

**国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金  
(原国泰鑫保本混合型证券投资基金转型)**

**2019 年半年度报告**

**2019 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：二〇一九年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 2019 年 8 月 26 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。

根据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，“保本期到期时，若本基金不符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为‘国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金’”。本基金第一个保本期到期后不再符合保本基金存续条件，本基金按照《基金合同》的约定变更为非保本的混合型基金，即“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”。变更后基金合同、托管协议和招募说明书分别修订为《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，调整的内容包括但不限于保留并适用《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》关于变更后的国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准以及基金费率等条款的约定，并根据现行有效的法律法规规定，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对基金合同的其他条款进行了修订。变更后的基金合同、托管协议自 2019 年 1 月 3 日起生效，原《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效。本基金变更后，基金名称变更为“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”，基金简称变更为“国泰鑫策略价值灵活配置混合”，基金代码仍为“002197”。具体可查阅本基金管理人于 2018 年 12 月 22 日披露的《关于国泰鑫保本混合型证券投资基金保本期到期处理规则及变更为国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原国泰鑫保本混合型证券投资基金报告期自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日止，国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2019 年 1 月 3 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| <b>2 基金简介</b>                           | <b>7</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 7         |
| 2.1.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金              | 7         |
| 2.1.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金                    | 7         |
| 2.2 基金产品说明                              | 7         |
| 2.2.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金              | 7         |
| 2.2.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金                    | 9         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 9         |
| 2.4 信息披露方式                              | 9         |
| 2.5 其他相关资料                              | 9         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>10</b> |
| 3.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金                | 10        |
| 3.1.1 主要会计数据和财务指标                       | 10        |
| 3.1.2 基金净值表现                            | 10        |
| 3.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金                      | 11        |
| 3.2.1 主要会计数据和财务指标                       | 11        |
| 3.2.2 基金净值表现                            | 12        |
| <b>4 管理人报告</b>                          | <b>13</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 13        |
| 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验                    | 13        |
| 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介           | 16        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 19        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 20        |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况                       | 20        |
| 4.3.2 异常交易行为的专项说明                       | 20        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明              | 20        |
| 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析                   | 20        |
| 4.4.2 报告期内基金的业绩表现                       | 21        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 21        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 21        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 21        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 21        |
| <b>5 托管人报告</b>                          | <b>21</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 21        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 22        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 22        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | <b>22</b> |
| 6.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金                | 22        |
| 6.1.1 资产负债表                             | 22        |
| 6.1.2 利润表                               | 24        |
| 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表                    | 25        |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| 6.1.4 报表附注 .....                             | 25        |
| 6.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金 .....                     | 48        |
| 6.2.1 资产负债表 .....                            | 48        |
| 6.2.2 利润表 .....                              | 49        |
| 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 50        |
| 6.2.4 报表附注 .....                             | 51        |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | <b>69</b> |
| 7.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金 .....               | 69        |
| 7.1.1 期末基金资产组合情况 .....                       | 69        |
| 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 69        |
| 7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 70        |
| 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 71        |
| 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 72        |
| 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....    | 73        |
| 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 73        |
| 7.1.8 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贵金属投资明细..... | 73        |
| 7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....    | 73        |
| 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 73        |
| 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 73        |
| 7.1.12 投资组合报告附注 .....                        | 73        |
| 7.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金 .....                     | 74        |
| 7.2.1 期末基金资产组合情况 .....                       | 74        |
| 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 75        |
| 7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 75        |
| 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 75        |
| 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 75        |
| 7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....    | 76        |
| 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 76        |
| 7.2.8 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贵金属投资明细..... | 76        |
| 7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....    | 76        |
| 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 76        |
| 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 76        |
| 7.2.12 投资组合报告附注 .....                        | 76        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | <b>78</b> |
| 8.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金 .....               | 78        |
| 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 78        |
| 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 78        |
| 8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 78        |
| 8.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金 .....                     | 78        |
| 8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 79        |
| 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 79        |
| 8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 79        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                     | <b>79</b> |
| 9.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金 .....               | 79        |
| 9.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金 .....                     | 79        |

|           |                              |    |
|-----------|------------------------------|----|
| <b>10</b> | <b>重大事件揭示</b>                | 80 |
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议                  | 80 |
| 10.2      | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动  | 80 |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼       | 80 |
| 10.4      | 基金投资策略的改变                    | 80 |
| 10.5      | 为基金进行审计的会计师事务所情况             | 80 |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 | 81 |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况            | 81 |
| 10.7.1    | 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金         | 81 |
| 10.7.2    | 国泰鑫保本混合型证券投资基金               | 82 |
| 10.8      | 其他重大事件                       | 83 |
| <b>11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b>        | 84 |
| <b>12</b> | <b>备查文件目录</b>                | 85 |
| 12.1      | 备查文件目录                       | 85 |
| 12.2      | 存放地点                         | 85 |
| 12.3      | 查阅方式                         | 85 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 国泰鑫策略价值灵活配置混合        |
| 基金主代码      | 002197               |
| 交易代码       | 002197               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2019年1月3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 | 64,138,294.91份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

#### 2.1.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金名称       | 国泰鑫保本混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 国泰鑫保本混合         |
| 基金主代码      | 002197          |
| 交易代码       | 002197          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2015年12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      |
| 报告期末基金份额总额 | 204,415,911.33份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

|      |                                                                            |
|------|----------------------------------------------------------------------------|
| 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 | 1、资产配置策略<br>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 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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><b>2、股票投资策略</b></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><b>3、固定收益类投资工具投资策略</b></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><b>4、中小企业私募债投资策略</b></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><b>5、资产支持证券投资策略</b></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><b>6、权证投资策略</b></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><b>7、股指期货投资策略</b></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><b>8、股票期权投资策略</b></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，并结合股指期货定价模型，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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |



## 2.2.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

|        |                                                                                                            |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。                                                          |
| 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，以实现保本和增值的目标。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）                                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。                                                                                  |

## 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<br>负责人 | 姓名   | 刘国华                          | 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         |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室 | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 办公地址        |      | 上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层   | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 邮政编码        |      | 200082                       | 100818               |
| 法定代表人       |      | 陈勇胜                          | 刘连舸                  |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                                           |
|----------------------|-----------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《上海证券报》                                                   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 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                 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                              |
|--------|------------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国泰基金管理有限公司登记注册中心 | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层 |

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

##### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日) |
|-----------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益         | 414,917.57                           |
| 本期利润            | 1,542,277.26                         |
| 加权平均基金份额本期利润    | 0.0248                               |
| 本期加权平均净值利润率     | 2.38%                                |
| 本期基金份额净值增长率     | 1.89%                                |
| 3.1.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润        | 2,643,462.66                         |
| 期末可供分配基金份额利润    | 0.0412                               |
| 期末基金资产净值        | 67,894,402.26                        |
| 期末基金份额净值        | 1.0586                               |
| 3.1.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率     | 1.89%                                |

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 2019 年 1 月 3 日，截止至 2019 年 6 月 30 日不满一年。

