

**国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金**  
**2016 年第 1 季度报告**  
**2016 年 3 月 31 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

报告送出日期：二〇一六年四月二十二日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                               |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰国策驱动灵活配置混合                                                                                                                                  |
| 基金主代码      | 000511                                                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2014 年 2 月 17 日                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 763,883,546.43 份                                                                                                                              |
| 投资目标       | 通过深入研究，积极投资于符合国家政策导向、经济发展方向且增长前景确定的优质企业，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                            |
| 投资策略       | 长期看来，我国经济转型是一个多层次、长周期的过程，主要由经济结构调整、产业结构升级和区域结构优化组成，其发展与国家政策导向紧密相关。国家政策将有力推动相关经济领域的发展，受益于国家政策的行业和公司将成为先导性力量，在整体经济中占主导地位，其中蕴含的投资机会将主导未来资本市场的走向。 |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>本基金基于自上而下的国策驱动投资分析框架，深入挖掘国家政策推进过程中符合经济结构调整、产业转型升级方向，且在政策推动下收益性确定的投资机会，构建并动态调整投资组合。本基金以政策为投资导向，重点关注的政策包括国家的财政、货币政策等宏观政策、为推进某些产业或区域发展所采取的产业扶持、财政税收倾斜、发展规划等产业、区域政策以及股票发行体制改革等改革政策，基于对国家政策的密切跟踪和分析，挖掘资本市场的投资机会。</p> <p>本基金自上而下的投资策略主要分为两个层次，首先通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，积极把握国家政策方向和宏观经济发展趋势，结合基金面分析和估值水平分析，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。</p> <p><b>1、大类资产配置策略</b></p> <p>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，预测未来一段时间股票、债券市场的相对收益率，并基于分析、预测结果调整股票、债券类资产在给定时间区间内的动态配置。</p> <p><b>2、股票投资策略</b></p> <p>（1）行业配置 本基金股票投资主要分为两个步骤：第一个步骤是行业配置，基于定性和定量分析，对行业进行优化配置和动态调整。</p> <p>（2）个股精选 在行业配置基础上，本基金精选成长性明确、市场估值合理的优质上市公司，构建股票投资组合。</p> <p>（3）股票投资组合管理 本基金将在策略分析基础上，建立买入和卖出股票名单，选择合理时机，稳步建立和调整</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                  |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
|                 | <p>投资组合。在投资组合管理过程中，本基金还将注重投资品种的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。</p> <p>3、固定收益品种投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>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，尽量减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> |                  |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率 ×50% + 中证综合债券指数收益率 ×50%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                  |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰国策驱动灵活配置混合 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 国泰国策驱动灵活配置混合 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 000511                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 002062           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 47,577,163.45 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 716,306,382.98 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期                              |                    |
|----------------|----------------------------------|--------------------|
|                | (2016 年 1 月 1 日-2016 年 3 月 31 日) |                    |
|                | 国泰国策驱动灵活配置<br>混合 A               | 国泰国策驱动灵活配置<br>混合 C |
| 1.本期已实现收益      | 118,608.58                       | -4,250,437.99      |
| 2.本期利润         | -3,284,021.63                    | -8,688,345.47      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0127                          | -0.0092            |
| 4.期末基金资产净值     | 67,190,482.49                    | 1,010,321,022.60   |
| 5.期末基金份额净值     | 1.412                            | 1.410              |

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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、国泰国策驱动灵活配置混合 A：

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.35%     | 0.15%         | -6.17%         | 1.22%                 | 5.82% | -1.07% |

