

国泰保本混合型证券投资基金 更新招募说明书摘要

（2012年第一号）

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会 2011 年 3 月 4 日证监许可【2011】322 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金作为保本混合型基金，采用恒定比例组合保险策略进行资产配置，因此将会有部分基金资产投资于股票市场，基金份额净值会随股票市场的变化而上下波动。在本基金第一个保本期，对于投资人认购并持有当期保本期到期的基金份额，存在着仅能收回认购金额（包括净认购金额和认购费用）的可能性；对于投资人在日常申购的基金份额，存在着仅能部分收回本金的可能性。对于基金份额持有人未持有当期保本期到期的基金份额，在赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。因此，投资人应根据自身的风险承受能力和预期收益，权衡选择适合自己的产品。本基金主要适合注重本金安全的低风险投资人和部分参与股票市场的稳健投资者。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。在本基金的第一个保本期为投资人认购并持有当期保本期到期的基金份额提供保本保证，并由保证人提供连带责任保证。

投资者投资于本保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，投资者投资基金仍然存在本金损失的风险。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 4 月 19

日，投资组合报告为 2012 年 1 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

成立时间：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：何 晔

联系电话：021-38561743

股本结构：

| 股东名称 | 股权比例 |
|--------------|------|
| 中国建银投资有限责任公司 | 60% |
| 意大利忠利集团 | 30% |
| 中国电力财务有限公司 | 10% |

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2012 年 4 月 19 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 22 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、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、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、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、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（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、国泰价值经典股票型证券投资

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、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金。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，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

（三）主要人员情况

1、董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，20 年证券从业经历。1982 年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理，1998 年 3 月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999 年 10 月起任公司董事长、党委书记。

陈良秋，董事，大学本科。1993 年 7 月起在中国建设银行厦门市分行工作，历任业务科副经理、办公室副总经理、支行副行长、行长。2006 年 10 月起在中国建投工作，任企业管理部总经理助理、副总经理、投资部负责人，兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007 年 11 月起任公司董事。

徐志斌，董事，硕士研究生。2001 年 8 月起，先后在高盛集团工作，历任环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理；运营风险管理部总监、执行董事；市场风险管理部执行董事。2010 年 4 月起在中国建投风险管理部工作，2010 年 4 月起任中国建投风险管理部业务总监。2010 年 11 月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生，EFFAS 注册金融分析师。1993 年起历任 BOISSY GESTION SA (AZUR - GMF Group) 首席执行官、ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监、GENERALI FINANCES SA 副总经理/投资总监、GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A./GENERALI INVESTMENTS 首席执行官/投资总监、GENERALI INVESTMENTS 忠利投资董事会主席/首席执行官。并兼任 Generali Investments SICAV (卢森堡) 主席、Generali Investments

Deutschland 监事会主席、Generali Fund Management 副主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano)、TENAX(UK)、Generali Hedge Fund SICAV(Lugano)董事会成员等职务。2010年6月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员（FCII）及英国特许保险师（Chartered Insurer）。1994年起历任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理、忠利保险有限公司英国分公司、忠利亚洲中国地区总经理、中意财产保险有限公司董事、总经理，兼任中意人寿保险有限公司董事。2010年6月起任公司董事。

张和之，董事，硕士研究生、高级会计师。曾任水利电力部机关财务处主任科员，能源部机关财务处副处长，电力部机关事务局经营财务处处长，国家电力公司中兴实业发展总公司副总经理、总会计师、副董事长、中国电力财务有限公司副董事长、党组书记（正局级）、正局级调研员。2004年2月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，19年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任党支部副书记、副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007年11月起任公司董事、党委副书记。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993年回国从事律师工作，现为北京中伦律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001年5月起任公司独立董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、执行院长。兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、中国法学会国际经济法学研究会常务副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委仲裁员、北京市华贸硅谷律师事务所兼职律师等职。2010年6月起任公司独立董事。

刘秉升，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记；1982年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长；1985年起任吉林省抚松县县委常委、常务副县长；1989年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记；1995

年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记；1998年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007年任海南省银行业协会会长。2010年11月起任公司董事。

韩少华，独立董事，大学专科，高级会计师。1964年起在中国建设银行河南省工作，历任河南省分行副处长、处长；南阳市分行行长、党组书记；分行总会计师。2003年至2008年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010年11月起任公司董事。

2、监事会成员

唐建光，监事会主席，大学本科。1982年1月至1988年10月在煤炭工业部基建司任工程师；1988年10月至1993年7月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长；1995年9月至1998年10月在煤炭部基建管理中心工作，先后任综合处处长、中心副主任；1998年10月至2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理；2005年1月进入中国建银投资有限责任公司，先后任资产处置部负责人、总经理、资产管理处置部总经理、负责人，现任中国建银投资有限责任公司企业管理部高级业务总监。2010年11月起担任本公司监事会主席。

Amerigo BORRINI，监事，大学本科，CFA，金融咨询师。1967年起历任忠利集团会计结算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官。2010年6月起任本公司监事。

李芝樑，监事，硕士研究生。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传部干事，中国电力财务有限公司债券基金部副经理、经理，投资银行部主任，发展研究中心主任兼董事会办公室常务副主任。现任中国电力财务有限公司董事会办公室主任。2004年2月起任本公司监事。