##### 3.1.2 基金净值表现

###### 3.1.2.1 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

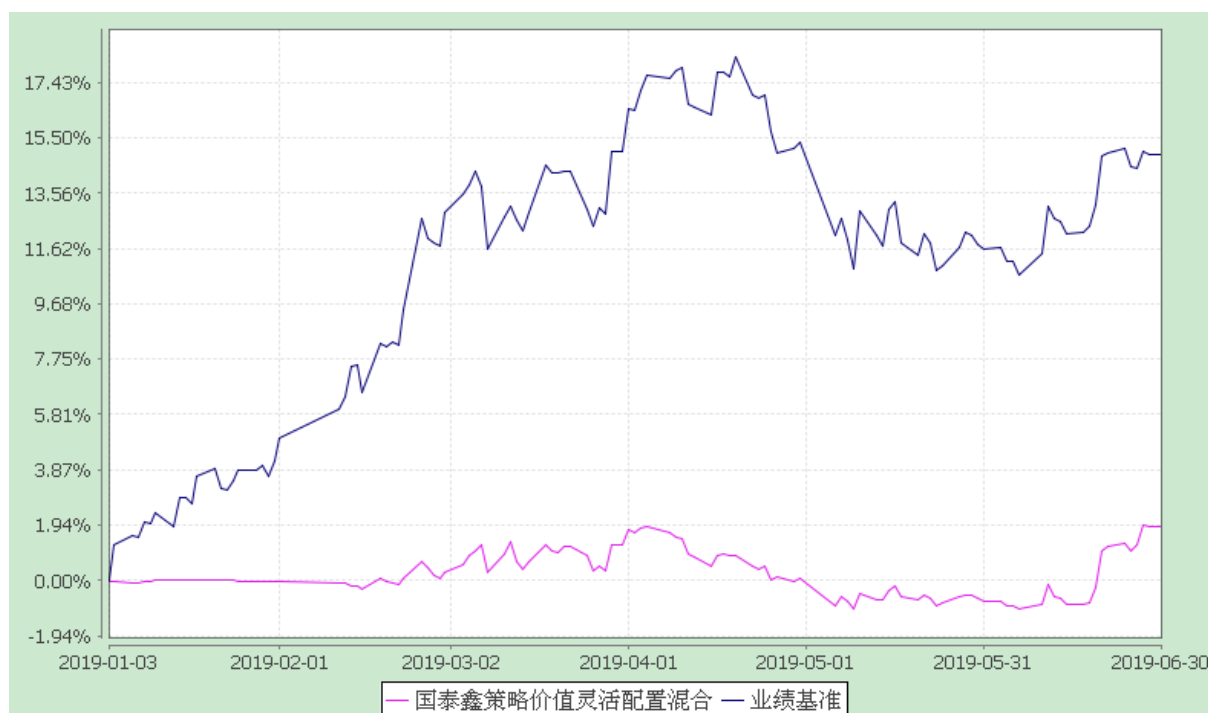
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | 2.65%    | 0.40%       | 2.96%      | 0.58%         | -0.31%  | -0.18% |
| 过去三个月      | 0.64%    | 0.33%       | -0.11%     | 0.75%         | 0.75%   | -0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.89%    | 0.31%       | 14.92%     | 0.77%         | -13.03% | -0.46% |

###### 3.1.2.2 自基金转型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

国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2019 年 1 月 3 日。截止至 2019 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年。

## 3.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.2.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日) |
|-----------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益         | 18,836.27                           |
| 本期利润            | 161,736.27                          |
| 加权平均基金份额本期利润    | 0.0007                              |
| 本期加权平均净值利润率     | 0.07%                               |
| 本期基金份额净值增长率     | 0.10%                               |
| 3.2.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 1 月 2 日)                |
| 期末可供分配利润        | 7,348,884.77                        |
| 期末可供分配基金份额利润    | 0.0360                              |
| 期末基金资产净值        | 212,290,990.20                      |
| 期末基金份额净值        | 1.039                               |
| 3.2.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019 年 1 月 2 日)                |

|             |       |
|-------------|-------|
| 基金份额累计净值增长率 | 3.90% |
|-------------|-------|

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）本报告期自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 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   |
|-------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 2 日 | 0.10%    | 0.07%       | 0.02%      | 0.00%         | 0.08%  | 0.07% |
| 2018 年 7 月 1 日-2019 年 1 月 2 日 | 1.17%    | 0.06%       | 1.40%      | 0.01%         | -0.23% | 0.05% |
| 2016 年 7 月 1 日-2019 年 1 月 2 日 | 3.59%    | 0.10%       | 6.90%      | 0.01%         | -3.31% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至 2019 年 1 月 2 日      | 3.90%    | 0.10%       | 8.28%      | 0.01%         | -4.38% | 0.09% |

#### 3.2.2.2 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

国泰鑫保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015 年 12 月 30 日至 2019 年 1 月 2 日）



注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 30 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 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 1.1 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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 108 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、国泰事件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、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、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、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、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、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、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、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、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、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、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、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、国泰瞬利交易型货币市场基金、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）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、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）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、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）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务           | 任本基金的基金经理<br>（助理）期限 |            | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----|--------------|---------------------|------------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |              | 任职日期                | 离任日期       |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 吴晨 | 本基金的<br>基金经理 | 2019-01-03          | 2019-05-31 | 17 年       | 硕士研究生，CFA，FRM。2001 年 7 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 |



|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>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 月至 2019 年 5 月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 月至 2019 年 5 月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，2019 年 7 月起兼任国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月至 2015 年 5 月任绝对收益投资（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</p> |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |                                                                                              |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|----|----------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                              |            |   |      | 益投资（事业）部总监。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 程洲 | 本基金的基金经理、国泰金牛创新混合、国泰大农业股票、国泰聚信价值优势灵活配置混合、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合、国泰聚优价值灵活配置混合、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合的基金经理 | 2019-05-31 | - | 19 年 | 硕士研究生，CFA。曾任职于申银万国证券研究所。2004 年 4 月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级策略分析师、基金经理助理，2008 年 4 月至 2014 年 3 月任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2009 年 12 月至 2012 年 12 月任金泰证券投资基金的基金经理，2010 年 2 月至 2011 年 12 月任国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的基金经理，2012 年 12 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，2013 年 12 月起兼任国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月起兼任国泰金牛创新成长混合型证券投资基金（原国泰金牛创新成长股票型证券投资基金）的基金经理，2017 年 3 月起兼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 6 月起兼任国泰大农业股票型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 3 月起兼任国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 王琳 | 本基金的基金经理、国泰兴益灵活配置混合、国泰                                                                       | 2019-05-31 | - | 10 年 | 博士研究生。2009 年 2 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2017 年 1 月起任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|  |                                                 |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|-------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 多策略收益灵活配置、国泰安康定期支付混合、国泰安益灵活配置混合、国泰普益灵活配置混合的基金经理 |  |  |  | 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017 年 1 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,2017 年 6 月至 2018 年 3 月任国泰睿信平衡混合型证券投资基金的基金经理,2017 年 8 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,2017 年 8 月起兼任国泰安康定期支付混合型证券投资基金(原国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金)的基金经理,2017 年 8 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,2019 年 5 月起兼任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2019 年 8 月起兼任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金和国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|-------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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，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。

#### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

#### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

#### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 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所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 管理人对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

2019 年上半年，市场波动较大，一季度市场涨幅较大，二季度市场经历了较大幅度下跌，同时风格差异较大。最终上证指数上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，创业板指上涨 20.87%，食品饮料、农业、金融等板块相对优势明显，建筑、文化娱乐、公用事业表现较弱。

一季度中美贸易暂缓，宏观经济预计乐观，预期向好，市场表现强势。二季度中美贸易战再次升温至技术封锁，预期恶化；国内宏观经济数据稳中有降，同时包商银行事件引发资金担忧。两相叠加，导致市场整体下跌明显。但是上半年市场整体呈现上涨态势。

本基金以绝对收益策略为主，一季度积极参与市场反弹，二季度较为及时的调整了股票仓位、结构。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰鑫策略价值灵活配置自 2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日的净值增长率为 1.89%，同期业绩比较基准收益率为 14.92%。

国泰鑫保本混合自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日的净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准收益率为 0.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，外部环境阶段性缓和，国内政策和经济走势可能是主导未来一段时间 A 股走势的主要因素。政策层面严控隐形债务、房住不炒，积极推进改革，包括资本市场改革、国企改革、经济结构转型等，为市场提供了中长期的信心。但是同时，国内外宏观经济增速下行的趋势并未发生预期改变。因此，市场仍然在谨慎中前行。

基于此，我们对 2019 年后半年的观点如下：精选配置符合未来发展方向、性价比有优势的成长股；业绩稳定增长、估值合理的白马蓝筹。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰鑫策略价值灵活配置混合

