国泰事件驱动策略混合型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
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签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年3月23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2017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	国泰事件驱动混合
基金主代码	020023
交易代码	020023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月17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
报告期末基金份额总额	59,238,927.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会,在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资,力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件,在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上,将事件性因素作为投资的主线,并将事件驱动投资策略贯彻到本基金的投资管理中。 具体而言,本基金的投资策略分三个层次:首先是大类资产配置,即采用基金管理人的资产配置评估模型(Melva),依据对宏观经济、企业盈利、流动性、估值等相关因素的分析判断确定不同资产类别的配置比例;其次是行业配置,即从估值水平和发展前景两个角度出发,注重事件性因素对行业影响的分析,采取定性和定量分析相结合的方法,对行业进行优化配置和动态调整;最后,在大类资产配置和行业配置的基础上,通过对影响上市公司当前及未来价值的事件性因素进行全面的分析,深入挖掘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股票,在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下,完成本基金投资组合的构建,并依据事件影响的深入对其进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永梅	田青
	联系电话	021-31081600转	010-67595096
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000,400-888-8688	010-67595096
传真		021-31081800	010-66275853

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	28,768,980.36	-3,805,817.61	50,546,228.40
本期利润	38,015,291.44	-4,493,141.65	34,653,653.46
加权平均基金份额本期利润	0.6999	-0.1024	0.6446
本期基金份额净值增长率	33.71%	-5.00%	24.12%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	1.7447	1.0527	1.1607
期末基金资产净值	162,593,607.18	88,629,179.09	92,720,921.81
期末基金份额净值	2.745	2.053	2.161

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

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	8.24%	1.42%	3.97%	0.64%	4.27%	0.78%
过去六个月	16.12%	1.24%	7.96%	0.56%	8.16%	0.68%
过去一年	33.71%	1.08%	17.23%	0.51%	16.48%	0.57%
过去三年	57.67%	2.04%	15.30%	1.35%	42.37%	0.69%
过去五年	156.06%	1.81%	54.70%	1.24%	101.36%	0.57%
自基金合同生效起至今	174.50%	1.68%	41.27%	1.20%	133.23%	0.48%

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

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

注:本基金合同生效日为2011年8月17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 过去五年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

国泰事件驱动策略混合型证券投资基金
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
(2011年8月17日至2017年12月31日)

注:本基金合同生效日为2011年8月17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。

3.3 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 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6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2017年12月31日,本基金管理人共管理105只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金,国泰金龙系列证券投资基金(包括25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,国泰金鑫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,国泰金鼎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(由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,国泰价值经典灵活配置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联接基金,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,国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金(由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来,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,国泰信息优势混合型证券投资基金(LOF)(由国泰信息优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来),上证5年期国债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,国泰淘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),国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金,国泰收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,国泰安享混合型证券投资基金,国泰纯债债券证券投资基金,国泰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,国泰大众股票型证券投资基金,国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金,国泰利率债券证券投资基金,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,国泰金龙债券证券投资基金,国泰融丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金,国泰融利灵活配置混合型证券投资基金,国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金,国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金,国泰国证航天军工指数证券投资基金,国泰中证申万证券行业指数证券投资基金,国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金,国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF),国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金转型而来),国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金,国泰睿信平衡混合型证券投资基金,国泰大农业股票型证券投资基金,国泰智能装备股票型证券投资基金,国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金,国泰润鑫纯债债券型证券投资基金,国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金,国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金,国泰智能汽车股票型证券投资基金,上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金,国泰瞬利交易型货币市场基金,国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金,国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金(ODII),国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金,国泰安心回报混合型证券投资基金,国泰民润纯债债券型证券投资基金,国泰润享纯债债券型证券投资基金,国泰可转债债券型证券投资基金。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12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,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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林小聪	本基金的基金经理	2017-06-19	-	8年	硕士研究生。2010年4月加入国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。2017年6月起任国泰事件驱动策略混合型证券投资基金的基金经理。
邱晓华	本基金的基金经理	2016-04-26	2017-08-11	17年	硕士研究生。曾任职于新华通讯社、北京首都国际投资管理有限公司、银河证券。2007年4月加入国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理。2011年4月至2014年6月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理;2011年6月至2016年6月任国泰金鼎保本增值混合证券投资基金的基金经理;2013年8月至2015年1月兼任国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理;2014年5月至2017年8月兼任国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金的基金经理;2014年11月至2015年12月兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理;2015年1月至2017年8月兼任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)的基金经理;2015年4月至2017年5月兼任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理;2015年4月至2016年6月兼任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理;2015年12月至2017年8月兼任国泰新目标收益保本混合型证券投资基金和国泰鑫保本混合型证券投资基金的基金经理;2016年4月至2017年8月兼任国泰事件驱动策略混合型证券投资基金的基金经理;2016年7月至2017年8月兼任国泰民利保本混合型证券投资基金的基金经理;2017年5月至2017年8月兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰睿信平衡混合型证券投资基金的基金经理。

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 管理人对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取最大利益。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资产、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、精心管理和健全内控体系,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的规定,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,建立公平交易的制度环境。

公司采用投资授权机制,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,超过授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,并评估是否符合公平交易原则。

(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或组合间同向交易价差分析

根据证监会关于交易指导意见,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t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率分析