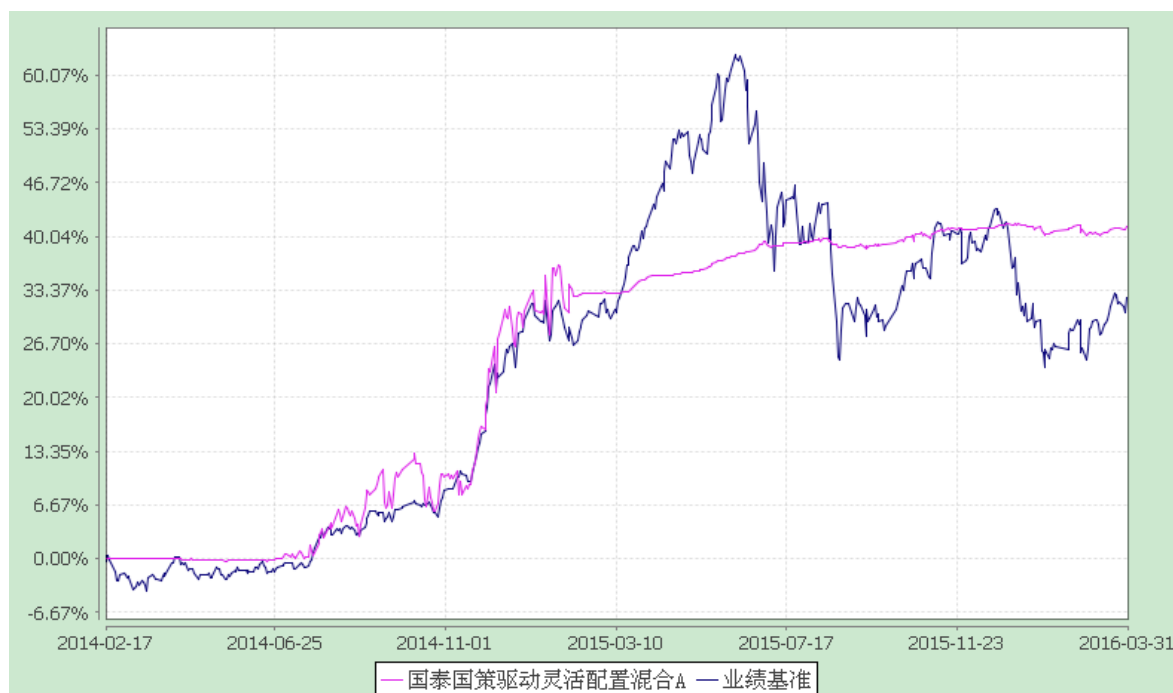
##### 2、国泰国策驱动灵活配置混合 C：

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.49%     | 0.15%         | -6.17%         | 1.22%                 | 5.68% | -1.07% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

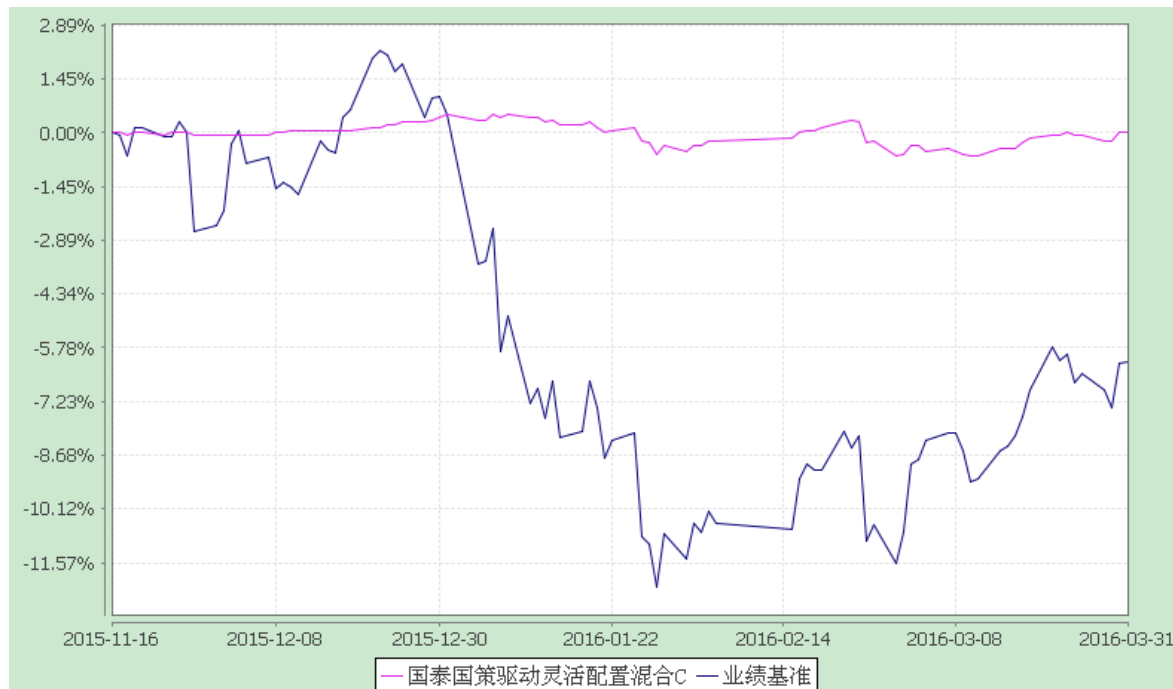
国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2014 年 2 月 17 日至 2016 年 3 月 31 日)