沙骏，监事，硕士研究生。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券，1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团，2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司；2008年2月至2009年8月任交易部总监；2009年9月至2011年6月任研究部总监；2011年1月至2012年2月兼任公司投资副总监；2012年2月起兼任公司投资总监。2011年4月起任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。2010年11月起担任公司职工监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001年10月加入国泰基金管理有限公司，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。2007年11月起任公

司职工监事。

3、高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，19年证券从业经历。1993年4月至1998年4月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998年4月至2007年11月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。现任公司副总经理兼北京分公司总经理。

梁之平，本科，15年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理，大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监，2008年4月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理兼财富管理中心总经理，2011年1月至2012年2月兼任深圳分公司总经理，2010年4月起任公司副总经理兼财富管理中心总经理。

李峰，硕士研究生，16年银行证券基金从业经历。1996年5月至2003年6月任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管，2003年7月至2005年5月任国联安基金管理有限公司监察稽核专员，2005年5月至2007年3月任信诚基金管理有限公司督察长，2007年4月至2009年1月任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009年2月加盟国泰基金管理有限公司，现任公司督察长。

4、本基金的基金经理

沙骥，男，硕士研究生，14年证券基金从业经历。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券，1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团，2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司；2008年2月至2009年8月任交易部总监；2009年9月至2011年6月任研究部总监；2011年1月至2012年2月兼任公司投资副总监，2012年2月起兼任公司投资总监；2011年4月起任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。

邱晓华，男，硕士研究生，11年证券基金从业经历。1997年至2000年任职于新华通讯社，2001年10月至2004年4月任职于北京首都国际投资管理有限公司，2004年4月至2007年4月任职于银河证券。2007年4月加入国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理；2011年4月起任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。

5、本基金投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

金旭女士：总经理

梁之平先生：副总经理兼财富管理中心总经理

张人蟠先生：总经理助理

周向勇先生：总经理助理

刘夫先生：投资副总监

沙骏先生：投资总监

张则斌先生：财富管理中心投资总监

黄焱先生：投资总监兼基金管理部总监

张玮先生：投资总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2011年12月31日，招商银行总资产2.795万亿元人民币，核心资本充足率8.22%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、运营室、监察稽核室4个职能处室，现有员工52人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过九年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2011年，招商银行实现托管费收入5.10亿元，托管资产突破5000亿元，托管日均存款达到274亿元，各项指标均创历史新高。托管产品数量、托管资产规模稳居中小托管银行第一，开放式基金托管新增数量与首发规模规模居股份制托管银行第一，内部控制连续五年通过ISAE3402国际认证，第二次被境外权威媒体

《财资》评为“中国最佳托管专业银行”，被《21世纪经济报道》评为“2011年度VC/PE最佳托管银行”。

（二）主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999年3月开始担任本公司董事。2010年8月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司）董事长，及中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（深圳证券交易所上市公司）董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生，招商银行执行董事、行长兼首席执行官，1999年1月加入本公司。经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员。1999年1月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自1999年9月、2003年9月、2007年11月及2008年10月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长，并自2002年7月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995年5月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，大学本科，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截至2012年3月31日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增

值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（QDII-LOF）、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金共42只开放式基金及其它托管资产，托管资产为7384.05亿元人民币。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------------|----------------------------------|--|
| 1 | 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 | 地址：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 | |
| | | 电话：021-38561759 | 传真：021-68775881 |
| | | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 | |
| | | 联系人：蔡丽萍 | 网址： www.gtfund.com |
| 2 | 国泰基金管理有限公司北京直销柜台 | 地址：中国北京市西城区金融大街7号第5层 | |
| | | 电话：010-66553078 | 传真：010-66553082 |
| | | 联系人：王彬 | |

| | | | |
|---|------------|---|--------|
| 3 | 国泰基金电子交易平台 | 网站： www.gtfund.com 登录网上交易页面 | |
| | | 电话：021-38561739 | 联系人：徐怡 |

2、代销机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|----------------|--|--|
| 1 | 中国银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号 | |
| | | 法定代表人：肖钢 | 联系人：客户服务中心 |
| | | 客服电话：95566 | 网址： www.boc.cn |
| 2 | 中国建设银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街25号 | |
| | | 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 | |
| | | 法定代表人：王洪章 | 客服电话：95533 |
| | | 网址： www.ccb.com | |
| 3 | 中国农业银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街69号 | |
| | | 办公地址：北京市东城区建国门内大街69号 | |
| | | 法定代表人：蒋超良 | 客户服务电话：95599 |
| | | 联系人：滕涛 | 传真：010-85109219 |
| | | 网址： www.95599.cn | |
| 4 | 中国工商银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100005） | |
| | | 办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100005） | |
| | | 法定代表人：姜建清 | 电话：95588 |
| | | 网址： www.icbc.com.cn | |
| 5 | 交通银行股份有限公司 | 注册地址：上海市银城中路188号 | |
| | | 法定代表人：胡怀邦 | 客服电话：95559 |
| | | 联系人：曹榕 | 电话：021-58781234 |
| | | 网址： www.bankcomm.com | |
| 6 | 招商银行股份有限公司 | 注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦 | |
| | | 法定代表人：傅育宁 | 联系人：邓炯鹏 |
| | | 电话：0755-83198888 | 传真：0755-83195109 |
| | | 客户服务热线：95555 | 网址： www.cmbchina.com |
| 7 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号 | |
| | | 办公地址：上海市中山东一路12号 | |