对于不能通过溢价率均值为零的t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

2017年全年来看,政治性维稳表,悲观金融去杠杆不断深入,投资者的风险偏好降低,市场整体估值下移。投资者对于业绩确定性的要求提高,白马蓝筹股产生了一定估值溢价,结构性行情比较明显。

我们的投资思路基于行业景气度、公司竞争优势及业绩成长。全年来看,配置相对比较均衡,以稳健可持续成长的品牌消费、金融、先进制造为主,阶段性配置了新能源、周期股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金在2017年的净值增长率为33.71%,同期业绩比较基准为17.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然政策经济数据时有波动,但我们判断经济本身的韧性比市场预期要强。展望中长期,我们认为在经济增速中枢降低的同时,企业盈利或将逐步改善,尤其是龙头企业的盈利。2018年,我们初步判断流动性不会对股票市场形成太大的约束,经济复苏和企业盈利改善可能是市场主线。我们对2018年的股票市场偏乐观,重点关注的行业包括品牌消费品、大金融等。

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的公司领导负责,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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第22567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:国泰事件驱动策略混合型证券投资基金
报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:	-	-
银行存款	10,146,658.61	22,014,834.71
结算备付金	1,105,159.58	-
存出保证金	110,465.36	23,079.61
交易性金融资产	152,588,066.83	66,050,264.59
其中:股票投资	152,588,066.83	66,008,275.51
基金投资	-	-
债券投资	-	41,989.08
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	-	-
应收证券清算款	1,083,497.43	736,197.63
应收利息	3,046.55	4,873.47
应收股利	-	-
应收申购款	141,140.62	101,608.13
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	165,178,034.98	88,930,858.14

负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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	1,613,830.10	-
应付赎回款	198,506.81	90,027.98
应付管理人报酬	202,890.32	114,440.29
应付托管费	33,815.05	19,073.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	434,750.52	17,987.94
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	100,636.00	60,149.46
负债合计	2,584,427.80	301,679.05
所有者权益:	-	-
实收基金	59,238,927.12	43,177,887.42
未分配利润	103,354,680.06	45,451,291.67
所有者权益合计	162,593,607.18	88,629,179.09
负债和所有者权益总计	165,178,034.98	88,930,858.14

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值2.745元,基金份额总额59,238,927.12份。

7.2 利润表

会计主体:国泰事件驱动策略混合型证券投资基金
本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	43,021,499.17	-2,061,046.12
1.利息收入	125,268.70	124,143.50
其中:存款利息收入	125,156.45	124,031.24
债券利息收入	112.25	112.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	33,599,306.97	-1,526,331.92
其中:股票投资收益	32,731,564.80	-1,889,285.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,653.35	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	858,088.82	362,953.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9,246,311.08	-687,324.04
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	50,612.42	28,466.34
减:二、费用	5,006,207.73	2,432,095.53
1. 管理人报酬	1,946,723.35	1,260,844.08
2. 托管费	324,453.87	210,140.60
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,351,940.04	580,850.69
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	383,090.47	380,260.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	38,015,291.44	-4,493,141.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	38,015,291.44	-4,493,141.65

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国泰事件驱动策略混合型证券投资基金
本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	43,177,887.42	45,451,291.67	88,629,179.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,015,291.44	38,015,291.44
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)	16,061,039.70	19,888,096.96	35,949,136.65
其中:1.基金申购款	35,841,227.66	49,368,379.68	85,209,607.34
2.基金赎回款	-19,780,187.96	-29,480,282.73	-49,260,470.69
四、本期向基金份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)	59,238,927.12	103,354,680.06	162,593,607.18

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	42,913,134.16	49,807,787.65	92,720,921.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,493,141.65	-4,493,141.65
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)	264,753.26	136,645.67	401,398.93
其中:1.基金申购款	15,890,119.20	15,852,316.17	31,742,435.37
2.基金赎回款	-15,625,365.94	-15,715,670.50	-31,341,036.44
四、本期向基金份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)	43,177,887.42	45,451,291.67	88,629,179.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:周向勇,主管会计工作负责人:周向勇,会计机构负责人:倪蓥

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰事件驱动策略混合型证券投资基金(原名为国泰事件驱动策略股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会以以下简称"中国证监会"证监许可[2011]1885号《关于核准国泰事件驱动策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰事件驱动策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,730,961,151.44元,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(2011)第318号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰事件驱动策略股票型证券投资基金基金合同》于2011年8月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,731,122,191.51份基金份额,其中认购资金利息折合1,040.07份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰事件驱动策略股票型证券投资基金基金合同》及《关于修订国泰事件驱动策略股票型证券投资基金基金合同的公告》,国泰事件驱动策略股票型证券投资基金于2015年8月9日起更名为国泰事件驱动策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰事件驱动策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的40%,其中,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率X80%+中证综合债券指数收益率X20%。

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2018年3月23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》、《国泰事件驱动策略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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017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2017年12月31日的财务状况以及2017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 会计政策变更的说明

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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月4日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间月解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司("申万宏源")	基金销售机构、受中国证监会控制的公司
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司("中国建投")	基金管理人的控股股东
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	147,989,802.41	9.15%	20,658,160.61	5.40%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	137,822.82	9.70%	72,119.66	16.59%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	19,239.12	5.52%	134.87	0.75%

注:1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管