型证券投资基金（原国泰鑫保本混合型证券投资基金）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

### 6.1.1 资产负债表

会计主体：国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号       | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------|------------------------|
| <b>资 产：</b> |           |                        |
| 银行存款        | 6.1.4.7.1 | 12,845,032.30          |
| 结算备付金       |           | 10,464,700.57          |
| 存出保证金       |           | 29,866.21              |
| 交易性金融资产     | 6.1.4.7.2 | 45,199,838.50          |
| 其中：股票投资     |           | 23,152,938.50          |
| 基金投资        |           | -                      |
| 债券投资        |           | 22,046,900.00          |
| 资产支持证券投资    |           | -                      |
| 贵金属投资       |           | -                      |
| 衍生金融资产      | 6.1.4.7.3 | -                      |

|                   |            |                                |
|-------------------|------------|--------------------------------|
| 买入返售金融资产          | 6.1.4.7.4  | -                              |
| 应收证券清算款           |            | -                              |
| 应收利息              | 6.1.4.7.5  | 564,869.36                     |
| 应收股利              |            | -                              |
| 应收申购款             |            | 204,856.85                     |
| 递延所得税资产           |            | -                              |
| 其他资产              | 6.1.4.7.6  | -                              |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>69,309,163.79</b>           |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负 债:</b>       |            |                                |
| 短期借款              |            | -                              |
| 交易性金融负债           |            | -                              |
| 衍生金融负债            | 6.1.4.7.3  | -                              |
| 卖出回购金融资产款         |            | -                              |
| 应付证券清算款           |            | -                              |
| 应付赎回款             |            | 1,147,579.33                   |
| 应付管理人报酬           |            | 79,582.80                      |
| 应付托管费             |            | 13,263.82                      |
| 应付销售服务费           |            | -                              |
| 应付交易费用            | 6.1.4.7.7  | 22,390.00                      |
| 应交税费              |            | 1,825.81                       |
| 应付利息              |            | -                              |
| 应付利润              |            | -                              |
| 递延所得税负债           |            | -                              |
| 其他负债              | 6.1.4.7.8  | 150,119.77                     |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>1,414,761.53</b>            |
| <b>所有者权益:</b>     |            |                                |
| 实收基金              | 6.1.4.7.9  | 64,138,294.91                  |
| 未分配利润             | 6.1.4.7.10 | 3,756,107.35                   |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>67,894,402.26</b>           |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>69,309,163.79</b>           |

注：（1）报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0586 元，基金份额总额 64,138,294.91 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 3 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

### 6.1.2 利润表

会计主体：国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 3 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | <b>2,318,273.53</b>                      |
| 1.利息收入                     |            | 541,459.70                               |
| 其中：存款利息收入                  | 6.1.4.7.11 | 150,301.94                               |
| 债券利息收入                     |            | 391,157.76                               |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                                        |
| 买入返售金融资产收入                 |            | -                                        |
| 其他利息收入                     |            | -                                        |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 640,451.72                               |
| 其中：股票投资收益                  | 6.1.4.7.12 | 497,567.52                               |
| 基金投资收益                     |            | -                                        |
| 债券投资收益                     | 6.1.4.7.13 | 62,066.22                                |
| 资产支持证券投资收益                 |            | -                                        |
| 贵金属投资收益                    |            | -                                        |
| 衍生工具收益                     | 6.1.4.7.14 | -                                        |
| 股利收益                       | 6.1.4.7.15 | 80,817.98                                |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.1.4.7.16 | 1,127,359.69                             |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                                        |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.1.4.7.17 | 9,002.42                                 |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>775,996.27</b>                        |
| 1. 管理人报酬                   |            | 473,367.43                               |
| 2. 托管费                     |            | 78,894.63                                |
| 3. 销售服务费                   |            | -                                        |
| 4. 交易费用                    | 6.1.4.7.18 | 55,990.93                                |
| 5. 利息支出                    |            | -                                        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                                        |
| 6. 税金及附加                   |            | 945.96                                   |
| 7. 其他费用                    | 6.1.4.7.19 | 166,797.32                               |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>1,542,277.26</b>                      |
| 减：所得税费用                    |            | -                                        |



|                   |  |              |
|-------------------|--|--------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 1,542,277.26 |
|-------------------|--|--------------|

注：本基金合同生效日为 2019 年 1 月 3 日，因此无上年度可比期间。

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日 |               |                 |
|----------------------------------------|---------------------------------------|---------------|-----------------|
|                                        | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 204,415,911.33                        | 7,875,078.87  | 212,290,990.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 1,542,277.26  | 1,542,277.26    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -140,277,616.42                       | -5,661,248.78 | -145,938,865.20 |
| 其中：1.基金申购款                             | 21,858,191.50                         | 743,288.72    | 22,601,480.22   |
| 2.基金赎回款                                | -162,135,807.92                       | -6,404,537.50 | -168,540,345.42 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -             | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 64,138,294.91                         | 3,756,107.35  | 67,894,402.26   |

注：本基金合同生效日为 2019 年 1 月 3 日，因此无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

### 6.1.4 报表附注

#### 6.1.4.1 基金基本情况

国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由原国泰鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)保本期到期变更而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中

国证监会”)证监许可[2015]2559 号文《关于准予国泰鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》核准,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,原基金为契约型开放式,存续期限不定,第一个保本期自本基金基金合同生效之日(即 2015 年 12 月 30 日)起至 3 年后对应日(即 2018 年 12 月 30 日)止,如该日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一个工作日,原基金第一个保本期由重庆三峡担保集团有限公司作为保证人提供连带责任保证。如保本期到期后,原基金未能符合保本基金存续条件,则将变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”。

原基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,988,795,724.19 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1503 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,989,945,669.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,149,944.88 份基金份额。

根据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定以及原基金的基金管理人发布的《关于国泰鑫保本混合型证券投资基金保本期到期及国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效的提示性公告》,原基金第一个保本期已于 2019 年 1 月 2 日到期,自 2019 年 1 月 3 日起本基金按照《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定变更为非保本的混合型基金,即“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”,自该日起《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。原基金于基金合同失效前的基金资产净值为 212,290,990.20 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、期权等权益类金融工具,债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债

券、短期融资券、超短期融资券等), 资产支持证券, 债券回购, 银行存款, 货币市场工具等, 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 0%-95%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:  $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2019 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 3 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 3 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间 1 月 3 日(基金合同生效日)至 6 月 30 日。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包

括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金

等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。



对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 12,845,032.30          |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计             | 12,845,032.30          |

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2019年6月30日 |               |              |
|---------------|-------|-------------------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 21,712,405.94     | 23,152,938.50 | 1,440,532.56 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                 | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 22,202,337.70     | 22,046,900.00 | -155,437.70  |
|               | 银行间市场 | -                 | -             | -            |
|               | 合计    | 22,202,337.70     | 22,046,900.00 | -155,437.70  |
| 资产支持证券        |       | -                 | -             | -            |
| 基金            |       | -                 | -             | -            |
| 其他            |       | -                 | -             | -            |
| 合计            |       | 43,914,743.64     | 45,199,838.50 | 1,285,094.86 |

#### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,245.98               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 4,583.17               |
| 应收债券利息     | 558,028.06             |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |

|    |            |
|----|------------|
| 其他 | 12.15      |
| 合计 | 564,869.36 |

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 22,390.00              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 22,390.00              |

#### 6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 1,363.12               |
| 其他应付款       | -                      |
| 预提费用        | 148,756.65             |
| 合计          | 150,119.77             |

#### 6.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 204,415,911.33             | 204,415,911.33  |
| 本期申购          | 21,858,191.50              | 21,858,191.50   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -162,135,807.92            | -162,135,807.92 |
| 本期末           | 64,138,294.91              | 64,138,294.91   |

注：1.申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.原国泰鑫保本混合型证券投资基金合同失效前的基金份额为204415911.33份，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金份额。

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 基金合同生效日        | 7,348,884.77  | 526,194.10   | 7,875,078.87  |
| 本期利润           | 414,917.57    | 1,127,359.69 | 1,542,277.26  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,120,339.68 | -540,909.10  | -5,661,248.78 |
| 其中：基金申购款       | 913,524.25    | -170,235.53  | 743,288.72    |
| 基金赎回款          | -6,033,863.93 | -370,673.57  | -6,404,537.50 |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 2,643,462.66  | 1,112,644.69 | 3,756,107.35  |

#### 6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 68,046.88                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 763.44                                |
| 其他        | 81,491.62                             |
| 合计        | 150,301.94                            |

