国泰睿信平衡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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《国泰睿信平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议投票表决起止时间为自2018年2月26日起至2018年3月27日17:00止。会议审议事项为《关于终止国泰睿信平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。会议投票表决结束后，将由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。本基金管理人将及时对计票结果予以公告，具体可查阅本基金管理人于2018年2月24日披露的《关于以通讯方式召开国泰睿信平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。

本报告期自2017年5月26日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰睿信平衡混合
基金主代码	002203
交易代码	002203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017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	200,159,748.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超额收益。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险（CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例，以实现本基金的投资目标。 CPPI是国际通行的一种投资组合策略，它主要是通过数量分析，根据市场的波动来调整、修正风险资产的可调大倍数（风险乘数）、动态调整风险资产和无风险资产的配置比例，因风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。其中，无风险资产一般是指固定收益类资产，风险资产一般是指股票等权益类资产。 本基金将以三年内为合位控制策略的时行周期，本基金每个执行周期当期内净值收益率在15%以内时，股票等权益类资产的比例不高于基金资产的60%；当期净值收益率大于等于15%时，股票等权益类资产的比例不高于基金资产的60%。通过前述投资方法，一方面由债券类资产为权益投资的波动提供安全垫，以争取为组合实现本金安全，另一方面，根据安全垫的厚度不同，以有限的不同比例投资于权益类资产，以争取为组合创造超额收益。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×60%＋沪深300指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期风险及风险水平的投资品种。

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
信息披露负责人	姓名	李永梅	王永民
	联系电话	021-31081600转	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		（021）31089000,400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942

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5月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日
本期已实现收益	6,496,353.77
本期利润	11,466,295.47
加权平均基金份额本期利润	0.0549
本期基金份额净值增长率	5.40%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末
期末可供分配基金份额利润	0.0239
期末基金资产净值	210,925,569.28
期末基金份额净值	1.054

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）本基金合同生效日为2017年5月26日，截止至2017年12月31日不满一年。

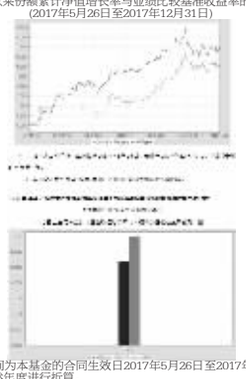
3.2 基金净值表现

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	3.13%	0.27%	1.76%	0.33%	1.37%	-0.06%
过去六个月	3.84%	0.22%	4.04%	0.28%	-0.20%	-0.06%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.22%	6.93%	0.28%	-1.53%	-0.06%

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

国泰睿信平衡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
(2017年5月26日至2017年12月31日)



注:2017年计算期间为本基金的合同生效日2017年5月26日至2017年12月31日，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

本基金成立至今尚未进行利润分配。

§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1.4亿元人民币，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、国泰金鹿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型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、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、国泰季付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、国泰欣益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、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（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、国泰兴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、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰路益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利益灵活配置混合型证券投资基金、国泰宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、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（LOF）、国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）、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变更而来）、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联接基金、国泰利享纯债债券型证券投资基金、国泰安享混合型证券投资基金、国泰瑞安混合型证券投资基金、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、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰利享纯债债券型证券投资基金、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金、国泰瑞利纯债债券型证券投资基金、国泰瑞祥纯债债券型证券投资基金、国泰瑞欣纯债债券型证券投资基金、国泰瑞盈纯债债券型证券投资基金、国泰瑞兴纯债债券型证券投资基金、国泰瑞益纯债债券型证券投资基金、国泰瑞裕纯债债券型证券投资基金、国泰瑞禄纯债债券型证券投资基金、国泰瑞康纯债债券型证券投资基金、国泰瑞福纯债债券型证券投资基金、国泰瑞享纯债债券型证券投资基金、国泰瑞顺纯债债券型证券投资基金、国泰瑞通纯债债券型证券投资基金、国泰瑞达纯债债券型证券投资基金、国泰瑞盛纯债债券型证券投资基金、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金、国泰瑞安