| | | | |
|----|--------------------|--|--|
| | | 法定代表人：吉晓辉 | 电话：021-61618888 |
| | | 联系人：汤嘉惠、虞谷云 | 客户服务热线：95528 |
| | | 网址： www.spdb.com.cn | |
| 8 | 中信银行股份有 限公司 | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 | |
| | | 法定代表人：孔丹 | 联系人：丰靖 |
| | | 电话：010-65550827 | 传真：010-65550827 |
| | | 客服电话：95558 | 网址： bank.ecitic.com |
| 9 | 中国民生银行股 份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号 | |
| | | 法定代表人：董文标 | 联系人：董云巍、吴海鹏 |
| | | 电话：010-58351666 | 传真：010-83914283 |
| | | 客服电话：95568 | 网址： www.cmbc.com.cn |
| 10 | 北京银行股份有 限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层 | |
| | | 法定代表人：闫冰竹 | 联系人：谢小华 |
| | | 电话：010-66223587 | 传真：010-66226045 |
| | | 客服电话：010-95526 | |
| | | 网址： www.bankofbeijing.com.cn | |
| 11 | 上海农村商业银 行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号 | |
| | | 法定代表人：胡平西 | 联系人：吴海平 |
| | | 电话：021-38576977 | 传真：021-50105124 |
| | | 客服电话：021-962999 | 网址： www.srcb.com |
| 12 | 中国中投证券有 限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元 | |
| | | 法定代表人：龙增来 | 联系人：刘毅 |
| | | 电话：0755-82023442 | 客服电话：400-600-8008 |
| | | 网址： www.china-invs.cn | |
| 13 | 国泰君安证券股 份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区商城路618号 | |
| | | 法定代表人：万建华 | 联系人：芮敏祺 |
| | | 电话：021-38676161 | 传真：021-38670161 |
| | | 客服电话：400-888-8666 | 网址： www.gtja.com |
| 14 | 宏源证券股份有 限公司 | 注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号 | |

| | | | |
|----|----------------|--|--|
| | | 法定代表人：冯戎 | 联系人：李巍 |
| | | 电话：010-88085858 | 传真：010-88085195 |
| | | 客服电话：400-800-0562 | 网址： www.hysec.com |
| 15 | 万联证券有限责任公司 | 注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层 | |
| | | 法定代表人：张建军 | 联系人：罗创斌 |
| | | 电话：020-37865070 | 传真：020-22373718-1013 |
| | | 客服电话：400-888-8133 | 网址： www.wlzq.com.cn |
| 16 | 中信建投证券股份有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 | |
| | | 法定代表人：王常 | 联系人：魏明 |
| | | 电话：010-85130588 | 传真：010-65182261 |
| | | 客服电话：400-888-8108 | 网址： www.csc108.com |
| 17 | 海通证券股份有限公司 | 注册地址：上海市淮海中路98号 | |
| | | 法定代表人：王开国 | 联系人：李笑鸣 |
| | | 电话：021-23219000 | 传真：021-23219100 |
| | | 客服电话：400-888-8001（全国），021-95553 | |
| | | 网址： www.htsec.com | |
| 18 | 中国银河证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 | |
| | | 法定代表人：顾伟国 | 联系人：田薇 |
| | | 电话：010-66568430 | 传真：010-66568990 |
| | | 网址： www.chinastock.com.cn | |
| 19 | 中信证券（浙江）有限责任公司 | 注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19楼 | |
| | | 法定代表人：沈强 | 联系人：周妍 |
| | | 电话：0571-86078823 | 客服电话：0571-96598 |
| | | 网址： www.bigsun.com.cn | |
| 20 | 申银万国证券股份有限公司 | 注册地址：上海市常熟路171号 | |
| | | 法定代表人：丁国荣 | 联系人：邓寒冰 |
| | | 电话：021-54033888 | 传真：021-54038844 |
| | | 客服电话：021-962505 | 网址： www.sw2000.com.cn |
| 21 | 东方证券股份有限公司 | 注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层 | |
| | | 法定代表人：王益民 | 联系人：吴宇 |