#### 6.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 11,914,940.22                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 11,417,372.70                         |
| 买卖股票差价收入   | 497,567.52                            |

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |
|----------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 216,763,691.16             |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 213,365,261.27 |
| 减：应收利息总额               | 3,336,363.67   |
| 买卖债券差价收入               | 62,066.22      |

#### 6.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 80,817.98                  |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 80,817.98                  |

#### 6.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 1,127,359.69               |
| ——股票投资                 | 1,440,532.56               |
| ——债券投资                 | -313,172.87                |
| ——资产支持证券投资             | -                          |
| ——贵金属投资                | -                          |
| ——其他                   | -                          |
| 2.衍生工具                 | -                          |
| ——权证投资                 | -                          |
| 3.其他                   | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                          |
| 合计                     | 1,127,359.69               |

#### 6.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 8,837.17                   |

|       |          |
|-------|----------|
| 转换费收入 | 165.25   |
| 合计    | 9,002.42 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不少于转出基金赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 54,690.93                             |
| 银行间市场交易费用 | 1,300.00                              |
| 合计        | 55,990.93                             |

#### 6.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019 年 1 月 3 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费     | 42,900.93                             |
| 信息披露费   | 101,211.90                            |
| 银行汇划费用  | 4,084.49                              |
| 债券账户服务费 | 18,000.00                             |
| CA 证书费  | 600.00                                |
| 合计      | 166,797.32                            |

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.1.4.9 关联方关系

##### 6.1.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

|                                        |                               |
|----------------------------------------|-------------------------------|
| 国泰基金管理有限公司                             | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构           |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)                     | 基金托管人、基金销售机构                  |
| 中国电力财务有限公司                             | 基金管理人的股东                      |
| 意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.) | 基金管理人的股东                      |
| 国泰元鑫资产管理有限公司                           | 基金管理人的控股子公司                   |
| 中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)                   | 基金管理人的控股股东                    |
| 国泰全球投资管理有限公司                           | 基金管理人的控股子公司                   |
| 申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)                   | 基金销售机构、受基金管理人的控股股东(中国建投)控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 申万宏源  | 6,968,733.00               | 15.47%       |

##### 6.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 |
| 申万宏源  | 1,004,688.77               | 1.49%        |

##### 6.1.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 6.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |       |          |        |
|-------|----------------------------|-------|----------|--------|
|       | 当期                         | 占当期佣金 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 |

|      | 佣金       | 总量的比例  |          | 金总额的比例 |
|------|----------|--------|----------|--------|
| 申万宏源 | 6,490.19 | 16.77% | 6,069.97 | 27.11% |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 473,367.43                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 213,670.27                 |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

##### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 78,894.63                  |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.1.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况



本基金本报告期末无各关联方投资本基金的情况。

#### 6.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月3日至2019年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 12,845,032.30              | 68,046.88 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.1.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报”的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.1.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| AAA    | 22,046,900.00          |
| AAA 以下 | -                      |
| 未评级    | -                      |
| 合计     | 22,046,900.00          |

### 6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见

附注 6.1.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
|------------------------|---------------|---------------|-------|---------------|---------------|
| 资产                     |               |               |       |               |               |
| 银行存款                   | 12,845,032.30 | -             | -     | -             | 12,845,032.30 |
| 结算备付金                  | 10,464,700.57 | -             | -     | -             | 10,464,700.57 |
| 存出保证金                  | 29,866.21     | -             | -     | -             | 29,866.21     |
| 交易性金融资产                | -             | 22,046,900.00 | -     | 23,152,938.50 | 45,199,838.50 |
| 应收利息                   | -             | -             | -     | 564,869.36    | 564,869.36    |
| 应收申购款                  | -             | -             | -     | 204,856.85    | 204,856.85    |
| 资产总计                   | 23,339,599.08 | 22,046,900.00 | -     | 23,922,664.71 | 69,309,163.79 |
| 负债                     |               |               |       |               |               |
| 应付赎回款                  | -             | -             | -     | 1,147,579.33  | 1,147,579.33  |
| 应付管理人报酬                | -             | -             | -     | 79,582.80     | 79,582.80     |
| 应付托管费                  | -             | -             | -     | 13,263.82     | 13,263.82     |
| 应付交易费用                 | -             | -             | -     | 22,390.00     | 22,390.00     |
| 应交税费                   | -             | -             | -     | 1,825.81      | 1,825.81      |
| 其他负债                   | -             | -             | -     | 150,119.77    | 150,119.77    |
| 负债总计                   | -             | -             | -     | 1,414,761.53  | 1,414,761.53  |
| 利率敏感度缺口                | 23,339,599.08 | 22,046,900.00 | -     | 22,507,903.18 | 67,894,402.26 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率外其他市场条件不变 |                                 |
|----|----------------|---------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                | 本期末<br>2019年6月30日               |
|    | 市场利率下降 25 个基点  | 148,052.70                      |
|    | 市场利率上升 25 个基点  | -146,547.99                     |

#### 6.1.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年6月30日 |              |
|---------------|-------------------|--------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 23,152,938.50     | 34.10        |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -            |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -            |
| 合计            | 23,152,938.50     | 34.10        |

#### 6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金转型后运作尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 23,152,938.50 元，属于第二层次的余额为 22,046,900.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 6.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：国泰鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 1 月 2 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2019 年 1 月 2 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|-------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                               |                                  |
| 银行存款            | 6.2.4.7.1  | 25,860,292.87                 | 39,309,173.80                    |
| 结算备付金           |            | 10,313,473.63                 | 10,313,473.63                    |
| 存出保证金           |            | 50,515.37                     | 50,515.37                        |
| 交易性金融资产         | 6.2.4.7.2  | 206,258,500.00                | 206,115,600.00                   |
| 其中：股票投资         |            | -                             | -                                |
| 基金投资            |            | -                             | -                                |
| 债券投资            |            | 206,258,500.00                | 206,115,600.00                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                             | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                             | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.2.4.7.3  | -                             | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.2.4.7.4  | -                             | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                             | -                                |
| 应收利息            | 6.2.4.7.5  | 3,178,599.08                  | 3,137,193.73                     |
| 应收股利            |            | -                             | -                                |
| 应收申购款           |            | -                             | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                             | -                                |
| 其他资产            | 6.2.4.7.6  | -                             | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>245,661,380.95</b>         | <b>258,925,956.53</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 1 月 2 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                               |                                  |
| 短期借款            |            | -                             | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                             | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.2.4.7.3  | -                             | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                             | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                             | -                                |
| 应付赎回款           |            | 32,830,481.03                 | 28,569,763.52                    |
| 应付管理人报酬         |            | 317,855.29                    | 302,742.30                       |



|                   |            |                       |                       |
|-------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付托管费             |            | 52,975.87             | 50,457.04             |
| 应付销售服务费           |            | -                     | -                     |
| 应付交易费用            | 6.2.4.7.7  | 2,134.64              | 2,134.64              |
| 应交税费              |            | 2,300.04              | 2,206.58              |
| 应付利息              |            | -                     | -                     |
| 应付利润              |            | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           |            | -                     | -                     |
| 其他负债              | 6.2.4.7.8  | 164,643.88            | 160,000.00            |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>33,370,390.75</b>  | <b>29,087,304.08</b>  |
| <b>所有者权益：</b>     |            | -                     | -                     |
| 实收基金              | 6.2.4.7.9  | 204,415,911.33        | 221,493,441.21        |
| 未分配利润             | 6.2.4.7.10 | 7,875,078.87          | 8,345,211.24          |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>212,290,990.20</b> | <b>229,838,652.45</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>245,661,380.95</b> | <b>258,925,956.53</b> |

注：（1）报告截止日 2019 年 1 月 2 日，基金份额净值 1.039 元，基金份额总额 204,415,911.33 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日止期间。

