

国泰金马稳健回报证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2015 年第二号)

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

重要提示

国泰金马稳健回报证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2004 年 4 月 27 日发布的证监基金字[2004]62 号文批准发起设立。本基金的基金合同于 2004 年 6 月 18 日成立正式生效。

国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金的基金合同已经根据《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》及其它有关规定作了修订并已于中国证监会指定报刊或网站进行了公告。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 12 月 18 日，投资组合报告为 2015 年 3 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日。

第一节 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

成立日期：1998 年 3 月 5 日

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：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16-19 楼

法定代表人：唐建光

注册资本：1.1 亿元人民币

联系人：何晔

联系电话：021-31089000，4008888688

基金管理人股权结构如下：

| 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 2015 年 12 月 18 日，本基金管理人共管理 57 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长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、国泰保本混合型证券投资基金、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）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、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、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、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、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、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、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、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）、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、国泰生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）、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金。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

唐建光，董事长，大学本科，高级工程师。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月起在中国建银投资有限责任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010年11月至2014年10月任国泰基金管理有限责任公司监事会主席，2014年8月起任公司党委书记，2015年8月起任公司董事长、法定代表人。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006年7月起在中国建银投有限责任公司工作，先后任股权管理部业务副经理、业务经理，资本市场部业务经理，策略投资部助理投资经理，公开市场投资部助理投资经理，战略发展部业务经理、组负责人，现任战略发展部处长。2014年5月起任公司董事。

陈川，董事，博士研究生，经济师。2001年7月至2005年8月，在中国建设银行总行工作，历任中间业务部、投资银行部、公司业务部业务副经理、业务经理。2005年8月至2007年6月，在中国建银投资有限责任公司工作，历任投资银行部、委托代理业务部业务经理、高级副经理。2007年6月至2008年5月，在中投证券资本市场部担任执行总经理。2008年5月至2012年6月，在中国建银投资有限责任公司工作，历任投资银行部高级经理、投资部高级经理、企业管理部高级经理。2012年6月至2012年9月，任建投科信科技股份有限公司副总经理。2012年9月至2013年4月，任中建投租赁有限责任公司纪委书记、副总经理。2013年4月至2014年1月，任中国建银投资有限责任公司长期股权投资部总经理。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部业务总监。2014年5月起任公司董事。

Santo Borsellino，董事，硕士研究生。1994-1995年在BANK OF ITALY负责经济研究；1995年在UNIVERSITY OF BOLOGNA任金融部助理，1995-1997年在ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP – SOFIPA SpA任金融分析师；1999-2004年在LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL任股票保险研究员；2004-2005年任URWICK CAPITAL LLP合伙人；2005-2006年在CREDIT SUISSE任副总裁；2006-2008年在EURIZONCAPITAL SGR SpA历任研究员/基金经理。2009-2013年任GENERALI INVESTMENTS EUROPE权益部总监。2013年6月起任GENERALI INVESTMENTS EUROPE总经理。2013年11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）。1989年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994年起任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002年起任中意人寿保险有限公司董事。2007年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。2010年6月起任公司董事。

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。1994年3月至2002年2月在中国电力信托投资有限公司工作，历任经理部项目经理，证券部项目经理，北京证券营业部副经理，天津证券营业部副经理、经理。2002年2月起在中国电力财务有限公司工作，先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记，现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。2012年4月起任公司董事。

张峰，董事，硕士研究生，16年证券从业经历。1987年7月至1999年3月就职于国家计划委员会，历任产业经济研究所科员、政研室经济分析处副处长、财金司综合处处长。1999年3月至2001年7月在嘉实基金管理有限公司工作，任研究部副总监、市场部总监。2001年7月至2002年4月在中保集团资产管理公司，任总经理助理。2002年4月至2015年4月在嘉实基金管理有限公司工作，历任督察长、副总经理兼首席市场官。2015年5月加入国泰基金管理有限公司，2015年8月起任公司总经理及公司董事。

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、院长，兼任全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、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、大连仲裁委员会仲裁员等职。2013年起兼任金诚信矿业管理股份有限公司（目前已上市）独立董事，2015年5月起兼任北京采安律师事务所兼职律师。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月起任公司独立董事。