##### 1. 国泰国策驱动灵活配置混合 A：



注：本基金合同生效日为 2014 年 2 月 17 日，在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2. 国泰国策驱动灵活配置混合 C:



注：本基金合同生效日为 2014 年 2 月 17 日，在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                                                                                          | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                             | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 樊利安 | 本基金的基金经理、国泰民益灵活配置混合（LOF）（原国泰淘新灵活配置）、国泰浓益灵活配置混合、国泰结构转型灵活配置混合、国泰兴益灵活配置混合、国泰生益灵活配置混合、国泰金泰平衡混合（原国泰金泰封闭）、国泰睿吉灵活配 | 2015-03-17  | -    | 10 年   | 硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月起兼任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 5 月起兼任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起兼任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金和国泰金泰平衡混合型证券投资基金（原金泰证券投资基金）的基金经理。2015 年 5 月起任研究部副总监，2016 年 1 月起任研究部副总监（主持工作）。 |

|  |                                               |  |  |  |  |
|--|-----------------------------------------------|--|--|--|--|
|  | 置混合<br>的基金<br>经理、<br>研究部<br>副总监<br>(主持<br>工作) |  |  |  |  |
|--|-----------------------------------------------|--|--|--|--|

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合规守信情况的说明

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求最大利益。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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 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，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，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。

##### 4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年第一周市场就出现了两次熔断，沪深两市经历了有史以来最差开局，创业板综指一月单月跌幅高达 28.7%。从一季度来看，上证指数下跌 15.12%，深证综指下跌 17.18%，创业板综指下跌 19.31%。从行业表现来看，食品饮料、银行、采掘、有色等消费和周期类大市值股票表现出较强的抗跌性，计算机、通信、传媒、轻工等中小市值股票跌幅较大。

一季度总体来看仍然是去年下半年下跌行情的延续。由于市场结构在近两年发生了较大的变化，以绝对收益为主的各类资金占比大幅提升，在市场中逐步占据了主导地位，这使得市场短期波动加剧，单日指数跌幅过百点更为频繁。

本基金一季度以绝对收益策略为主，保持了少量仓位参与新股申购，净值基本保持稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰国策驱动 A 在 2016 年第一季度的净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准收益率为-6.17%。

国泰国策驱动 C 在 2016 年第一季度的净值增长率为-0.49%，同期业绩比较基准收益率为-6.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观层面来看，2016 年经济下行趋势不变，3 月 PMI 数据有所好转，大宗商品库存周期见底，产品价格回升，但我们认为二季度经济回暖的力度不大。虽然 3 月底美联储并没有加息，但随着美国经济的走强，后续加息的可能性依然较大，人民币汇率依旧存在压力。

