国泰民安增利债券型发起式证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 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。

1.2 基金托管人中国农业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。

1.3 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。

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 本报告期自2016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	国泰民安增利债券	
基金主代码	020033	
交易代码	020033	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月26日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,681,950.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类
下属分级基金的交易代码	020033	020034
报告期末下属分级基金的份额总额	22,827,217.41份	22,854,733.51份

2.2 基金产品简介

投资目标	在适度承担风险并保持资产流动性的基础上,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求基金资产的长期稳定增值,通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置,以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化投资组合。 2.固定收益品种投资策略 本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括:久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。 3.股票投资策略 本基金适当投资于股票市场,以强化组合获利能力,提高预期收益水平。本基金股票投资以价值选股、组合投资为原则,通过选择高流动性股票,保证组合 的高流动性;通过选择具有高安全边际的股票,保证组合的收益性;通过分散投资、组合投资,降低个股风险与集中性风险。 本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法,选取主业清晰,具有持续的核心竞争力,管理透明度较高,流动性好且估值具有高安全边际的个股构建股票 组合。 4.权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,尽力减少组合净值波动率,力求稳健的超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	巴立康	林蓉
	联系电话	021-31081600转	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		(021)31089000,400-888-8688	95599
传真		021-31081800	010-63201816

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	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	
	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类
本期已实现收益	2,863,950.73	1,537,038.11	3,320,765.05	2,207,082.94	3,289,880.28	6,684,268.88
本期利润	3,320,775.37	1,469,757.50	4,771,072.65	3,610,096.64	2,249,207.25	6,051,495.04
加权平均基金份额本期利润	0.1470	0.0848	0.2221	0.1921	0.0269	0.0329
本期基金份额净值增长率	13.59%	13.54%	21.52%	20.93%	-0.20%	-0.70%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类	国泰民安增利债券A类	国泰民安增利债券C类
期末可供分配基金份额利润	0.1562	0.1530	0.1752	0.1641	-0.0009	-0.0063
期末基金资产净值	27,839,279.77	27,782,857.62	38,555,123.73	13,434,902.29	26,815,666.22	17,134,995.81
期末基金份额净值	1.220	1.216	1.214	1.202	0.999	0.994

注:(1)本期已实现收益指本基金本期利息收入、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. 国泰民安增利债券A类:

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	4.01%	0.19%	0.52%	0.01%	3.49%	0.18%
过去六个月	4.27%	0.19%	1.13%	0.01%	3.14%	0.18%
过去一年	13.59%	0.29%	2.62%	0.01%	10.97%	0.28%
过去三年	37.76%	0.22%	9.59%	0.01%	28.17%	0.21%
自基金合同生效起至今	37.90%	0.22%	9.65%	0.01%	28.25%	0.21%

2. 国泰民安增利债券C类:

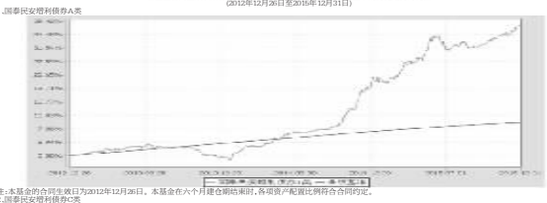
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.20%	0.20%	0.52%	0.01%	3.68%	0.19%
过去六个月	4.38%	0.20%	1.13%	0.01%	3.25%	0.19%
过去一年	13.54%	0.29%	2.62%	0.01%	10.92%	0.28%
过去三年	36.34%	0.22%	9.59%	0.01%	26.75%	0.21%
自基金合同生效起至今	36.48%	0.22%	9.65%	0.01%	26.83%	0.21%

本基金的合同生效日为2012年12月26日。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。

3.2.2 自基金合同生效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

国泰民安增利债券型发起式证券投资基金
自基金合同生效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26日至2015年12月31日)

1.国泰民安增利债券A类



注:本基金的合同生效日为2012年12月26日。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。

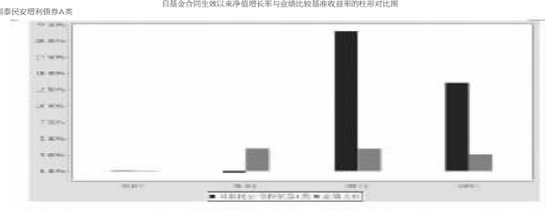
2.国泰民安增利债券C类

注:本基金的合同生效日为2012年12月26日。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

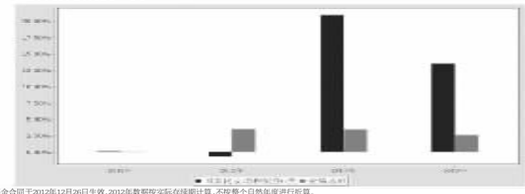
国泰民安增利债券型发起式证券投资基
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1.国泰民安增利债券A类



注:[illegible]

2.国泰民安增利债券C类



注:本基金合同于2012年12月26日生效,2012年数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1.国泰民安增利债券A类:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
2015年	1.410	3,020,709.90	483,191.08	3,503,900.98	-
合计	1.410	3,020,709.90	483,191.08	3,503,900.98	-

2.国泰民安增利债券C类:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
2015年	1.320	1,272,980.45	153,505.52	1,426,485.97	-
合计	1.320	1,272,980.45	153,505.52	1,426,485.97	-

§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481开放式证券投资基金:国泰金鹰增长证券投资基金(包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙精选平衡证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金鑫证券投资基金、国泰金鼎富债券证券投资基金、国泰金鹿债券证券投资基金、国泰金牛债券证券投资基金、国泰金狮债券证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金的轮转基金)、国泰金龙行业精选证券投资基金(由金鹰证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长混合证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金的轮转基金)、国泰金鹿债券证券投资基金、国泰中小盘成长混合证券投资基金、国泰中小盘成长混合证券投资基金(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、国泰价值经典混合证券投资基金(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、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰海力互联网债券型证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金牛定期开放证券投资基金、国泰国证房地产开发指数型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰海力互联网债券型证券投资基金、国泰金鹿债券证券投资基金、国泰金牛债券证券投资基金、国泰国证证券公司行业指数分级证券投资基金(LOF)、国泰国策动证券投资基金(LOF)、国泰国策动证券投资基金、国泰金鼎证券投资基金、国泰金鑫证券投资基金、国泰证券投资基金、国泰证券投资基金、国泰