| | | | |
|----|----------------|--|--|
| | | 电话：021-63325888 | 传真：021-63326173 |
| | | 客服电话：95503 | 网址： www.dfzq.com.cn |
| 22 | 东吴证券股份有 限公司 | 注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层 | |
| | | 法定代表人：吴永敏 | 联系人：方晓丹 |
| | | 电话：0512-65581136 | 传真：0512-65588021 |
| | | 客服电话：0512-33396288 | 网址： www.dwzq.com.cn |
| 23 | 广发证券股份有 限公司 | 注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼 | |
| | | 办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、41 和 42 楼 | |
| | | 法定代表人：王志伟 | 联系人：黄岚 |
| | | 电话：020-87555888 | 传真：020-87555305 |
| | | 客服电话：95575 | 网址： www.gf.com.cn |
| 24 | 国盛证券有限责 任公司 | 注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号 | |
| | | 办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼 | |
| | | 法定代表人：曾小普 | 联系人：徐美云 |
| | | 电话：0791-6285337 | 传真：0791-6288690 |
| | | 网址： www.gsstock.com | |
| 25 | 民生证券有限责 任公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层 | |
| | | 法定代表人：余政 | 联系人：赵明 |
| | | 电话：010-85127622 | 传真：010-85127917 |
| | | 客服电话：400-619-8888 | 网址： www.msyzq.com |
| 26 | 上海证券有限责 任公司 | 注册地址：上海市西藏中路 336 号 | |
| | | 法定代表人：郁忠民 | 联系人：张瑾 |
| | | 电话：021-53519888 | 传真：021-53519888 |
| | | 客服电话：021-962518 | 网址： www.962518.com |
| 27 | 光大证券股份有 限公司 | 注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号 | |
| | | 法定代表人：徐浩明 | 联系人：刘晨 |
| | | 电话：021-22169999 | 传真：021-22169134 |
| | | 客服电话：10108998、400-888-8788 | |
| | | 网址： www.ebscn.com | |

| | | | |
|----|------------------|--|--|
| 28 | 中信万通证券有 限责任公司 | 注册地址: 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室 | |
| | | 办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层 (266061) 楼第 20 层 (266061) | |
| | | 法定代表人: 杨宝林 | 联系人: 吴忠超 |
| | | 电话: 0532-85022326 | 传真: 0532-85022605 |
| | | 客服电话: 0532-96577 | 网址: www.zxwt.com.cn |
| 29 | 中信证券股份有 限公司 | 注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层 | |
| | | 法定代表人: 王东明 | 联系人: 陈忠 |
| | | 电话: 010-84588888 | 传真: 010-84865560 |
| | | 网址: www.ecitic.com | |
| 30 | 华泰证券有限责 任公司 | 注册地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| | | 办公地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| | | 法定代表人: 吴万善 | 联系人: 张小波 |
| | | 电话: 025-84457777 | 网址: www.htzq.com.cn |
| | | 客服电话: 95597 | |
| 31 | 长江证券股份有 限公司 | 注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 | |
| | | 法定代表人: 胡运钊 | 联系人: 李良 |
| | | 电话: 021-63219781 | 传真: 021-51062920 |
| | | 客服电话: 95579 | 网址: www.95579.com |
| 32 | 渤海证券股份有 限公司 | 注册地址: 天津市经济技术开发区第一大街 29 号 | |
| | | 办公地址: 天津市河西区宾水道 3 号 | |
| | | 法定代表人: 杜庆平 | 联系人: 王兆权 |
| | | 电话: 022-28451861 | 传真: 022-28451892 |
| | | 客服电话: 400-651-5988 | 网址: www.bhzq.com |
| 33 | 中原证券股份有 限公司 | 注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路 10 号 | |
| | | 办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 层 | |
| | | 法定代表人: 石保上 | 联系人: 程月艳、耿铭 |
| | | 电话: 0371-65585670 | 传真: 0371-65585665 |
| | | 客服电话: 400-813-9666/0371-967218 | |
| | | 网址: www.ccnew.com | |

| | | | |
|----|----------------|--|--|
| 34 | 国信证券股份有 限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼 | |
| | | 法定代表人：何如 | 联系人：齐晓燕 |
| | | 电话：0755-82130833 | 传真：0755-82133952 |
| | | 客服电话：95536 | 网址： www.guosen.com.cn |
| 35 | 招商证券股份有 限公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层 | |
| | | 法定代表人：宫少林 | 联系人：黄健 |
| | | 电话：0755-82943666 | 传真：0755-82943636 |
| | | 网址： www.newone.com.cn | |
| | | 客服电话：400-888-8111\95565 | |
| 36 | 兴业证券股份有 限公司 | 注册地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦 | |
| | | 法定代表人：兰荣 | 联系人：谢高得 |
| | | 电话：021-38565785 | 传真：021-38565783 |
| | | 客服电话：400-888-8123 | |
| | | 网址： www.xyjq.com.cn | |
| 37 | 齐鲁证券有限公 司 | 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | |
| | | 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | |
| | | 法定代表人：李玮 | 联系人：吴阳 |
| | | 电话：0531-68889155 | 传真：0531-68889752 |
| | | 客服电话：95538 | 网址： www.qlzq.com.cn |
| 38 | 安信证券股份有 限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 | |
| | | 法定代表人：牛冠兴 | 联系人：陈剑虹 |
| | | 联系电话：0755-82825551 | 传真：0755-82558355 |
| | | 客服电话：400-800-1001 | 网址： www.essence.com.cn |
| 39 | 东莞证券有限责 任公司 | 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 | |
| | | 法定代表人：游锦辉 | 联系人：梁健伟 |
| | | 电话：0769-22119341 | 传真：0769-22116999 |
| | | 客服电话：0769-961130 | 网址： www.dgzq.com.cn |
| 40 | 恒泰证券股份有 限公司 | 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号 | |
| | | 法定代表人：庞介民 | 联系人：常向东 |

