国泰润泰纯债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

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。

基金托管人交通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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰润泰纯债债券
基金主代码	003457
交易代码	003457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月1日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,210,064,517.93份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在注重风险和流动性管理的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握,基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪,灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易策略等多种投资策略,构建债券资产组合,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,动态的对债券投资组合进行调整。 1.久期策略 本基金将基于对宏观经济政策的分析,积极的预测未来利率变化趋势,并根据预测确定相应的久期目标,调整债券组合的久期配置,以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时,本基金将适当降低组合久期;而预期市场利率将下降时,则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中,本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上,根据债券市场收益率曲线的当前形态,通过合理假设下的情景分析和压力测试,最后确定最优的债券组合久期。 2.收益率曲线策略 在组合的久期配置确定以后,本基金将通过对收益率曲线的研究,分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化,采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。 3.类属配置策略 本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 4.利率品种策略 本基金对国债、央行票据等利率品种的投资,是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上,运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测,深入分析利率品种的收益和风险,并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后,本基金对债券的期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,选择合适的期限结构的配置策略,在合理控制风险的前提下,综合考虑组合的流动性,决定投资品种。 5.信用债策略 本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势,确定信用债券的配置。 6.回购套利策略 回购套利策略也是本基金重要的投资策略之一,把信用债投资和回购交易结合起来,在信用风险和流动性风险可控的前提下,或者通过回购融资来博取超额收益,或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。 7.中小企业私募债投资策略 利用自下而上的公司、行业层面定性分析,结合Z-Score、KMV等数量分析模型,测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异,根据自上而下的宏观经济及行业特性分析,从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异,结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。 8.资产支持证券投资策略 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。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘国华	陆志俊
	联系电话	021-31081600转	95559
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		(021)31089000,400-888-8688	95559
传真		021-31081800	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.gtfund.com
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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	78,324,346.58
本期利润	78,143,577.46
加权平均基金份额本期利润	0.0186
本期基金份额净值增长率	1.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0313
期末基金资产净值	4,355,896,268.25
期末基金份额净值	1.0346

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

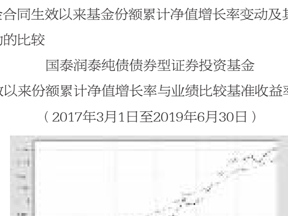
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.42%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.10%	-0.01%
过去三个月	0.66%	0.02%	0.64%	0.06%	0.02%	-0.04%
过去六个月	1.82%	0.03%	2.00%	0.06%	-0.18%	-0.03%
过去一年	4.10%	0.03%	6.00%	0.06%	-1.90%	-0.03%
自基金合同生效起至今	9.82%	0.02%	10.83%	0.06%	-1.01%	-0.04%

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

国泰润泰纯债债券型证券投资基金

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历史走势对比图

(2017年3月1日至2019年6月30日)



注:本基金的合同生效日为2017年3月1日。本基金在6个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
韩哲昊	本基金的基金经理、国泰现金管理货币、国泰货币市场、国泰利是宝货币、国泰民安增利债券的基金经理	2017-03-01	-	9年	硕士。2010年9月至2011年9月在昊盛投资有限公司工作,任交易员。2011年9月加入国泰基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理。2015年6月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金的基金经理,2015年6月至2019年7月任上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2015年6月至2018年10月任国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2015年6月至2017年3月任国泰信用债券型证券投资基金的基金经理,2015年7月至2017年3月任国泰淘金互联网债券型证券投资基金的基金经理,2015年7月至2017年8月任国泰创利债券型证券投资基金(由国泰6个月短期理财债券型证券投资基金转型而来)的基金经理,2016年12月起兼任国泰利是宝货币市场基金的基金经理,2017年2月至2018年4月任国泰润利纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月起兼任国泰润泰纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月至2017年10月任国泰现金宝货币市场基金的基金经理,2017年7月至2018年11月任国泰润鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年8月至2018年11月任国泰瞬利交易型货币市场基金和上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2017年12月至2018年6月任国泰民润纯债债券型证券投资基金和国泰润享纯债债券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遵规守信情况的说明

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所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≥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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度以来,海外经济增长持续放缓是境内债券市场的强心剂,但境内经济信号受春节错位影响表现相对混乱,叠加股票市场强势表现使得债券收益率下行过程倍显曲折,总体看来,收益率小幅震荡下行。二季度受经济数据的起落影、贸易谈判的不确定性及包商银行被接管事件冲击等影响,债券市场收益率先上后下,整体较一季末小幅上行,其中短端上行幅度大于长端。

