

# 国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年第 1 季度报告

2019 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：二〇一九年四月二十二日

## § 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约定，于 2019 年 4 月 18 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 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                   |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰多策略收益灵活配置                                                                                                                                       |
| 基金主代码      | 001922                                                                                                                                            |
| 交易代码       | 001922                                                                                                                                            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                            |
| 基金合同生效日    | 2018 年 12 月 4 日                                                                                                                                   |
| 报告期末基金份额总额 | 98,446,000.92 份                                                                                                                                   |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。                                                                                                                            |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要根据上市公司获利能力、成长能力以及估值水平来进行个股选择。运用定性和定量相结合的方法，综合分析其投资价值和成长能力，确定投资标的的股票，构建投资组合。</p> <p>3、固定收益类投资工具投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>6、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，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>7、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、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。</p> <p>8、股票期权投资策略</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> |
| 业绩比较基准 | 50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率                                                                                                                                                                                                           |
| 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                                                                                                                                                                                                                              |

### § 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<br>(2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日) |
|-----------------|-----------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 622, 574. 68                            |
| 2. 本期利润         | 2, 248, 244. 21                         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0201                                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 104, 289, 341. 86                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 0594                                 |

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。

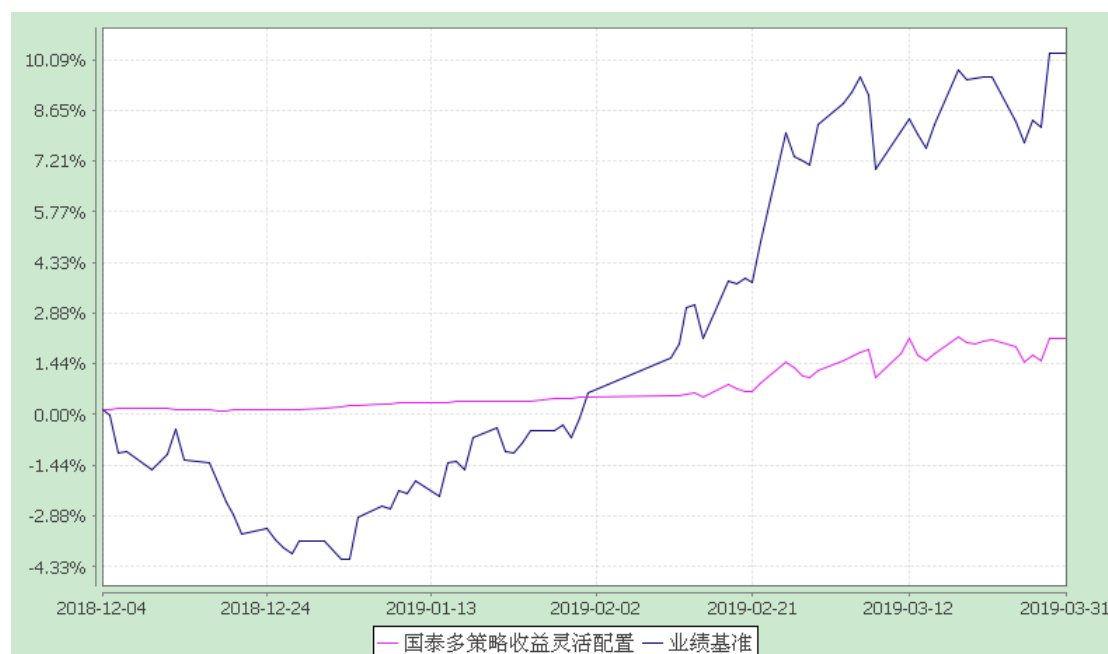
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | 1.99%  | 0.23%     | 14.39%     | 0.77%         | -12.40% | -0.54% |

### 3.2.2 自基金转型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

国泰多策略收益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历史走势对比图  
 (2018 年 12 月 4 日至 2019 年 3 月 31 日)