## 6.2.2 利润表

会计主体：国泰鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日

单位：人民币元

| 项 目              | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 1 月 2 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 6 月 30 日 |
|------------------|------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      |            | <b>184,221.17</b>                       | <b>4,560,117.02</b>                           |
| 1.利息收入           |            | 41,321.15                               | 10,738,727.11                                 |
| 其中：存款利息收入        | 6.2.4.7.11 | 2,481.10                                | 179,659.72                                    |
| 债券利息收入           |            | 38,840.05                               | 10,528,245.47                                 |
| 资产支持证券利息收入       |            | -                                       | -                                             |
| 买入返售金融资产收入       |            | -                                       | 30,821.92                                     |
| 其他利息收入           |            | -                                       | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |            | -                                       | -260,347.27                                   |
| 其中：股票投资收益        | 6.2.4.7.12 | -                                       | 3,411,390.97                                  |
| 基金投资收益           |            | -                                       | -                                             |
| 债券投资收益           | 6.2.4.7.13 | -                                       | -3,861,096.07                                 |

|                            |            |                   |                     |
|----------------------------|------------|-------------------|---------------------|
| 资产支持证券投资收益                 |            | -                 | -                   |
| 贵金属投资收益                    |            | -                 | -                   |
| 衍生工具收益                     | 6.2.4.7.14 | -                 | -                   |
| 股利收益                       | 6.2.4.7.15 | -                 | 189,357.83          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.2.4.7.16 | 142,900.00        | -5,919,986.59       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                 | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.2.4.7.17 | 0.02              | 1,723.77            |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>22,484.90</b>  | <b>4,884,190.58</b> |
| 1. 管理人报酬                   |            | 15,112.99         | 3,611,018.81        |
| 2. 托管费                     |            | 2,518.83          | 601,836.46          |
| 3. 销售服务费                   |            | -                 | -                   |
| 4. 交易费用                    | 6.2.4.7.18 | -                 | 87,377.69           |
| 5. 利息支出                    |            | -                 | 327,695.96          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                 | 327,695.96          |
| 6. 税金及附加                   |            | 9.26              | 29,857.65           |
| 7. 其他费用                    | 6.2.4.7.19 | 4,843.82          | 226,404.01          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>161,736.27</b> | <b>-324,073.56</b>  |
| 减：所得税费用                    |            | -                 | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>161,736.27</b> | <b>-324,073.56</b>  |

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日 |              |                |
|-----------------------------------|--------------------------------------|--------------|----------------|
|                                   | 实收基金                                 | 未分配利润        | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 221,493,441.21                       | 8,345,211.24 | 229,838,652.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                    | 161,736.27   | 161,736.27     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -17,077,529.88                       | -631,868.64  | -17,709,398.52 |

|                                        |                                            |                |                 |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|-----------------|
| 其中：1.基金申购款                             | -                                          | -              | -               |
| 2.基金赎回款                                | -17,077,529.88                             | -631,868.64    | -17,709,398.52  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 204,415,911.33                             | 7,875,078.87   | 212,290,990.20  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                |                 |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 919,841,083.85                             | 30,277,777.12  | 950,118,860.97  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -324,073.56    | -324,073.56     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -562,618,271.83                            | -20,335,552.03 | -582,953,823.86 |
| 其中：1.基金申购款                             | 385,147.86                                 | 14,104.73      | 399,252.59      |
| 2.基金赎回款                                | -563,003,419.69                            | -20,349,656.76 | -583,353,076.45 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 357,222,812.02                             | 9,618,151.53   | 366,840,963.55  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

国泰鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2559 号文《关于准予国泰鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰鑫保本混合型证券投资

基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，第一个保本期自本基金基金合同生效之日(即 2015 年 12 月 30 日)起至 3 年后对应日(即 2018 年 12 月 30 日)止，如该日为非工作日，则保本期到期日顺延至下一个工作日，本基金第一个保本期由重庆三峡担保集团有限公司作为保证人提供连带责任保证。第一个保本期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一保本期。

本基金自 2015 年 12 月 14 日至 2015 年 12 月 28 日止期间向社会公开募集，不包括认购资金利息共募集人民币 2,988,795,724.19 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1503 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,989,945,669.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,149,944.88 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金的保本周期一般每三年为一个周期。本基金第一个保本期的保本额为基金份额持有人认购并持有当期保本期到期的基金份额的投资金额。在第一个保本期到期日，如本基金的基金份额持有人在本基金募集期内认购并持有到当期保本期到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到当期保本期到期的基金份额在当期保本期内的累计分红金额之和低于其认购并持有到当期保本期到期的基金份额的投资金额，则基金管理人应补足该差额，并在保本期到期日后 20 个工作日内将该差额支付给基金份额持有人，保证人对此提供连带责任保证。

本基金第一个保本期后的各保本期到期日，如本基金的基金份额持有人有在折算日登记在册的并持有到当期保本期到期的基金份额的可赎回金额加上其在折算日登记在册的并持有到当期保本期到期的基金份额在当期保本期内的累计分红金额之和低于其在折算日登记在册的并持有到当期保本期到期的基金份额的投资金额，则由基金管理人、保证人或保证义务人根据当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同的约定将该差额支付给基金份额持有人。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的，赎回或转换转出部分不适用保本条款；基金份额持有人在保本期申购或转换转入的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有

关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内上市交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、期权等权益类金融工具,债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等),资产支持证券,债券回购,银行存款,货币市场工具等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产比例不高于基金资产的 40%;债券、货币市场工具等固定收益类资产比例不低于基金资产的 60%,其中基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2019 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》,本基金将于保本期届满日下一日转型为国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金,因此本基金财务报表仍以持续经营假设为基础编制。

#### 6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 1 月 2 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.2.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.2.4.6 税项

[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2019 年 1 月 2 日 |
|----------------|-----------------------|
| 活期存款           | 25,860,292.87         |
| 定期存款           | -                     |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                     |
| 存款期限 1-3 个月    | -                     |
| 存款期限 3 个月以上    | -                     |
| 其他存款           | -                     |
| 合计             | 25,860,292.87         |

##### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2019年1月2日 |                |             |
|---------------|-------|------------------|----------------|-------------|
|               |       | 成本               | 公允价值           | 公允价值变动      |
| 股票            |       | -                | -              | -           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -              | -           |
| 债券            | 交易所市场 | 51,027,874.83    | 50,880,500.00  | -147,374.83 |
|               | 银行间市场 | 155,072,890.00   | 155,378,000.00 | 305,110.00  |
|               | 合计    | 206,100,764.83   | 206,258,500.00 | 157,735.17  |
| 资产支持证券        |       | -                | -              | -           |
| 基金            |       | -                | -              | -           |
| 其他            |       | -                | -              | -           |
| 合计            |       | 206,100,764.83   | 206,258,500.00 | 157,735.17  |

##### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年1月2日 |
|------------|------------------|
| 应收活期存款利息   | 13,560.44        |
| 应收定期存款利息   | -                |
| 应收其他存款利息   | -                |
| 应收结算备付金利息  | 5,875.50         |
| 应收债券利息     | 3,159,134.24     |
| 应收资产支持证券利息 | -                |
| 应收买入返售证券利息 | -                |
| 应收申购款利息    | 1.66             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                |
| 其他         | 27.24            |
| 合计         | 3,178,599.08     |

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年1月2日 |
|-------------|------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,909.64         |
| 银行间市场应付交易费用 | 225.00           |
| 合计          | 2,134.64         |

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年1月2日 |
|-------------|------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                |



|       |            |
|-------|------------|
| 应付赎回费 | 0.06       |
| 其他应付款 | -          |
| 预提费用  | 164,643.82 |
| 合计    | 164,643.88 |

#### 6.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |                |
|---------------|---------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                   | 账面金额           |
| 上年度末          | 221,493,441.21            | 221,493,441.21 |
| 本期申购          | -                         | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -17,077,529.88            | -17,077,529.88 |
| 本期末           | 204,415,911.33            | 204,415,911.33 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|------------|--------------|
| 上年度末           | 7,934,247.96 | 410,963.28 | 8,345,211.24 |
| 本期利润           | 18,836.27    | 142,900.00 | 161,736.27   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -604,199.46  | -27,669.18 | -631,868.64  |
| 其中：基金申购款       | -            | -          | -            |
| 基金赎回款          | -604,199.46  | -27,669.18 | -631,868.64  |
| 本期已分配利润        | -            | -          | -            |
| 本期末            | 7,348,884.77 | 526,194.10 | 7,875,078.87 |