一季度资金面边际略有收紧,但上半年整体依旧较为宽松。维持运用套息策略思路,维持组合一定杠杆水平。信用债持仓部分以中短久期、中高等级为主要配置,同时积极把握长端利率债波段操作机会,在严格控制组合回撤的同时力求为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2019年上半年净值增长率为1.82%,同期业绩比较基准收益率为2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

外部不确定性对全球经济下行压力显现,韩国、印尼、南非、乌克兰等多家央行纷纷降息,显示全球货币宽松进程加快。7月克强总理召开经济形势座谈会,降低实际利率水平,尤其要降低中小微民企的融资成本,仍然是政策重点,但包商银行事件发生后,中小银行面临负债规模收缩及成本走高双重压力,因此对中小银行定向宽松政策仍然可期。总体看来,经济与货币环境对债市利好仍在。可关注重要会议召开,财政及货币政策的方向及力度。

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

本报告期内,本基金出现过超过连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。截至本报告期末,本基金的基金份额持有人数量已恢复至两百人以上。

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

2019年半年度,基金托管人在国泰润泰纯债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019年半年度,国泰基金管理有限公司在国泰润泰纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

2019年半年度,由国泰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国泰润泰纯债债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国泰润泰纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:	-	-
银行存款	2,372,068.43	805,239.63
结算备付金	-	-
存出保证金	19,545.80	42,627.63
交易性金融资产	4,862,570,000.00	4,132,202,500.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,653,940,000.00	3,789,366,500.00
资产支持证券投资	208,630,000.00	342,836,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	76,000,234.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	93,265,459.34	70,604,472.30
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,958,227,073.57	4,279,655,073.56
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	600,398,979.80	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	100.89
应付管理人报酬	1,071,155.27	1,087,885.70
应付托管费	357,051.74	362,628.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	45,190.78	19,087.23
应交税费	204,125.31	268,535.68
应付利息	96,055.27	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	158,247.15	200,800.00
负债合计	602,330,805.32	1,939,038.07
所有者权益:	-	-
实收基金	4,210,064,517.93	4,210,028,785.48
未分配利润	145,831,750.32	67,687,250.01
所有者权益合计	4,355,896,268.25	4,277,716,035.49
负债和所有者权益总计	4,958,227,073.57	4,279,655,073.56

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0346元,基金份额总额4,210,064,517.93份。

6.2 利润表

会计主体:国泰润泰纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	93,238,511.56	114,594,674.02
1.利息收入	96,704,557.65	95,547,138.15
其中:存款利息收入	69,929.72	2,053,156.29
债券利息收入	91,157,297.29	93,485,468.83
资产支持证券利息收入	5,455,265.88	-
买入返售金融资产收入	22,064.76	8,513.03
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-3,285,277.08	-587,950.58
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,491,110.96	-587,950.58
资产支持证券投资收益	205,833.88	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-180,769.12	19,635,486.45
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	0.11	-
减:二、费用	15,094,934.10	13,392,677.14
1. 管理人报酬	6,428,747.09	6,338,240.58
2. 托管费	2,142,915.65	2,112,746.87
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,130.00	11,510.10
5. 利息支出	6,151,581.00	4,474,412.29
其中:卖出回购金融资产支出	6,151,581.00	4,474,412.29
6.税金及附加	177,098.58	228,500.25
7. 其他费用	187,461.78	227,267.05
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	78,143,577.46	101,201,996.88
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	78,143,577.46	101,201,996.88

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国泰润泰纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1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)	4,210,028,785.48	67,687,250.01	4,277,716,035.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	78,143,577.46	78,143,577.46
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)	35,732.45	922.85	36,655.30
其中:1.基金申购款	41,307.01	1,046.40	42,353.41
2.基金赎回款	-5,574.56	-123.55	-5,698.11
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)	4,210,064,517.93	145,831,750.32	4,355,896,268.25
项目	上年度可比期间 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)	4,210,027,343.42	7,457,583.85	4,217,484,927.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	101,201,996.88	101,201,996.88
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)	-1,610.63	-22.55	-1,633.18
其中:1.基金申购款	312.81	3.49	316.30
2.基金赎回款	-1,923.44	-26.04	-1,949.48
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)	-	-20,629,132.24	-20,629,132.24
五、期末所有者权益(基金净值)	4,210,025,732.79	88,030,425.94	4,298,056,158.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:周向勇,主管会计工作负责人:倪蓥,会计机构负责人:吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰润泰纯债债券型证券投资基金(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[2016]2155号《关于准予国泰润泰纯债债券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《国泰润泰纯债债券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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,210,019,711.79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(2017)第183号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰润泰纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,210,029,166.34份基金份额,其中认购资金利息折合9,454.55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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰润泰纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;本基金持有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: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。

6.4.2 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》、《国泰润泰纯债债券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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年半年度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1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。

6.4.4 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。

6.4.5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。

6.4.6 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:

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 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	6,428,747.09	6,338,240.58
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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0.30%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 0.30% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,142,915.65	2,112,746.87

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 0.10% / 当年天数。

6.4.8.3 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)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末2019年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末2018年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
交通银行	4,210,006,450.00	100.00%	4,210,006,450.00	99.00%

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入
交通银行	2,372,068.43	67,831.21	3,312,929.36	204,298.23

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

6.4.9.2 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股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额600,398,979.80元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1728010	17平安银行债	2019-07-01	101.88	440,000.00	44,827,200.00
1728002	17浦发银行01	2019-07-01	100.85	3,180,000.00	320,703,000.00
1928002	19民生银行二级01	2019-07-01	100.52	1,310,000.00	131,681,200.00
1728018	17农业银行二级	2019-07-01	101.18	1,370,000.00	138,616,600.00
合计				6,300,000.00	635,828,000.00

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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二层次的余额为 4,862,570,000.00元,无属于第一层次和第三层次的余额。(2018年12月31日:第二层次的余额为 4,132,202,500.00元,无属于第一层次及第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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(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 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	固定收益投资	4,862,570,000.00	98.07
	其中:债券	4,653,940,000.00	93.86
	资产支持证券	208,630,000.00	4.21
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,372,068.43	0.05
7	其他各项资产	93,285,005.14	1.88
8	合计	4,958,227,073.57	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.5 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	2,850,574,000.00	65.44
	其中:政策性金融债	317,200,000.00	7.28
4	企业债券	452,389,000.00	10.39
5	企业短期融资券	100,840,000.00	2.32
6	中期票据	1,250,137,000.00	28.70
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,653,940,000.00	106.84

7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 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	1728010	17平安银行债	4,000,000	407,520,000.00	9.36
2	1728002	17浦发银行01	4,000,000	403,400,000.00	9.26
3	1728014	17华夏银行01	3,000,000	305,970,000.00	7.02
4	101454038	14华能MTN001	2,200,000	222,486,000.00	5.11
5	1828004	18招商银行01	2,000,000	203,160,000.00	4.66

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1889242	18工元10A1	3,000,000.00	144,030,000.00	3.31
2	1889273	18工元11A1	700,000.00	32,837,000.00	0.75
3	1889203	18工元9A1	300,000.00	17,058,000.00	0.39
4	1889157	18唯盈2A2_bc	500,000.00	14,705,000.00	0.34

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体(除"工行、华夏银行、农行、平安银行、浦发银行、招商银行、中国银行"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。

工商银行多家分支行因:因贷后管理不到位;办理无真实贸易背景银行承兑汇票、违规发放贷款;转嫁贷款抵押评估费;信息披露虚假或严重误导性陈述 等原因,收到当地银保监最高175万元的罚款,部分机构没收非法获利所得。

华夏银行2018年12月10日公布数条处罚决定,公司下属东营、临沂、太原、吉安、宁波等12家分、支行,因违规掩盖信贷资产风险状况、办理无真实贸易背景承兑汇票业务,违规向客户转嫁成本、未经核准,违规任命高管人员并实质履行高管职责、违规发放委托贷款、以贷转存、严重违反审慎经营规则等原因受到当地银保监局处罚,处罚金额数十万元不等。

平安银行下属浙江、山东、上海、厦门、杭州、济南、大连等分、支行,于2018年受到来自外管局、银保监、人民银行、市场监督局、物价局、税务局等的多条处罚,处罚原因为违规发放贷款、违规开立银行汇票业务、贷款管理严重不审慎、贷前调查不到位等,处罚金额数十万元不等。

农业银行多家分、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或高管任职资格。

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。

招商银行多家分、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80万元的罚款,部分机构被责令整改。

中国银行多家分、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210万元的罚款,部分机构被责令整改或高管任职资格。

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。

7.12.2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。

7.12.3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	19,545.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	93,265,459.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,285,005.14

7.12.4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。

7.12.5 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 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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
205	20,536,900.09	4,210,006,450.00	100.00%	58,067.93	0.00%

8.2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	12,900.87	0.00%

8.3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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017年3月1日)基金份额总额	4,210,029,166.34
本报告期期初基金份额总额	4,210,028,785.48
本报告期基金总申购份额	41,307.01
减:本报告期基金总赎回份额	5,574.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,210,064,517.93

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,聘任倪蓥女士担任本基金管理人首席信息官。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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,本基金投资策略无改变。

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稽查或处罚等情况

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
宏信证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	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 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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
宏信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	201,941,608.23	87.07%	-	-	-	-
平安证券	30,000,000.00	12.93%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2019年1月1日至2019年6月30日	4,210,006,450.00	-	-	4,210,006,450.00	100.00%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							