| | | | |
|----|------------|--|--|
| | | 电话：0471-4913998 | 传真：0471-4930707 |
| | | 客服电话：0471-4961259 | 网址： www.cnht.com.cn |
| 41 | 厦门证券有限公司 | 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼 | |
| | | 法定代表人：傅毅辉 | 联系人：卢金文 |
| | | 电话：0592-5161642 | 传真：0592-5161140 |
| | | 客服电话：0592-5163588 | 网址： www.xmzq.cn |
| 42 | 华宝证券有限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层 | |
| | | 法定代表人：陈林 | 联系人：刘闯川 |
| | | 电话：021-68778081 | 传真：021-68778117 |
| | | 客服电话：400-820-9898 | 网址： www.cnhbstock.com |
| 43 | 英大证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 | |
| | | 法定代表人：赵文安 | 联系人：王睿 |
| | | 电话：0755-83007069 | 传真：0755-83007167 |
| | | 客服电话：400-869-8698 | 网址： www.ydsc.com.cn |
| 44 | 中国国际金融有限公司 | 注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 | |
| | | 法定代表人：李剑阁 | 联系人：罗文雯 |
| | | 电话：010-65051166 | 传真：010-65051156 |
| | | 网址： www.cicc.com.cn | |
| 45 | 华福证券有限责任公司 | 注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层 | |
| | | 法定代表人：黄金琳 | 联系人：张腾 |
| | | 电话：0591-87278701 | 传真：0591-87841150 |
| | | 客服电话：0591-96326 | 网址： www.hfzq.com.cn |
| 46 | 天相投资顾问有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 | |
| | | 法定代表人：林义相 | 联系人：林爽 |
| | | 电话：010-66045608 | 传真：010-66045500 |
| | | 客服电话：010-66045678 | 网址： www.txsec.com |
| 47 | 信达证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 | |
| | | 法定代表人：高冠江 | 联系人：唐静 |
| | | 电话：010-88656100 | 传真：010-88656290 |
| | | 客服电话：400-800-8899 | 网址： www.cindasc.com |

| | | | |
|----|------------------|--|--|
| 48 | 中国民族证券有 限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层 | |
| | | 法定代表人：赵大建 | 联系人：李微 |
| | | 电话：010-59355941 | 传真：010-66553791 |
| | | 客服电话：400-889-5618 | 网址： www.e5618.com |
| 49 | 华龙证券有限责 任公司 | 注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号 | |
| | | 法定代表人：李晓安 | 联系人：李昕田 |
| | | 电话：0931-8888088 | 传真：0931-4890515 |
| | | 客服电话：0931-4890100、4890619、4890618 | |
| | | 网址： www.hlzqgs.com | |
| 50 | 国元证券股份有 限公司 | 注册地址：安徽省合肥市寿春路179号 | |
| | | 法定代表人：凤良志 | 联系人：祝丽萍 |
| | | 电话：0551-2257012 | 传真：0551-2272100 |
| | | 客服电话：95578 | 网址： www.gyzq.com.cn |
| 51 | 杭州银行股份有 限公司 | 注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦 | |
| | | 法定代表人：吴太普 | 联系人：严峻 |
| | | 电话：0571-85163127 | 传真：0571-85179591 |
| | | 客服电话：400-888-8508 | 网址： www.hzbank.com.cn |
| 52 | 渤海银行股份有 限公司 | 注册地址：天津市河西区马场道201-205号 | |
| | | 法定代表人：刘宝凤 | 联系人：王宏 |
| | | 电话：022-58316666 | 传真：022-58316259 |
| | | 客服电话：400-888-8811 | 网址： www.cbhb.com.cn |
| 53 | 青岛银行股份有 限公司 | 注册地址：青岛市市南区香港中路68号华普大厦 | |
| | | 法定代表人：郭少泉 | 联系人：滕克 |
| | | 电话：0532-85709732 | 传真：0532-85709725 |
| | | 客服电话：96588（青岛）400-669-6588（全国） | |
| | | 网址： www.qdccb.com | |
| 54 | 西部证券股份有 限公司 | 注册地址：陕西省西安市东大街232号信托大厦16-17楼 | |
| | | 法定代表人：刘建武 | 联系人：冯萍 |
| | | 电话：029-87406488 | 传真：029-87406387 |
| | | 客服电话：95582 | 网址： www.westsecu.com |