我们认为 2016 年市场资金面基本平衡，仍然是存量博弈，在经历了一季度的下跌之后，市场继续下行空间有限，可能在宽幅震荡的过程中重心逐步下移。但由于中小市值股票估值仍然较高，我们认为市场全年很难看到系统性的机会，更多地需要把握结构性的机会，如新能源汽车、畜禽养殖、电子、消费等景气度较高的子行业。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 53,282,235.35    | 4.93         |
|    | 其中：股票             | 53,282,235.35    | 4.93         |
| 2  | 固定收益投资            | 833,713,772.10   | 77.12        |
|    | 其中：债券             | 833,713,772.10   | 77.12        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 128,970,504.49   | 11.93        |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 52,456,539.97    | 4.85         |
| 7  | 其他各项资产            | 12,618,823.21    | 1.17         |
| 8  | 合计                | 1,081,041,875.12 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 24,491,034.04 | 2.27         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,043,009.88  | 0.84         |
| E  | 建筑业              | 11,932,719.43 | 1.11         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,796,840.00  | 0.35         |
| J  | 金融业              | -             | -            |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| K | 房地产业          | 610,488.00    | 0.06 |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -    |
| M | 科学研究和技术服务业    | 3,408,144.00  | 0.32 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -    |
| P | 教育            | -             | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -    |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 53,282,235.35 | 4.94 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 002781 | 奇信股份 | 204,545 | 6,772,484.95 | 0.63         |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 175,000 | 6,307,000.00 | 0.59         |
| 3  | 002081 | 金螳螂  | 300,000 | 5,124,000.00 | 0.48         |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 309,000 | 3,908,850.00 | 0.36         |
| 5  | 300012 | 华测检测 | 161,600 | 3,408,144.00 | 0.32         |
| 6  | 000890 | 法尔胜  | 412,673 | 3,334,397.84 | 0.31         |
| 7  | 300332 | 天壕环境 | 179,914 | 3,314,015.88 | 0.31         |
| 8  | 000669 | 金鸿能源 | 200,000 | 3,084,000.00 | 0.29         |
| 9  | 600037 | 歌华有线 | 155,800 | 2,469,430.00 | 0.23         |
| 10 | 600500 | 中化国际 | 196,886 | 2,081,085.02 | 0.19         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 131,313,000.00 | 12.19        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 377,508,000.00 | 35.04        |
|    | 其中：政策性金融债 | 377,508,000.00 | 35.04        |
| 4  | 企业债券      | 6,514,200.00   | 0.60         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | 310,473,000.00 | 28.81 |
| 6  | 中期票据      | -              | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 7,905,572.10   | 0.73  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 833,713,772.10 | 77.37 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 150023    | 15 附息国债 23     | 1,300,000 | 131,313,000.00 | 12.19        |
| 2  | 140225    | 14 国开 25       | 1,000,000 | 102,520,000.00 | 9.51         |
| 3  | 041654010 | 16 云能投 CP001   | 1,000,000 | 100,070,000.00 | 9.29         |
| 4  | 011699374 | 16 龙源电力 SCP004 | 1,000,000 | 99,920,000.00  | 9.27         |
| 5  | 150418    | 15 农发 18       | 800,000   | 81,512,000.00  | 7.56         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，

以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 123,461.11    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,555,829.34  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,939,235.14 |
| 5  | 应收申购款   | 297.62        |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 12,618,823.21 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净 |
|----|------|------|---------|--------|
|----|------|------|---------|--------|

|   |        |      |            | 值比例(%) |
|---|--------|------|------------|--------|
| 1 | 110031 | 航信转债 | 753,072.00 | 0.07   |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值(元) | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 002781 | 奇信股份 | 6,772,484.95       | 0.63             | 网下新股         |
| 2  | 000890 | 法尔胜  | 3,334,397.84       | 0.31             | 重大事项         |
| 3  | 000699 | 金鸿能源 | 3,084,000.00       | 0.29             | 重大事项         |

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 国泰国策驱动灵活配置<br>混合A | 国泰国策驱动灵活配置<br>混合C |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 391,047,163.22    | 1,255,307,801.41  |
| 报告期基金总申购份额   | 376,286.37        | 141,342,049.47    |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 343,846,286.14    | 680,343,467.90    |
| 报告期基金拆分变动份额  | -                 | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 47,577,163.45     | 716,306,382.98    |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

- 1、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于核准国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

## 8.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司办公地点——北京市西城区闹市口大街1号院1号楼。

## 8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一六年四月二十二日