注：本基金合同生效日为2018年12月4日。截止至2019年3月31日，本基金运作时间未满一年。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 吴晨 | 本基金的基金经理、国泰金龙债券、国泰信用互利分级债券、国泰双利债券、国泰招惠收益定期开放债券、国泰瑞和纯债债券、国泰鑫策略价值灵活配置混合、国泰农惠定期开放债券的基金经理、绝对收益投资（事业）部总监、 | 2010-04-29  | -    | 17 年   | 硕士研究生，CFA，FRM。2001 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004 年 9 月至 2005 年 10 月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005 年 10 月至 2008 年 3 月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008 年 4 月至 2009 年 3 月在长信基金管理有限公司从事债券研究；2009 年 4 月至 2010 年 3 月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010 年 4 月起任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理；2010 年 9 月至 2011 年 11 月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2011 年 12 月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理；2012 年 9 月至 2013 年 11 月任国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 10 月起兼任国泰双利债券证券投资基金的基金经理；2016 年 1 月至 2019 年 1 月任国泰鑫保本混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 1 月至 2018 年 12 月任国泰新目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 4 月任国泰 |

|  |        |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|--------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 固收投资总监 |  |  | <p>民惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 4 月任国泰民丰回报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 月至 2018 年 8 月任国泰民安增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 9 月至 2019 年 1 月任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）的基金经理，2017 年 11 月至 2018 年 9 月任国泰安心回报混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月至 2018 年 8 月任国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 1 月任国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理，2018 年 9 月起兼任国泰瑞和纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月起兼任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 1 月起兼任国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 3 月起兼任国泰农惠定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月至 2015 年 5 月</p> |
|--|--------|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                  |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 任绝对收益投资（事业）部总监助理，2015 年 5 月至 2016 年 1 月任绝对收益投资（事业）部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作），2017 年 7 月起任固收投资总监，2018 年 7 月起任绝对收益投资（事业）部总监。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

一月初受 PMI 跌破荣枯线叠加央行全面降准提振，债券收益率下行，继而在宽信用政策不断落地及贸易战缓和影响下，债券收益率震荡上行；二月上旬，国内处于春节期间，受海外主要经济体增长放缓、海外宽松预期升温带动，境内债券收益率下行，二月中下旬，受一月金融数据公布超预期及权益市场持续上涨影响下，债券收益率明显上行；三月初，随着两会召开，降息预期升温，债券收益率快速下行，但随后在股票市场持续上涨压制下，债券收益率转而上行，三月下旬，受美债三个月与十年收益率倒挂引发衰退担忧，美联储鸽派论调超预期影响，境内债券收益率下行。一季度以来，海外经济增长持续放缓是境内债券市场的强心剂，但境内经济信号受春节错位影响表现相对混乱，叠加股票市场强势表现使得债券收益率下行过程倍显曲折，总体看来，收益率小幅震荡下行。

2019 年一季度，基金处于保本周期到期转型成为非保本的混合基金的建仓期，基金逐步增加了中短久期信用债及转债仓位。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰多策略收益灵活配置 2019 年一季度的净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为 14.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体看来，二季度债券市场或保持震荡，首先 3 月经济数据受春节错位影响存在回升超预期的可能，二季度经济运行在基建回升及地产建安短期走强影响的支撑下或仍有韧性，经济数据对债券市场利多有限；此外，二季度到期 MLF1.2 近万亿，目前市场对 4 月中旬央行降准对冲流动性缺口的预期较为充分，若降准预期落空将对市场情绪造成冲击。但当前房地产销售及土地成交持续回落，地产景气度下滑或将使社融回升幅度低于预期，同时海外经济增长放缓确定性较强，均将一定程度上支撑国内债市。中期看来，未来出口持续放缓及地产投资压力的显现将使得经济下行得到确认，只是下行过程并非一蹴而就，经济下行节奏或成为未来债券市场预期差的主要来源。