| | | | |
|----|--------------|--|--|
| 55 | 平安证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 | |
| | | 法定代表人：杨宇翔 | 联系人：郑舒丽 |
| | | 电话：0755-22626391 | 传真：0755-82400862 |
| | | 客服电话：95511-8 | 网址： www.pingan.com |
| 56 | 深圳发展银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 | |
| | | 法定代表人：肖遂宁 | 联系人：张青 |
| | | 电话：0755-82088888 | 传真：0755-25841098 |
| | | 客服电话：95501 | 网址： www.sdb.com.cn |
| 57 | 德邦证券有限责任公司 | 注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼 | |
| | | 法定代表人：姚文平 | 联系人：罗芳 |
| | | 电话：021-68761616 | 传真：021-68767981 |
| | | 客服电话：4008888128 | 网址： www.tebon.com.cn |
| 58 | 中航证券有限公司 | 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 | |
| | | 法定代表人：杜航 | 联系人：戴蕾 |
| | | 电话：0791-86768681 | 传真：0791-86770178 |
| | | 客服电话：400-8866-567 | 网址： www.avicsec.com |
| 59 | 洛阳银行股份有限公司 | 注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口 | |
| | | 法定代表人：王建甫 | 联系人：胡艳丽 |
| | | 电话：0379-65921977 | 传真：0379-65920155 |
| | | 客服电话：0379-96699 | 网址： www.bankofluoyang.com.cn |
| 60 | 东海证券有限责任公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼 | |
| | | 法定代表人：朱科敏 | 联系人：李涛 |
| | | 电话：0519-88157761 | 传真：0519-88157761 |
| | | 客服电话：400-888-8588 | 网址： www.longone.com.cn |
| 61 | 方正证券股份有限公司 | 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层 | |
| | | 法定代表人：雷杰 | 联系人：郭瑞军 |
| | | 电话：0731-85832503 | 传真：0731-85832214 |
| | | 客服电话：95571 | 网址： www.foundersc.com |
| 62 | 山西证券股份有限公司 | 注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 | |

| | | | |
|----|----------------|---------------------------------|--|
| | | 法定代表人：侯巍 | 联系人：郭熠 |
| | | 电话：0351-8686659 | 传真：0351-8686619 |
| | | 客服电话：400-666-1618 | 网址： www.i618.com.cn |
| 63 | 深圳农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 | |
| | | 法定代表人：李伟 | 联系人：曾明 宋永成 |
| | | 电话：0755-25188269 | 传真：0755-25188785 |
| | | 客服电话：4001961200 | 网址： www.961200.net |
| 64 | 湘财证券有限责任公司 | 注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼 | |
| | | 法定代表人：林俊波 | 联系人：钟康莺 |
| | | 电话：021-68634518 | 传真：021-68865680 |
| | | 客服电话：400-888-1551 | 网址： www.xcsc.com |
| 65 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区月坛北街 26 号 | |
| | | 法定代表人：丁之锁 | 联系人：陶颖 |
| | | 电话：010-58568040 | 传真：010-58568062 |
| | | 客服电话：010-58568118 | 网址： www.hrsec.com.cn |
| 66 | 日信证券有限责任公司 | 注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号 | |
| | | 法定代表人：孔佑杰 | 联系人：陈韦杉 |
| | | 电话：010-66413306 | 传真：010-66412537 |
| | | 客服电话：010-88086830 | 网址： www.rxzq.com.cn |
| 67 | 江海证券有限公司 | 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 | |
| | | 法定代表人：孙名扬 | 联系人：张宇宏 |
| | | 电话：0451-82336863 | 传真：0451-82287211 |
| | | 客服电话：400-666-2288 | 网址： www.jhjq.com.cn |
| 68 | 广州证券有限责任公司 | 注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼 | |
| | | 法定代表人：刘东 | 联系人：林洁茹 |
| | | 电话：020-88836999 | 传真：020-88836654 |
| | | 客服电话：020-961303 | 网址： www.gzs.com.cn |
| 69 | 大连银行股份有限公司 | 注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼 | |
| | | 法定代表人：陈占维 | 联系人：李鹏 |
| | | 电话：0411-82308602 | 传真：0411-82311420 |

| | | | |
|----|------------|-------------------|--|
| | | 客服电话：400-664-0099 | 网址： www.bankofdl.com |
| 70 | 天源证券经纪有限公司 | 注册地址：青海省西宁市长江路53号 | |
| | | 法定代表人：林小明 | 联系人：王斌 |
| | | 电话：0755-33331188 | 传真：0755-33329815 |
| | | 客服电话：4006543218 | 网址： www.tyzq.com.cn |

(二) 注册登记机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------|----------------------------------|-----------------|
| 1 | 国泰基金管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 | |
| | | 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 | |
| | | 法定代表人：陈勇胜 | 传真：021-38561800 |
| | | 联系人：何晔 | |
| | | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 | |

(三) 出具法律意见书的律师事务所

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|---------|--------------------|-----------------|
| 1 | 通力律师事务所 | 注册地址：上海市银城中路68号19楼 | |
| | | 负责人：韩炯 | 联系人：黎明 |
| | | 电话：021-31358666 | 传真：021-31358600 |
| | | 经办律师：吕红、黎明 | |

(四) 审计基金财产的会计师事务所

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------------|----------------------------------|-----------------|
| 1 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 | |
| | | 办公地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 | |
| | | 法人代表：杨绍信 | 联系人：单峰 |
| | | 电话：021-61238888 | 传真：021-61238800 |
| | | 经办注册会计师：汪棣、单峰 | |