#### 6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |
|-----------|---------------------------|
|           |                           |
| 活期存款利息收入  | 1,572.36                  |
| 定期存款利息收入  | -                         |
| 其他存款利息收入  | -                         |
| 结算备付金利息收入 | -                         |
| 其他        | 908.74                    |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 2,481.10 |
|----|----------|

#### 6.2.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.2.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.2.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.2.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |
|------------------------|---------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 142,900.00                |
| ——股票投资                 | -                         |
| ——债券投资                 | 142,900.00                |
| ——资产支持证券投资             | -                         |
| ——贵金属投资                | -                         |
| 2.衍生工具                 | -                         |
| ——权证投资                 | -                         |
| 3.其他                   | -                         |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                         |
| 合计                     | 142,900.00                |

#### 6.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |
|---------|---------------------------|
| 基金赎回费收入 | 0.02                      |
| 合计      | 0.02                      |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.2.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |
|---------|---------------------------|
| 审计费     | 3,000.00                  |
| 信息披露费   | 1,643.82                  |
| 银行汇划费用  | 200.00                    |
| 债券账户服务费 | -                         |
| 合计      | 4,843.82                  |

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

国泰鑫保本混合型证券投资基金第一个保本期于 2019 年 1 月 2 日到期。自 2019 年 1 月 3 日起该基金按照《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定变更为非保本的混合型基金，即“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”。自 2019 年 1 月 3 日起变更后的基金合同《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

#### 6.2.4.9 关联方关系

##### 6.2.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系                |
|----------------------|------------------------|
| 国泰基金管理有限公司           | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构    |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)   | 基金托管人、基金销售机构           |
| 申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”) | 受基金管理人的控股股东（中国建投）控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.2.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.2.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.2.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.2.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |                | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                |
|-------|---------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                      | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 申万宏源  | -                         | -              | 40,500,000.00                   | 2.41%          |

#### 6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 15,112.99                 | 3,611,018.81                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,794.26                  | 1,162,944.21                    |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

##### 6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月 |
|----|-------------------------|------------------------------|
|----|-------------------------|------------------------------|

|                | 2日       | 30日        |
|----------------|----------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,518.83 | 601,836.46 |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.2% /当年天数。

#### 6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)业务。

#### 6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.2.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无各关联方投资本基金的情况。

#### 6.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年1月2日 |          | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |           |
|-------|---------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                      | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 25,860,292.87             | 1,572.36 | 889,554.32                      | 85,671.88 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本基金于 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 2 日未进行利润分配。

#### 6.2.4.12 期末（2019 年 1 月 2 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于保本型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金和一般混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.2.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年1月2日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|------------------|---------------------|
| AAA    | 30,866,500.00    | 30,828,600.00       |
| AAA 以下 | -                | -                   |
| 未评级    | 20,014,000.00    | 20,016,000.00       |
| 合计     | 50,880,500.00    | 50,844,600.00       |

注：本基金持有的未评级债券包括国债。

#### 6.2.4.13.2.2 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年1月2日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|------------------|---------------------|
| AAA    | 155,378,000.00   | 155,271,000.00      |
| AAA 以下 | -                | -                   |
| 未评级    | -                | -                   |
| 合计     | 155,378,000.00   | 155,271,000.00      |

#### 6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 1 月 2 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券一部分在证券交易所交易，其余亦可在银行间市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.2.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动



性情况良好。

#### 6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019 年 1 月 2 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计             |
|-----------------------|----------------|-------|-------|---------------|----------------|
| 资产                    |                |       |       |               |                |
| 银行存款                  | 25,860,292.87  | -     | -     | -             | 25,860,292.87  |
| 结算备付金                 | 10,313,473.63  | -     | -     | -             | 10,313,473.63  |
| 存出保证金                 | 50,515.37      | -     | -     | -             | 50,515.37      |
| 交易性金融资产               | 206,258,500.00 | -     | -     | -             | 206,258,500.00 |
| 应收利息                  | -              | -     | -     | 3,178,599.08  | 3,178,599.08   |
| 资产总计                  | 242,482,781.87 | -     | -     | 3,178,599.08  | 245,661,380.95 |
| 负债                    |                |       |       |               |                |
| 应付赎回款                 | -              | -     | -     | 32,830,481.03 | 32,830,481.03  |
| 应付管理人报酬               | -              | -     | -     | 317,855.29    | 317,855.29     |
| 应付托管费                 | -              | -     | -     | 52,975.87     | 52,975.87      |
| 应付交易费用                | -              | -     | -     | 2,134.64      | 2,134.64       |

|                          |                |       |       |                |                |
|--------------------------|----------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 应交税费                     | -              | -     | -     | 2,300.04       | 2,300.04       |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 164,643.88     | 164,643.88     |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 33,370,390.75  | 33,370,390.75  |
| 利率敏感度缺口                  | 242,482,781.87 | -     | -     | -30,191,791.67 | 212,290,990.20 |
| 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                       |                |       |       |                |                |
| 银行存款                     | 39,309,173.80  | -     | -     | -              | 39,309,173.80  |
| 结算备付金                    | 10,313,473.63  | -     | -     | -              | 10,313,473.63  |
| 存出保证金                    | 50,515.37      | -     | -     | -              | 50,515.37      |
| 交易性金融资产                  | 206,115,600.00 | -     | -     | -              | 206,115,600.00 |
| 应收利息                     | -              | -     | -     | 3,137,193.73   | 3,137,193.73   |
| 资产总计                     | 255,788,762.80 | -     | -     | 3,137,193.73   | 258,925,956.53 |
| 负债                       |                |       |       |                |                |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 28,569,763.52  | 28,569,763.52  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 302,742.30     | 302,742.30     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 50,457.04      | 50,457.04      |
| 应付交易费用                   | -              | -     | -     | 2,134.64       | 2,134.64       |
| 应交税费                     | -              | -     | -     | 2,206.58       | 2,206.58       |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 160,000.00     | 160,000.00     |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 29,087,304.08  | 29,087,304.08  |
| 利率敏感度缺口                  | 255,788,762.80 | -     | -     | -25,950,110.35 | 229,838,652.45 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                |                             |
|----|----------------|-----------------------------|
| 假设 | 除市场利率外其他市场条件不变 |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

|  |               | 本期末<br>2019 年 1 月 2 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--|---------------|-----------------------|--------------------------|
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 279,955.05            | 283,457.27               |
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -278,592.70           | -282,075.88              |

#### 6.2.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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，即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基金合同的收益，以实现保本和增值的目标。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。

本基金投资组合中股票、权证等权益类资产不高于基金资产的 40%，债券、货币市场工具等固定收益类资产不低于基金资产的 60%，其中基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制

##### 6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2019 年 1 月 2 日，本基金未持有交易性权益类投资（2018 年 12 月 31 日：无），因此无其他价格风险敞口（2018 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 1 月 2 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 1 月 2 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 206,258,500.00 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：无属于第一层次的余额，第二层次 206,115,600.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 1 月 2 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月3日-2019年6月30日)

#### 7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 23,152,938.50 | 33.41         |
|    | 其中：股票             | 23,152,938.50 | 33.41         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 22,046,900.00 | 31.81         |
|    | 其中：债券             | 22,046,900.00 | 31.81         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 23,309,732.87 | 33.63         |
| 8  | 其他各项资产            | 799,592.42    | 1.15          |
| 9  | 合计                | 69,309,163.79 | 100.00        |

#### 7.1.2 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              | 960,448.00    | 1.41          |
| C  | 制造业              | 10,798,917.00 | 15.91         |
| 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          | -             | -     |
| 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 | 1,399,456.50  | 2.06  |
| J | 金融业             | 9,258,232.00  | 13.64 |
| K | 房地产业            | 735,885.00    | 1.08  |
| 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              | 23,152,938.50 | 34.10 |