展望下季度，基金将逐步替换到期资产，配置以中等久期中高等级信用债为主，转债方面，积极关注一级打新机会，对前期有一定涨幅积累的个券进行适时调仓。

#### 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              | 15,416,522.78  | 14.68        |
|    | 其中：股票             | 15,416,522.78  | 14.68        |
| 2  | 固定收益投资            | 85,622,451.20  | 81.55        |
|    | 其中：债券             | 85,622,451.20  | 81.55        |
|    | 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      | 2,092,898.19   | 1.99         |
| 7  | 其他各项资产            | 1,859,850.43   | 1.77         |
| 8  | 合计                | 104,991,722.60 | 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      | 6,139,839.00 | 5.89         |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| 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           | 4,103,676.00  | 3.93  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 546,860.00    | 0.52  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 407,683.78    | 0.39  |
| J | 金融业              | 3,519,264.00  | 3.37  |
| K | 房地产业             | 699,200.00    | 0.67  |
| 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        | -             | -     |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 15,416,522.78 | 14.78 |

### 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  | 603883 | 老百姓  | 24,400  | 1,534,272.00 | 1.47         |
| 2  | 601688 | 华泰证券 | 66,800  | 1,496,988.00 | 1.44         |
| 3  | 603939 | 益丰药房 | 22,700  | 1,317,054.00 | 1.26         |
| 4  | 603369 | 今世缘  | 44,600  | 1,280,020.00 | 1.23         |
| 5  | 603233 | 大参林  | 25,300  | 1,252,350.00 | 1.20         |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 44,200  | 1,095,276.00 | 1.05         |
| 7  | 601128 | 常熟银行 | 123,600 | 927,000.00   | 0.89         |
| 8  | 600271 | 航天信息 | 29,900  | 835,107.00   | 0.80         |
| 9  | 000961 | 中南建设 | 73,600  | 699,200.00   | 0.67         |
| 10 | 002407 | 多氟多  | 37,400  | 570,724.00   | 0.55         |

### 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      | 5,997,600.00  | 5.75  |
| 2  | 央行票据      | —             | —     |
| 3  | 金融债券      | —             | —     |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —     |
| 4  | 企业债券      | 60,102,000.00 | 57.63 |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —     |
| 6  | 中期票据      | —             | —     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 212,851.20    | 0.20  |
| 8  | 同业存单      | 19,310,000.00 | 18.52 |
| 9  | 其他        | —             | —     |
| 10 | 合计        | 85,622,451.20 | 82.10 |

#### 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  | 111810337 | 18 兴业银行 CD337 | 200,000 | 19,310,000.00 | 18.52        |
| 2  | 136242    | 16 中车 G1      | 100,000 | 10,149,000.00 | 9.73         |
| 3  | 136500    | 16 兴泰债        | 100,000 | 9,995,000.00  | 9.58         |
| 4  | 136544    | 16 联通 03      | 100,000 | 9,993,000.00  | 9.58         |
| 5  | 136687    | 16 中泰 01      | 100,000 | 9,990,000.00  | 9.58         |

#### 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“中泰证券”违规外）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。

2018 年，中泰证券作为主办券商，在对朗顿教育信息披露文件进行事前审查、持续督导其规范履行信息披露义务和完善公司治理机制等过程中，未能勤勉尽责、严格履行法定职责，未能及时予以关注并督促其采取有效措施予以整改。作为独立财务顾问，在为朗顿教育重大资产重组项目出具独立财务顾问报告过程中，未认真履行对尊天文化资产权属的审慎核查义务，未关注到异常情况，在 2015 年 6 月 12 日不当地出具了的财务顾问意见，且所出具意见未按规定经过你

公司内部核查机构进行论证与复核。违反了《非上市公司监督管理办法》第六条、第二十条、第五十四条，《非上市公司重大资产重组管理办法》第六条、第三十八条等相关规定。收到广东证监局出具的警示函，责令公司整改。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司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   | 21,585.54    |
| 2  | 应收证券清算款 | 500,000.00   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,337,074.23 |
| 5  | 应收申购款   | 1,190.66     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,859,850.43 |

### 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处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 136,993,901.78 |
| 报告期基金总申购份额   | 743,462.21     |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 39,291,363.07  |
| 报告期基金拆分变动份额  | —              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 98,446,000.92  |

## § 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，本基金的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、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰新目标收益保本混合型证券投资基金注册的批复
- 4、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 5、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、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  
二〇一九年四月二十二日