国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF） 2017年年度报告摘要

（原国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转型）

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
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对于拟购买本基金的招募说明书及其更新。

根据基金合同和国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）招募说明书的有关规定，本基金的封闭期自2016年5月26日起至2017年11月26日止，自2017年11月27日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资目标、投资策略、投资范围、投资比例限制、业绩比较基准和收益分配等条款，根据适用于基金合同中本基金转换为上市开放式基金（LOF）时的有关规定，详见基金合同。本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金份额约定上海证券交易所上市交易。本基金场外简称变更为“国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）”，场内简称及基金代码不变，场内简称为“国泰融丰”，基金代码为“501017”。本基金中申购、赎回日封闭期届满并转换为上市开放式基金（LOF）之日起不超过3个月预办理，具体的业务时间将另行公告。具体可查阅本基金管理人于2017年11月24日披露的《关于国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）的公告》。

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。

本报告的财务会计报告、投资组合中长期股票明细、报告期末可供出售金融资产明细、报告期末持有的衍生品明细等内容，已经会计师事务所（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。

本报告中，除国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）时间为2017年11月26日止，国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自2017年11月27日起至2017年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基本基本情况

2.1.1 国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）
基金主代码	501017
交易代码	501017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月27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
报告期末基金份额总额	909,761,190.40份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	国泰融丰定增灵活配置
基金主代码	501017
交易代码	501017
基金运作方式	基金合同生效日18个月内（含第18个月），场内份额与场外份额均不开放申购、赎回业务，但场内份额可在本基金存在法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下上市交易。本基金合同生效满18个月及对日起，本基金将与上市开放式基金（LOF）。
基金合同生效日	2016年5月26日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,116,392,677.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品简介

2.2.1 国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	
投资目标	深入挖掘并积极参与定增机会和市场机会的双重优势，在有效控制组合风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	在有效控制组合风险的前提下，深入挖掘并积极参与定增机会和市场机会的双重优势，力争实现超越业绩比较基准的收益。1、资产配置策略 本基金将根据宏观经济、证券市场估值水平、市场利率水平、市场流动性、市场情绪等因素，在大类资产间进行动态资产配置，通过调整股票、债券、现金等资产的配置比例，在基金资产间进行动态调整。2、股票投资策略 本基金将采用定增策略、行业轮动策略、个股精选策略、主题投资策略、股票期权策略、融资融券策略、股指期货策略、国债期货策略、股票期权策略、融资融券策略、股指期货策略、国债期货策略、股票期权策略、融资融券策略、股指期货策略、国债期货