四、基金名称

国泰保本混合型证券投资基金

五、基金类型和存续期限

- 1、基金类型：保本混合型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

六、基金保本期

本基金的保本期一般每3年为一个周期。本基金第一个保本期自基金合同生效之日起至3年后对应日止；本基金第一个保本期后的各保本期自本基金公告的保本期起始之日起至3年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在保本期到期前公告的到期处理规则中确定下一保本期的起始时间。本招募说明书中若无特别所指，保本期即为当期保本期。

七、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。

八、投资范围

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）、债券、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的0%-40%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的60%-100%，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%。本基金在任何交易日日终，持

有的卖出期货合约价值不超过基金持有的股票总市值。基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

九、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。

（1）采用 CPPI 策略进行资产配置

本基金以恒定比例组合保险策略为依据，动态调整风险资产和无风险资产的配置比例，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的收益。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。

CPPI 是国际通行的一种投资组合保险策略，它主要是通过数量分析，根据市场的波动来调整、修正风险资产的可放大倍数（风险乘数），以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。在风险资产可放大倍数的管理上，基金管理人的金融工程小组在定量分析的基础上，根据 CPPI 数理机制、历史模拟和目前市场状况定期出具保本基金资产配置建议报告，给出放大倍数的合理上限的建议，供基金管理人投资决策委员会和基金经理作为基金资产配置的参考。

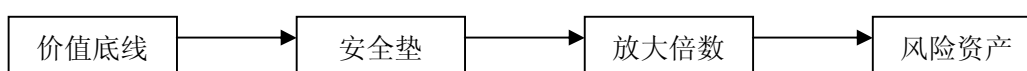
CPPI 策略的投资步骤：

第一步，根据本基金三年保本到期时的最低目标价值（投资金额）和合理的折现率设定当前应持有的无风险资产的数量，即投资组合的价值底线；

第二步，计算投资组合现时基金净值超过价值底线的数额，该数值等于安全垫；

第三步，将相当于安全垫特定倍数的资金规模投资于风险资产（如股票、可转债等），以创造高于最低目标价值的收益，其余资产投资于无风险资产以在期末实现最低目标价值。

1) 风险资产投资额度的计算：



$$\text{风险资产投资} \leq [\text{放大倍数} \times (\text{基金资产净值} - \text{价值底线})]$$

2) t时刻安全垫

$$C_t = V_t - F_t = R_t + M_t - F_t$$

其中： C_t =t时刻安全垫的数值

V_t =t时刻投资组合的净值

R_t =t时刻风险资产的价值

M_t =t时刻无风险资产的价值

F_t =t时刻的价值底线

3) t时刻各类资产放大倍数

$$1 < X_t^i \leq 1/L_t^i$$

L_t^i 为在t时刻第i类资产可能产生的最大亏损。

安全垫的放大将同时带来股票投资可能的收益增加和股票投资可能的风险加大两个结果。因此，在CPPI中，随着安全垫放大倍数的变化，基金管理人必须在股票投资风险加大和收益增加这两者间寻找适当的平衡点，也就是确定适当的安全垫放大倍数，以力求既能保证基金本金的安全，又能尽量为投资者创造更多的收益。

(2) 股票投资策略

本基金注重对股市趋势的研究，根据CPPI策略，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。

本基金的股票投资以价值选股、组合投资为原则，通过选择高流动性股票，保证组合的高流动性；通过选择具有高安全边际的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资，降低个股风险与集中性风险。

在投资组合的构建过程中，本基金依托公司的三级股票池，采用定量分析与定性分析相结合的方法，构建基金的股票投资组合，通过组合管理有效规避个股的非系统性风险，通过分散化投资增加风险组合的流动性，增加股市大幅波动时的变现能力。

1) 三级股票池建立

以市盈率、市净率、现金流量、净利润及净利润增长率等基本面指标为标准，在上市公司中遴选个股，构建一级股票池；

在一级股票池的基础上，综合考虑以下指标构建二级股票池：

A: 主业清晰，在产品、技术、营销、营运、成本控制等方面具有较强竞争优势，销售收入或利润超过行业平均水平；

B: 具有较强或可预期的盈利增长前景；

C: 盈利质量较高，经营性现金流加上投资收益超过净利润；

D: 较好的公司治理结构，财务报表和信息披露较为透明、规范；

在二级股票池的基础上，采用实地调研等方式，选取主业清晰，具有持续的核心竞争力，管理透明度较高，流动性好且估值具有高安全边际的个股构建核心股票池（三级股票池）。

估值分析主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、股息贴现模型等。

2) 投资组合建立和调整

本基金将在核心股票池中选择个股，建立买入和卖出股票名单，并选择合理时机，稳步建立和调整投资组合。在投资组合管理过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

(3) 债券投资策略

1) 基本持有久期与保本期相匹配的债券，主要按买入并持有方式操作以保证债券组合收益的稳定性，尽可能地控制利率、收益率曲线等各种风险。

2) 综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。积极性策略主要包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券进行投资、把握市场上的无风险套利机会，利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性、控制风险等等，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。

3) 利用银行间市场和交易所市场现券存量进行国债回购所得的资金积极参与新股申购和配售，以获得股票一级市场可能的投资回报。

(4) 权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。

本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

(5) 股指期货交易策略

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种

选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

A: 套保时机选择策略

根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析，决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。

