,135,717.83	13,477,262.35
其中:存款利息收入	10,103,075.27	251,342.42
债券利息收入	8,156,067.68	11,224,621.75
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,876,574.88	2,001,298.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	150,184,911.71	1,968,488.40
其中:股票投资收益	146,718,467.19	-232,901.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,817,939.32	2,246,340.45
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-329,280.00
股利收益	648,505.20	284,329.72
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	12,895,336.78	14,359,420.19
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	9,166,215.79	116,444.50
减:二、费用	38,389,594.82	8,438,688.50
1. 管理人报酬	31,065,478.91	5,031,411.35
2. 托管费	5,177,579.85	838,568.63
3. 销售服务费	191,884.62	-
4. 交易费用	1,298,902.40	2,228,939.44
5. 利息支出	340,642.14	1,243.69
其中:卖出回购金融资产支出	340,642.14	1,243.69
6. 其他费用	315,106.90	338,525.39
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	158,992,587.29	21,482,926.94
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	158,992,587.29	21,482,926.94

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国泰金泰平衡混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	284,354,673.48	-11,614,782.86	272,739,890.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	158,992,587.29	158,992,587.29
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)	1,044,236,397.03	30,733,614.04	1,074,970,011.07
其中:1.基金申购款	8,419,382,687.46	126,726,135.06	8,546,108,822.52
2.基金赎回款	-7,375,146,290.43	-95,992,521.02	-7,471,138,811.45
四、本期向基金分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)	1,328,591,070.51	178,111,418.47	1,506,702,488.98

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	476,911,759.38	-51,390,371.69	425,521,387.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,482,926.94	21,482,926.94
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)	-192,557,085.90	18,292,661.89	-174,264,424.01
其中:1.基金申购款	19,570,404.33	-1,027,561.49	18,542,842.84
2.基金赎回款	-212,127,490.23	19,320,223.38	-192,807,266.85
四、本期向基金分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)	284,354,673.48	-11,614,782.86	272,739,890.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从71至74,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:倪鑾

7.4 报表附注

7.4.1 基金本体报告

国泰金泰平衡混合型证券投资基金是根据原金泰证券投资基金(以下简称“基金金泰”)基金份额持有人大会2012年11月1日决议通过的《关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案》,经中国证监会证券监督管理委员会以下简称“中国证监会”)证监许可字[2012]1549号《关于核准金泰证券投资基金分额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准,由原基金金泰转型而来。原基金金泰存续期限至2012年12月23日止。自2012年12月24日起,原基金金泰更名为国泰金泰平衡混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《金泰证券投资基金合同》失效的同时《国泰金泰平衡混合型证券投资基金合同》生效,本基金存续期限不定。原基金金泰于基金合同失效前经审计的基金资产净值为1,830,412,540.58元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据基金金泰份额持有人大会总结安排,本基金自2013年1月4日起至2013年1月25日止开放集中申购。集中申购共募集不包括认购资金利息人民币107,067,336.80元,折合基金份额107,067,336.80份,认购资金产生的利息人民币27,915.30元,折合基金份额27,915.30份,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第012号验资报告予以验证。国泰基金管理有限公司以2013年1月30日为折分基准日,对本基金进行了份额拆分。拆分基准日拆分前基金份额净值为0.9117元,精确到小数点后9位为0.916509833元。国泰基金管理有限公司按照1:0.916509833的比例拆分,拆分后当日基金份额净值调整为1.000元。拆分后基金份额计算结果保留至整数位,所产生的误差归入基金资产。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《国泰金泰平衡混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改合同的公告》,自2015年11月17日起,本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,在收益分配额方面可能有所不同。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金泰平衡混合型证券投资基金基金合同基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、银行存款(包括银行活期存款、银行定期存款、协议存款、大额存单等)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为30%-50%;债券、银行存款等固定收益类资产,货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为50%-100%;其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率+2%。

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。

7.4.2 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》、《国泰金泰平衡混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期的年度报告相一致,会计估计较最近一期年度报告有变更。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告