### 7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 300702 | 天宇股份 | 60,000  | 2,162,400.00 | 3.18             |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 13,200  | 1,169,652.00 | 1.72             |
| 3  | 601688 | 华泰证券 | 51,400  | 1,147,248.00 | 1.69             |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 33,400  | 1,115,894.00 | 1.64             |
| 5  | 601939 | 建设银行 | 143,300 | 1,066,152.00 | 1.57             |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 75,900  | 1,045,902.00 | 1.54             |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 177,100 | 1,043,119.00 | 1.54             |
| 8  | 000063 | 中兴通讯 | 30,900  | 1,005,177.00 | 1.48             |
| 9  | 603520 | 司太立  | 42,700  | 986,370.00   | 1.45             |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 2,900   | 980,200.00   | 1.44             |
| 11 | 000895 | 双汇发展 | 38,800  | 965,732.00   | 1.42             |
| 12 | 601857 | 中国石油 | 139,600 | 960,448.00   | 1.41             |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 38,300  | 911,923.00   | 1.34             |
| 14 | 000043 | 中航善达 | 62,100  | 735,885.00   | 1.08             |
| 15 | 300450 | 先导智能 | 21,900  | 735,840.00   | 1.08             |
| 16 | 603501 | 韦尔股份 | 13,300  | 730,303.00   | 1.08             |
| 17 | 300383 | 光环新网 | 43,200  | 724,464.00   | 1.07             |
| 18 | 603369 | 今世缘  | 25,800  | 719,562.00   | 1.06             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 19 | 000776 | 广发证券 | 49,600 | 681,504.00 | 1.00 |
| 20 | 300451 | 创业慧康 | 45,150 | 674,992.50 | 0.99 |
| 21 | 002142 | 宁波银行 | 27,800 | 673,872.00 | 0.99 |
| 22 | 002304 | 洋河股份 | 5,500  | 668,580.00 | 0.98 |
| 23 | 601128 | 常熟银行 | 71,700 | 553,524.00 | 0.82 |
| 24 | 600036 | 招商银行 | 14,900 | 536,102.00 | 0.79 |
| 25 | 601336 | 新华保险 | 7,800  | 429,234.00 | 0.63 |
| 26 | 000858 | 五粮液  | 2,700  | 318,465.00 | 0.47 |
| 27 | 002832 | 比音勒芬 | 5,700  | 271,719.00 | 0.40 |
| 28 | 603515 | 欧普照明 | 4,300  | 138,675.00 | 0.20 |

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 300702 | 天宇股份 | 1,971,884.00 | 2.90            |
| 2  | 000895 | 双汇发展 | 1,555,398.04 | 2.29            |
| 3  | 601688 | 华泰证券 | 1,293,541.00 | 1.91            |
| 4  | 600271 | 航天信息 | 1,112,116.00 | 1.64            |
| 5  | 601939 | 建设银行 | 999,891.00   | 1.47            |
| 6  | 601857 | 中国石油 | 999,536.00   | 1.47            |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 997,945.00   | 1.47            |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 997,931.00   | 1.47            |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 996,840.00   | 1.47            |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 996,600.00   | 1.47            |
| 11 | 000063 | 中兴通讯 | 975,680.00   | 1.44            |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 968,666.00   | 1.43            |
| 13 | 300383 | 光环新网 | 965,652.00   | 1.42            |
| 14 | 000002 | 万科 A | 959,681.00   | 1.41            |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 958,617.00   | 1.41            |
| 16 | 603520 | 司太立  | 889,355.00   | 1.31            |
| 17 | 000661 | 长春高新 | 869,728.00   | 1.28            |
| 18 | 603883 | 老百姓  | 727,003.00   | 1.07            |
| 19 | 603501 | 韦尔股份 | 681,609.00   | 1.00            |
| 20 | 000776 | 广发证券 | 664,556.00   | 0.98            |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 600271 | 航天信息 | 1,031,202.00 | 1.52            |
| 2  | 000002 | 万科 A | 956,760.00   | 1.41            |
| 3  | 603883 | 老百姓  | 810,751.00   | 1.19            |
| 4  | 603939 | 益丰药房 | 806,149.00   | 1.19            |
| 5  | 603019 | 中科曙光 | 654,773.00   | 0.96            |
| 6  | 002607 | 中公教育 | 638,543.00   | 0.94            |
| 7  | 600588 | 用友网络 | 583,093.41   | 0.86            |
| 8  | 000895 | 双汇发展 | 568,022.10   | 0.84            |
| 9  | 600036 | 招商银行 | 522,965.00   | 0.77            |
| 10 | 601186 | 中国铁建 | 450,993.00   | 0.66            |
| 11 | 002456 | 欧菲光  | 386,693.00   | 0.57            |
| 12 | 300595 | 欧普康视 | 382,764.00   | 0.56            |
| 13 | 000961 | 中南建设 | 381,808.00   | 0.56            |
| 14 | 002230 | 科大讯飞 | 379,771.58   | 0.56            |
| 15 | 300010 | 立思辰  | 372,838.00   | 0.55            |
| 16 | 002407 | 多氟多  | 340,812.00   | 0.50            |
| 17 | 600004 | 白云机场 | 321,044.00   | 0.47            |
| 18 | 601336 | 新华保险 | 241,295.00   | 0.36            |
| 19 | 300037 | 新宙邦  | 241,067.00   | 0.36            |
| 20 | 002709 | 天赐材料 | 238,535.00   | 0.35            |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 33,129,778.64 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 11,914,940.22 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -    | -             |
| 2  | 央行票据      | -    | -             |
| 3  | 金融债券      | -    | -             |
|    | 其中：政策性金融债 | -    | -             |



|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
| 4  | 企业债券      | 22,046,900.00 | 32.47 |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | -             | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -     |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 22,046,900.00 | 32.47 |

#### 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 143761 | 18 电投 04 | 50,000 | 5,081,500.00 | 7.48         |
| 2  | 143746 | 18 光明 02 | 50,000 | 5,060,000.00 | 7.45         |
| 3  | 136502 | 16 穗控 01 | 50,000 | 4,966,000.00 | 7.31         |
| 4  | 136755 | 16 兵装 04 | 40,000 | 3,966,400.00 | 5.84         |
| 5  | 136739 | 16 通用 02 | 30,000 | 2,973,000.00 | 4.38         |

#### 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

#### 7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“建设银行”公告其分行违规外）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。

根据建设银行 2018 年 7 月到 2019 年 6 月期间发布的公告，建设银行滨州、商丘、济南、随州、广西、沈阳、重庆、十堰、海宁、大连等分支机构因票据业务贷前调查、贸易背景真实性审查不尽职、

违规发放和管理固定资产贷款严重违反审慎经营规则、未按规定进行贷款资金支付管理与控制、贷后管理不到位导致资金被挪用、员工违规代客保管等行为，收到当地银保监会责令改正、罚款、警告等公开处罚。

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。

7.1.12.2 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。

### 7.1.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 29,866.21  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 564,869.36 |
| 5  | 应收申购款   | 204,856.85 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 799,592.42 |

### 7.1.12.4 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。

### 7.1.12.5 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。

## 7.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

（报告期：2019年1月1日-2019年1月2日）

### 7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|----|--------------|
| 1  | 权益投资  | -  | -            |
|    | 其中：股票 | -  | -            |
| 2  | 基金投资  | -  | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 固定收益投资            | 206,258,500.00 | 83.96  |
|   | 其中：债券             | 206,258,500.00 | 83.96  |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 36,173,766.50  | 14.73  |
| 8 | 其他各项资产            | 3,229,114.45   | 1.31   |
| 9 | 合计                | 245,661,380.95 | 100.00 |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

## 7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 20,014,000.00 | 9.43         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 30,866,500.00 | 14.54        |

|    |         |                |       |
|----|---------|----------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券 | -              | -     |
| 6  | 中期票据    | -              | -     |
| 7  | 可转债     | -              | -     |
| 8  | 同业存单    | 155,378,000.00 | 73.19 |
| 9  | 其他      | -              | -     |
| 10 | 合计      | 206,258,500.00 | 97.16 |

## 7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 111809221 | 18 浦发银行 CD221 | 500,000 | 48,715,000.00 | 22.95        |
| 2  | 111810337 | 18 兴业银行 CD337 | 500,000 | 48,295,000.00 | 22.75        |
| 3  | 111815583 | 18 民生银行 CD583 | 300,000 | 29,277,000.00 | 13.79        |
| 4  | 111815381 | 18 民生银行 CD381 | 300,000 | 29,091,000.00 | 13.70        |
| 5  | 019585    | 18 国债 03      | 200,000 | 20,014,000.00 | 9.43         |

