

**国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金**  
**2018 年第 2 季度报告**  
**2018 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇一八年七月二十日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2018 年 7 月 17 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 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰结构转型灵活配置混合                                                                                                                         |
| 基金主代码      | 000512                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                               |
| 基金合同生效日    | 2014 年 5 月 19 日                                                                                                                      |
| 报告期末基金份额总额 | 28,630,922.17 份                                                                                                                      |
| 投资目标       | 通过深入研究，积极投资于我国长期经济结构转型过程中符合经济发展方向、增长前景确定且估值水平合理的优质企业，分享经济转型发展带来的高成长和高收益，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。                                   |
| 投资策略       | 本基金通过深入分析国家产业政策并综合判断经济结构转型趋势，积极挖掘我国长期经济结构转型过程中符合经济结构调整、产业转型升级方向，且具有较高成长性和合理估值水平的上市公司股票，构建并动态优化投资组合。<br><br>具体而言，本基金的投资策略分为两个层次：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、估值水平等相关因素的分析，确定不同资产类别的配置比例；在大类资产配置的基础上，本基金将在受益于我国经济结构转型的产业领域内，采取自下而上的选股方法，通过系统分析上市公司基本面和估值水平，深入挖掘具有较高成长性且估值水平合理的上市公司股票，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，并依据我国经济转型的推进和市场环境的演变对投资组合进行动态调整。 |                |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×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           | 中国银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                              |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰结构转型灵活配置混合 A                                                                                                                                                                                                                          | 国泰结构转型灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 000512                                                                                                                                                                                                                                  | 002063         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 23,902,379.91 份                                                                                                                                                                                                                         | 4,728,542.26 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                              |                |
|-----------|----------------------------------|----------------|
|           | (2018 年 4 月 1 日-2018 年 6 月 30 日) |                |
|           | 国泰结构转型灵活配置混合 A                   | 国泰结构转型灵活配置混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 508,745.59                       | 489,911.58     |

|                |               |               |
|----------------|---------------|---------------|
| 2.本期利润         | -4,680,973.81 | -1,110,715.52 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1815       | -0.1557       |
| 4.期末基金资产净值     | 42,314,409.77 | 8,273,883.52  |
| 5.期末基金份额净值     | 1.770         | 1.750         |

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 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、国泰结构转型灵活配置混合 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 | -9.51%     | 0.97%         | -4.52%         | 0.57%                 | -4.99% | 0.40% |

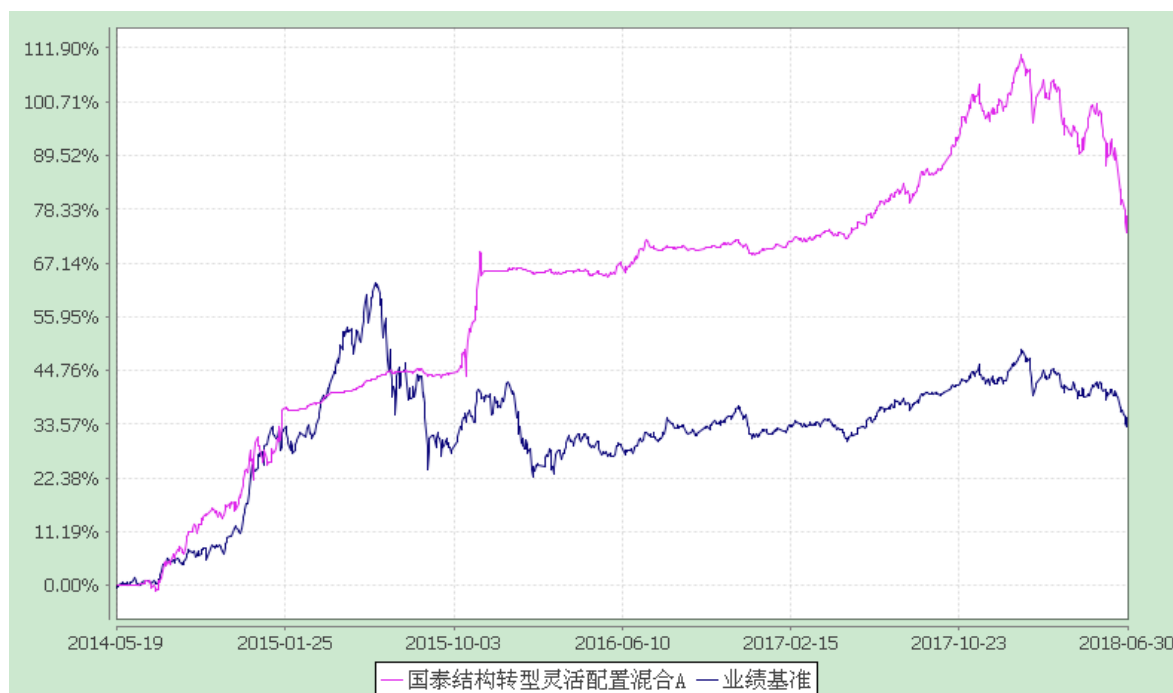
##### 2、国泰结构转型灵活配置混合 C：

| 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 | -9.56%     | 0.97%         | -4.52%         | 0.57%                 | -5.04% | 0.40% |

#### 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

国泰结构转型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 5 月 19 日至 2018 年 6 月 30 日)

##### 1. 国泰结构转型灵活配置混合 A：



注：本基金合同生效日为 2014 年 5 月 19 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2. 国泰结构转型灵活配置混合 C:



注：本基金合同生效日为 2014 年 5 月 19 日，本基金在 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）、国泰浓益灵活配置混合、国泰国策驱动灵活配置混合、国泰兴益灵活配置混合、国泰睿吉灵活配置混合、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）、国泰添益灵活配置 | 2015-01-26  | -    | 12 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 月至 2018 年 2 月兼任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起兼任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 1 月任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）的基金经理，2016 年 5 月至 2017 年 11 月兼任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月起兼任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月起兼任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 |

|  |                                                                                                                                  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 混合、国泰鸿益灵活配置混合、国泰丰益灵活配置混合、国泰信益灵活配置混合、国泰普益灵活配置混合、国泰安益灵活配置混合、国泰融信定增灵活配置混合、国泰融安多策略灵活配置混合、国泰稳益定期开放灵活配置混合、国泰宁益定期开放灵活配置混合、国泰恒益灵活配置混合的基金 |  |  |  | <p>12 月起兼任国泰丰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、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月起兼任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 6 月兼任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任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的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月起兼任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金和国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任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）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月起任研究部副总监（主持工作）。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                 |  |  |  |  |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|
|  | 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

2018 年 2 季度，市场经历了较大幅度调整，同时风格变化较大。最终上证指数下跌 10.14%，

深证成指下跌 13.70%，创业板下跌 15.46%，消费、医药板块相对优势明显。从行业来看，食品饮料有正增长，医药具有相对优势，其他板块均有不同程度的回调，部分股票跌幅较大。

二季度宏观经济预期相比一季度略有下滑，受制于中美贸易战、宏观经济预期、美国加息以及国内金融去杠杆影响，市场整体回调明显；避险情绪下，食品饮料、医药板块相对优势明显。

本基金以绝对收益策略为主，保持了一定仓位参与新股申购，其余资金配置短久期债券以及货币化管理。在上半年市场出现较大幅度调整的情况下，本基金净值也出现了一定幅度的下跌。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰结构转型灵活配置混合 A 在 2018 年第二季度的净值增长率为-9.51%，同期业绩比较基准收益率为-4.52%。

国泰结构转型灵活配置混合 C 在 2018 年第二季度的净值增长率为-9.56%，同期业绩比较基准收益率为-4.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从二季度宏观经济数据来看，整体较为稳定，但是市场预期有下降。

2018 年以来，国内经济政策的重点从稳增长转向防风险和促改革。我们认为 2018 年宏观经济增速将稳中有降：国内地产投资增速相比 2017 年预计有小幅下行；消费平稳，消费升级继续；美国加息如期进行；中美贸易战已经进入中长期拉锯。在上述背景下，我们认为三季度消费、医药板块仍是重要的配置资产，另外适当配置符合未来发展方向、性价比有优势的成长股。

#### 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  | 29,889,784.58 | 58.54        |
|    | 其中：股票 | 29,889,784.58 | 58.54        |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 固定收益投资            | -             | -      |
|   | 其中：债券             | -             | -      |
|   | 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          | -             | -      |
|   | 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      | 21,082,791.12 | 41.29  |
| 7 | 其他各项资产            | 83,665.35     | 0.16   |
| 8 | 合计                | 51,056,241.05 | 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              | 14,021,013.90 | 27.72        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 6,345,000.00  | 12.54        |
| 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  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 8,200,770.68  | 16.21        |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| 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 | 1,323,000.00  | 2.62  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 29,889,784.58 | 59.08 |

### 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  | 002589 | 瑞康医药 | 300,000 | 4,092,000.00 | 8.09         |
| 2  | 601336 | 新华保险 | 92,900  | 3,983,552.00 | 7.87         |
| 3  | 000910 | 大亚圣象 | 202,000 | 3,413,800.00 | 6.75         |
| 4  | 603156 | 养元饮品 | 52,804  | 2,896,827.44 | 5.73         |
| 5  | 002390 | 信邦制药 | 350,000 | 2,562,000.00 | 5.06         |
| 6  | 600867 | 通化东宝 | 98,784  | 2,367,852.48 | 4.68         |
| 7  | 002640 | 跨境通  | 150,000 | 2,253,000.00 | 4.45         |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 77,900  | 2,059,676.00 | 4.07         |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 382,000 | 2,032,240.00 | 4.02         |
| 10 | 002466 | 天齐锂业 | 39,500  | 1,958,805.00 | 3.87         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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（除“招商银行”违规情况外），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。

招商银行于 2018 年 5 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。招商银行股份有限公司本次违规行为包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本基金管理人此前投资招商银行股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为招商银行存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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   | 60,970.54 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 3,130.74  |
| 5  | 应收申购款   | 19,564.07 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 83,665.35 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 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 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 603156 | 养元饮品 | 2,896,827.44   | 5.73         | 网下中签     |

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 国泰结构转型灵活配置<br>混合A | 国泰结构转型灵活配置<br>混合C |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 28,770,328.95     | 13,879,255.06     |

|              |               |              |
|--------------|---------------|--------------|
| 报告期基金总申购份额   | 1,286,481.43  | -            |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 6,154,430.47  | 9,150,712.80 |
| 报告期基金拆分变动份额  | -             | -            |
| 本报告期期末基金份额总额 | 23,902,379.91 | 4,728,542.26 |

## §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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                         | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |              |      |              | 报告期末持有基金情况 |      |
|---------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|--------------|------|--------------|------------|------|
|                                                               | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额         | 申购份额 | 赎回份额         | 持有份额       | 份额占比 |
| 机构                                                            | 1              | 2018年4月1日至2018年4月24日   | 9,137,243.05 | -    | 9,137,243.05 | -          | -    |
| 产品特有风险                                                        |                |                        |              |      |              |            |      |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                        |              |      |              |            |      |

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于核准国泰结构转型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

**9.2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。

本基金托管人住所。

**9.3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

二〇一八年七月二十日