

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

2017年年度报告摘要

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年三月二十七日

§ 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同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同约定，于2018年3月26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。

本年度报告摘要能提供年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料未经审计，普信通道中大会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，敬请投资者注意阅读。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日。

§ 2 基金简介

2.1 基金的基本情况

基金名称	国泰金鹿保本混合
基金代码	0201018
交易代码	0201018
基金合同生效日	2006年12月12日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	1,619,073,142.46元
基金合同的存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证基金安全的前提下，力争在本基金保本期结束时，实现基金财产的增值。
基金采用比例化策略	CPPI, Constant Proportion Portfolio Protection
投资策略	技术上坚持“保本+定期存款+股票”的三类资产配置策略，通过定期存款保本，通过股票投资获取收益，通过定期存款和股票投资获取收益。
业绩比较基准	本基金以定期存款利率为基准收益，投资于股票的收益为基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于投资货币基金中的低风险品种。

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	中国银行股份有限公司
姓名	李华梅	王永平
信息披露义务人	021-50694896	010-66954896
联系电话	xmtf@gtfund.com	tecbank@china.com
客户服务电话	021-21080000	400-888-0999
传真	021-31018100	010-66954942

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: 上海市徐汇区漕河泾高科路18号号楼底层16层-19层及基金托管人住所。

§ 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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	1,737,030.09	18,248,733.64	120,156,398.28
本期平均基金份额本期利润	0.448,992.10	-26,854,658.41	160,406,449.07
加权平均基金份额本期利润	0.0031	-0.0264	0.0177
本期基金份额净值增长率为	0.20%	-7.26%	27.00%
3.1.2 期末未分配利润	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供基金份额利润	0.1024	0.1028	0.1606
期末基金份额净值	1,519,456,567.41	1,937,790,700,422.32	332,048,079.23
期末可供分配基金份额净值	1.0001	0.998	1.003

注: (1) 本期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，本期利润为期末公允价值变动收益;

(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，计算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

阶段

份额的申购赎回费用

申购费用

赎回费用

业绩比较基准

同期业绩比较基准

3.2.2 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

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的走势图

(2006年12月12日至2017年12月31日)

3.3 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

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1996年3月5日，是经中国证监会证监基字[1996]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1.11亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

4.1.2 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.3 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.4 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.5 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.6 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.7 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.8 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.9 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.10 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.11 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.12 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.13 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.14 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.15 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.16 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.17 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.18 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.19 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.20 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.21 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.22 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.23 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.24 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.25 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.26 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.27 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.28 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.29 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.30 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.31 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.32 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.33 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.34 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.35 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.36 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.37 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.38 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.39 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.40 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.41 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.42 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.43 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.44 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.45 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.46 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.47 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.48 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.49 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.50 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.51 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.52 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.53 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.54 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.55 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.56 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.57 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.58 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.59 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.60 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.61 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.62 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.63 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.64 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.65 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.66 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.67 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.68 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.69 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.70 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.71 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.72 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.73 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.74 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.75 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.76 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.77 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.78 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.79 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.80 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.81 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.82 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.83 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.84 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.85 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.86 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.87 基金管理人对本基金的管理情况

4.1.