## 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

## 7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“兴业银行、浦发银行、民生银行”公告其分行违规外）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。

根据兴业银行 2018 年 7 月到 2019 年 6 月期间发布的公告，兴业银行南宁、武汉、北京、大连、广

州、襄阳、烟台等下属分支行由于授信调查不全面、未能有效识别反映集团客户授信集中风险、违规发放委托贷款、流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则、授信不审慎造成信用风险暴露等行为分别收到当地银保监局罚款、警告、责令改正等监管处罚。

浦发银行多家分、支行，因信息披露虚假或严重误导性陈述等原因被当地银保监处以警告及最高 200 万元的罚款，部分机构被责令整改。

民生银行多家分、支行因贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金；因以贷收贷，掩盖资产真实质量；以贷转存，虚增存贷款规模；微联保授信业务贷前调查不尽职；信息披露虚假或严重误导性陈述等原因被央行、银保监处以警告及最高 220 万元的罚款或禁止从业处分。2018 年 12 月 7 日，因贷款业务严重违反审慎经营规则，被银保监会罚款 200 万元，因内控管理严重违反审慎经营规则、同业投资违规接受担保、同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资、本行理财产品之间风险隔离不到位、个人理财资金违规投资、票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用、为非保本理财产品提供保本承诺，被银保监会罚款 3160 万元。2019 年 4 月 4 日，民生银行青岛分行因违法违规发放贷款，被银保监处以没收违法所得 356.30 万元，并处违法所得 1 倍罚款 356.30 万元，罚没合计 712.60 万元的行政处罚决定。2019 年 6 月 18 日，民生银行太原分行因存在贷款用途不合规，理财业务不规范，不按要求报送报表报告等资料行为，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条、第四十八条规定，中国民生银行股份有限公司太原分行被银保监会山西银保监局责令改正，并罚款 480 万元，副行长夏斌、金融市场部总经理傅胜坤被给予“警告”处分。

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。

7.2.12.2 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。

### 7.2.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 50,515.37    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,178,599.08 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |

|   |      |              |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | -            |
| 8 | 其他   | -            |
| 9 | 合计   | 3,229,114.45 |

#### 7.2.12.4 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。

#### 7.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2019年1月3日-2019年6月30日)

##### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构      |        |               |        |
|----------|-----------|------------|--------|---------------|--------|
|          |           | 机构投资者      |        | 个人投资者         |        |
|          |           | 持有份额       | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 1,090    | 58,842.47 | 997,064.95 | 1.55%  | 63,141,229.96 | 98.45% |

##### 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00      | 0.00%    |

##### 8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

#### 8.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

(报告期: 2019年1月1日-2019年1月2日)

### 8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构     |        |                |        |
|----------|------------|-----------|--------|----------------|--------|
|          |            | 机构投资者     |        | 个人投资者          |        |
|          |            | 持有份额      | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 1,861    | 109,841.97 | 53,000.00 | 0.03%  | 204,362,911.33 | 99.97% |

### 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00      | 0.00%    |

### 8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

### 9.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2019年1月3日-2019年6月30日）

单位：份

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 1 月 3 日）基金份额总额 | 204,415,911.33 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额         | 21,858,191.50  |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额       | 162,135,807.92 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额        | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 64,138,294.91  |

### 9.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

（报告期：2019年1月1日-2019年1月2日）

单位：份

|                              |                  |
|------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 12 月 30 日）基金份 | 2,989,945,669.07 |
|------------------------------|------------------|

|               |                |
|---------------|----------------|
| 额总额           |                |
| 本报告期期初基金份额总额  | 221,493,441.21 |
| 本报告期基金总申购份额   | -              |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 17,077,529.88  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 204,415,911.33 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2019 年 3 月 30 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第十七次会议审议通过，聘任刘国华女士担任本基金管理人督察长，李永梅女士不再担任督察长，转任本基金管理人副总经理；

2019 年 6 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第二十一次会议审议通过，聘任倪莹女士担任本基金管理人首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金第一个保本期到期，到期后不再符合保本基金存续条件，按照基金合同约定变更为非保本的混合型基金，即“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”。基金投资策略相应改变，详见基金合同。修订后的投资策略也可参阅本报告 2.2 基金产品说明。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。



## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月3日-2019年6月30日)

#### 10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国金证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投 | 3      | 13,084,599.60 | 29.05%       | 11,486.71 | 29.68%     | -  |
| 银河证券 | 1      | 8,002,268.13  | 17.77%       | 7,452.57  | 19.25%     | -  |
| 申万宏源 | 1      | 6,968,733.00  | 15.47%       | 6,490.19  | 16.77%     | -  |
| 长江证券 | 1      | 6,966,187.04  | 15.47%       | 5,094.06  | 13.16%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 2,995,767.00  | 6.65%        | 2,191.37  | 5.66%      | -  |
| 瑞银证券 | 1      | 2,719,981.10  | 6.04%        | 2,587.54  | 6.69%      | -  |
| 中金证券 | 2      | 2,195,797.41  | 4.87%        | 1,605.09  | 4.15%      | -  |
| 中信证券 | 1      | 1,272,497.00  | 2.82%        | 1,184.80  | 3.06%      | -  |
| 东方证券 | 1      | 604,700.58    | 1.34%        | 442.21    | 1.14%      | -  |
| 中投证券 | 1      | 234,188.00    | 0.52%        | 171.26    | 0.44%      | -  |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

### 10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国金证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |
| 安信证券 | 29,994,080.27 | 44.47%       | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投 | 29,372,834.14 | 43.54%       | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源 | 1,004,688.77  | 1.49%        | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券 | 63,442.70     | 0.09%        | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |
| 瑞银证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中金证券 | 7,005,581.69  | 10.39%       | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | 14,690.00     | 0.02%        | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中投证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |

### 10.7.2 国泰鑫保本混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年1月2日)

#### 10.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 瑞银证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中金证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中投证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

#### 10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 安信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 瑞银证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中金证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中投证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

#### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项               | 法定披露方式     | 法定披露日期     |
|----|--------------------|------------|------------|
| 1  | 关于国泰鑫保本混合型证券投资基金保本 | 《中国证券报》、《上 | 2019-01-03 |

|   |                                      |                               |            |
|---|--------------------------------------|-------------------------------|------------|
|   | 期到期及国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效的提示性公告 | 海证券报》、《证券时报》                  |            |
| 2 | 关于国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金开通定期定额投资业务的公告  | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2019-01-03 |
| 3 | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019-03-30 |
| 4 | 国泰基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告               | 《中国证券报》                       | 2019-04-26 |
| 5 | 国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告                 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019-06-01 |
| 6 | 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告         | 《上海证券报》                       | 2019-06-01 |
| 7 | 国泰基金管理有限公司关于设立深圳市分公司的公告              | 《中国证券报》                       | 2019-06-19 |
| 8 | 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019-06-22 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,“保本到期时,若本基金不符合本基金存续条件,则本基金将按基金合同的约定,变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为‘国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金’”。本基金第一个保本到期后不再符合本基金存续条件,本基金按照《基金合同》的约定变更为非保本的混合型基金,即“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”。变更后基金合同、托管协议和招募说明书分别修订为《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,调整的内容包括但不限于保留并适用《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》关于变更后的国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准以及基金费率等条款的约定,并根据现行有效的法律法规规定,在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对基金合同的其他条款进行了修订。变更后的基金合同、托管协议自 2019 年 1 月 3 日起生效,原《国泰鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。本基金变更后,基金名称变更为“国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金”,基金简称变更为“国泰鑫策略价值灵活配置混合”,基金代码仍为“002197”。具体可查阅本基金管理人于 2018 年 12 月 22 日披露的《关于国泰鑫保本混合

型证券投资基金保本期到期处理规则及变更为国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的公告》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰鑫保本混合型证券投资基金注册的批复
- 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

### 12.2 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。

### 12.3 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

二〇一九年八月二十八日