

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:二〇一九年七月十八日

§ 1 提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金的财务资料未经审计。

报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰金马稳健回报证券投资基金
基金主代码	020005
交易代码	020005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月18日
报告期基金份额总额	1,175,211,024.07份
投资目标	本基金将综合运用多种投资策略，在有效控制风险的前提下，通过不同周期的GDP增长、债券相关指数、股票、货币等资产的配置，追求基金资产的长期稳定增值，同时兼顾大额申购和赎回时的流动性，净值表现和资产组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
投资策略	本基金将综合运用多种投资策略，在有效控制风险的前提下，通过不同周期的GDP增长、债券相关指数、股票、货币等资产的配置，追求基金资产的长期稳定增值，同时兼顾大额申购和赎回时的流动性，净值表现和资产组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金业绩比较基准	沪深300指数*60%+上证国债指数*40%
风险收益特征	本基金属于中等风险收益的产品，基金的预期收益高于货币市场基金，但低于股票基金，风险收益特征介于股票基金和货币市场基金之间，适合风险承受能力中等的投资者。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	93,392,312.43
2.本期利润	97,004,006.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0728
4.期末基金份额净值	1,299,992,076.64
5.期末可供分配基金份额利润	1.106

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；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本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或损失将低于前列数字。

③基金净值表现

④本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长 率	业绩比较 基准收益率	净值增长 率	业绩比较 基准收益率	净值增长 率	业绩比较 基准收益率
①	1.81%	1.72%	-2.02%	0.85%	10.13%	0.87%
②	1.26%	0.23%	-0.09%	0.11%	-0.27%	0.12%

⑤2.22基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本基金报告期内，基金与基金管理人所管理的其他投资组合未发生大幅同日向交易。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。

注:①此处的任职日期和离任日期指公司决定生效之日起，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离任日期为本基金管理人对本报告期内基金运作情况的说明。

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。

③基金管理人对报告期内本基金运作遵照诚实信用、公平交易的原则，未发现存在利益输送、不公平交易、佣金分配等方面的问题，未对旗下管理的其他基金以及本公司管理的其他投资基金公平对待。

④基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑤基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑥基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑦基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑧基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑨基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑩基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑪基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑫基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑬基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑭基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑮基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑯基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑰基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑱基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑲基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

⑳基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉑基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉒基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉓基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉔基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉕基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉖基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉗基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉘基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉙基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉚基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉛基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉜基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉝基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉞基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉟基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。

㉟基金管理人对报告期内基金运作情况的说明。