B: 期货合约选择和头寸选择策略

在套期保值的现货标的确认之后，根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约；运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸；对套期保值的现货标的 Beta 值进行动态的跟踪，动态的调整套期保值的期货头寸。

C: 展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对期货合约进行展期。理论上，不同交割时间的期货合约价差是一个确定值；现实中，价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差，选择合适的交易时机进行展仓。

D: 保证金管理

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

E: 流动性管理策略

利用股指期货的现货替代功能和其金融衍生品交易成本低廉的特点，可以作为管理现货流动性风险的工具，降低现货市场流动性不足导致的交易成本过高的风险。在基金建仓期或面临大规模赎回时，大规模的股票现货买进或卖出交易会造成市场的剧烈动荡产生较大的冲击成本，此时基金管理人将考虑运用股指期货来化解冲击成本的风险。

基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：保本期开始时 3 年期银行定期存款税后收益率。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、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。

十二、基金投资组合报告

本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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月17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。

本投资组合报告所载数据截止2012年3月31日。本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 54,550,117.87 | 2.43 |
| | 其中：股票 | 54,550,117.87 | 2.43 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,927,006,704.69 | 85.75 |
| | 其中：债券 | 1,927,006,704.69 | 85.75 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 168,702,943.05 | 7.51 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 58,635,875.02 | 2.61 |
| 6 | 其他各项资产 | 38,346,434.38 | 1.71 |
| 7 | 合计 | 2,247,242,075.01 | 100.00 |

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 | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 24,453,249.71 | 1.10 |

| | | | |
|-----|----------------|---------------|------|
| C0 | 食品、饮料 | 6,890,000.00 | 0.31 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 9,313,249.71 | 0.42 |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 8,250,000.00 | 0.37 |
| C8 | 医药、生物制品 | - | - |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 14,346,735.20 | 0.65 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 8,430,843.00 | 0.38 |
| H | 批发和零售贸易 | 7,319,289.96 | 0.33 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 54,550,117.87 | 2.46 |

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600780 | 通宝能源 | 2,109,814 | 14,346,735.20 | 0.65 |
| 2 | 000422 | 湖北宣化 | 509,199 | 9,313,249.71 | 0.42 |
| 3 | 600198 | 大唐电信 | 1,000,100 | 8,430,843.00 | 0.38 |
| 4 | 600261 | 阳光照明 | 500,000 | 8,250,000.00 | 0.37 |
| 5 | 600153 | 建发股份 | 999,903 | 7,319,289.96 | 0.33 |
| 6 | 000895 | 双汇发展 | 100,000 | 6,890,000.00 | 0.31 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 97,565,000.00 | 4.39 |
| 2 | 央行票据 | 129,899,000.00 | 5.85 |
| 3 | 金融债券 | 90,571,000.00 | 4.08 |
| | 其中：政策性金融债 | 90,571,000.00 | 4.08 |
| 4 | 企业债券 | 1,101,387,571.19 | 49.61 |
| 5 | 企业短期融资券 | 263,557,000.00 | 11.87 |
| 6 | 中期票据 | 212,066,000.00 | 9.55 |
| 7 | 可转债 | 31,961,133.50 | 1.44 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,927,006,704.69 | 86.79 |

5、报告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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 1101032 | 11央行票据32 | 1,000,000 | 100,880,000.00 | 4.54 |
| 2 | 1280089 | 12联泰债 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 4.50 |
| 3 | 1180082 | 11广汇集团债 | 900,000 | 90,819,000.00 | 4.09 |
| 4 | 1182401 | 11梅花MTN1 | 700,000 | 71,582,000.00 | 3.22 |
| 5 | 122092 | 11大秦01 | 600,000 | 60,768,000.00 | 2.74 |

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告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。

8、投资组合报告附注

(1) 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

(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。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 250,000.00 |

| | | |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 38,094,446.30 |
| 5 | 应收申购款 | 1,988.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 38,346,434.38 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 110012 | 海运转债 | 31,335,133.50 | 1.41 |

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600780 | 通宝能源 | 14,346,735.20 | 0.65 | 重大资产重组 |
| 2 | 600198 | 大唐电信 | 8,430,843.00 | 0.38 | 重大资产重组 |
| 3 | 600261 | 阳光照明 | 8,250,000.00 | 0.37 | 非公开发行 |
| 4 | 000895 | 双汇发展 | 6,890,000.00 | 0.31 | 重大资产重组 |

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为 2011 年 12 月 31 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2011年4月19日至 2011年12月31日 | -2.60% | 0.20% | 3.34% | 0.00% | -5.94% | 0.20% |

十四、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

4、过渡期内本基金不计提管理费和托管费。

5、若保本期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2011年12月2日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；
- 2、在“二、释义”部分，更新了“《销售办法》”的释义；
- 3、更新了“三、基金管理人”的相关信息；
- 4、更新了“四、基金托管人”的相关信息；
- 5、更新了“五、相关服务机构”的相关信息；
- 6、更新了“十、基金的投资”中基金投资组合报告为本基金2012年第1季度报告的内容；
- 7、更新了“十一、基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核；
- 8、更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”的相关信息；
- 9、更新了“二十三、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇一二年六月二日