

国泰金马稳健回报证券投资基金

2018年度报告摘要

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十一日

§ 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。本基金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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年3月27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基金的招股说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本基金报告期2018年1月1日至2018年12月31日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰金马稳健回报证券投资基金
基金代码	020006
交易代码	020006
基金合同生效日	2004年6月18日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金份额净值公告索引	1.00/0.001/0.0001
基金定期报告披露日期	不定期

2.2 基金产品概况

投资目标 本基金通过股票、债券资产的科学配置，精选适合作长期持有的绩优品种，实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金将通过深入研究宏观经济、政策环境、市场利率、资金面、估值水平、行业景气度等，结合对股票市场的判断，精选具有长期投资价值的品种进行配置。

业绩比较基准 上证国债指数×40%+上证综合指数×40%+(上证综合指数-上证国债指数)×20%

风险收益特征 本基金属于中低风险收益的基金品种，基金的预期收益高于货币基金，风险程度低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	李华明	田晋
联系电话	021-31010000转8	010-67056000
电子邮箱	xunxup@gtufund.com	tianjing@ccb.com
客户服务电话	1(021)31000000,400-888-0888	010-67056000
传真	021-31010100	010-66279883

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网址: http://www.gtufund.com

基金定期报告备置地点: 上海市徐汇区宜山路1600号德基大厦9层-10层及基金托管人办公地址。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

	2018年度	2017年度	2016年度
本期初所有者权益	16,000,998.01	174,147,230.19	33,449,300.07
本期净利潤	-425,070,092.00	506,769,003.02	-16,426,230.00
本期平均净资产收益率	-0.2730%	0.3081%	-0.0307%
本期基金分红折合每份额	-24.18%	30.95%	-0.02%

1.2 期末可供分配基金份额余额 2018年末 2016年末

期初可供分配基金份额余额 0.0322 0.0747 0.0801

本期末可供分配基金份额 1,289,663,201.03 1,597,893,666.06 1,466,016,699.66

本期末基金总份额 0.7631 1.368 0.0357

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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位:人民币元

	2018年度	2017年度	2016年度
阶段	份额增长率为10.00%的业绩比较基准	份额增长率为10.00%的业绩比较基准	份额增长率为10.00%的业绩比较基准
过去一个月	-16.07% -0.94%	-6.38% 0.02%	-0.95% 1.00%
过去二个月	-20.21% 1.74%	-7.10% 0.02%	-16.30% 0.02%
过去一年	-24.18% 1.67%	-13.07% 0.07%	-10.21% 0.05%
过去五年	5.16% 1.60%	-0.71% 0.21%	21.89% 0.74%
过去十年	27.42% 1.63%	23.33% 0.03%	4.10% 0.72%
自基金合同生效以来	387.46% 1.62%	308.00% 0.08%	169.62% 0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金马稳健回报证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰金马稳健回报证券投资基金

自基金合同生效以来份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.4 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰金马稳健回报证券投资基金

自基金合同生效以来份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.5 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.6 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰金马稳健回报证券投资基金

自基金合同生效以来份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.7 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.8 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.9 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.10 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.11 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.12 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.13 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.14 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.15 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.16 国泰金马稳健回报证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

(2004年6月18日至2018年12月31日)

注:本基金的合同生效日为 2004 年 6 月 18 日。本基金在三个建仓期内,各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.1