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月起任公司独立董事。

常瑞明，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起在工商银行河北省工作，历任河北沧州市支行主任、副行长；河北省分行办公室副主任、信息处处长、副处长；河北保定市分行行长、党组副书记、书记；河北省分行副行长、行长、党委书记；2004年起任工商银行山西省分行行长、党委书记；2007年起任工商银行工会工作委员会常务副主任；2010年至2014年任北京银泉大厦董事长。2014年10月起任公司独立董事。

（二）监事会成员：

梁凤玉，监事会主席，硕士研究生，高级会计师。1994年8月至2006年6月，先后建设

银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作，任业务经理、副行长、副总经理等职。2006年7月至2007年3月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007年4月至2008年2月在中国投资咨询公司任财务总监。2008年3月至2012年8月在中国建银投资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012年9月至2014年8月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014年12月起任公司监事会主席。

Yezi Phiroze Chinoy, 监事, 大学本科。1995年12月至2000年5月在Jardine Fleming India任公司秘书及法务。2000年9月至2003年2月, 在Dresdner Kleinwort Benson任合规部主管、公司秘书兼法务。2003年3月至2008年1月任JP Morgan Chase India 合规部副总经理。2008年2月至2008年8月任Prudential Property Investment Management Singapore 法律及合规部主管。2008年8月至2014年3月任Allianz Global Investors Singapore Limited 东南亚及南亚合规部主管。2014年3月17日起任Generall Investments Asia Limited 首席执行官。

刘顺君, 监事, 硕士研究生, 高级经济师。1986年7月至2000年3月在中国人民解放军军事经济学院工作, 历任教员、副主任。2000年4月至2003年1月在长江证券有限责任公司工作, 历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003年1月至2005年5月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005年6月起在中国电力财务有限公司工作, 先后任金融租赁公司筹建处综合部主任, 营业管理部主任助理, 华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席, 福建业务部副主任、主任, 现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012年4月起任公司监事。

李辉, 监事, 大学本科。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司, 2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司, 2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司, 2005年7月至2007年7月任职于AIG集团, 2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司, 先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人。现任公司总经理助理、人力资源部(财富大学)及行政管理部负责人。2013年11月起任公司职工监事。

束琴, 监事, 大专学历。1980年3月至1992年3月分别任职于人民银行安康地区分行和工商银行安康地区分行, 1993年3月至2008年8月任职于陕西省住房资金管理中心。2008年8月加入国泰基金管理有限公司, 先后担任行政管理部主管、总监助理。现任公司行政部副总监。2013年11月起任公司职工监事。

邓时锋, 监事, 硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司, 历任行业研究员、社保111组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理, 2008年4月起任国泰金鼎价值精选证券投资基金的基金经理, 2009年5月起兼任国泰区位优势混合型证券投资基金(原国泰区位优势股票型证券投资基金)的基金经理, 2013年9月

至2015年3月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）的基金经理。2015年8月起任公司职工监事。

（三）高级管理人员：

唐建光，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

张峰，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，22年证券基金从业经历。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。2007年12月加入国泰基金管理有限公司，2008年12月起担任公司副总经理，2015年8月31日起代任公司督察长。

周向勇，硕士研究生，19年金融从业经历。1996年7月至2004年12月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004年12月至2011年1月在中国建银投资公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011年1月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012年11月起任公司副总经理。

陈星德，博士，13年证券基金从业经历。曾就职于江苏省人大常委会、中国证券监督管理委员会、瑞士银行环球资产管理香港公司和国投瑞银基金管理有限公司。2009年1月至2015年11月就职于上投摩根基金管理有限公司，历任督察长、副总经理。2015年12月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

（四）本基金的基金经理

1、现任基金经理

王航，男，硕士研究生，CFA，14年证券基金从业经验。曾任职于南方证券有限公司；2003年1月加盟国泰基金管理有限公司；历任社保111组合基金经理助理、国泰金鹿保本基金和国泰金象保本基金经理助理、国泰金马稳健混合的基金经理助理、国泰金牛创新股票的基金经理助理；2008年5月至2012年1月任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2010年4月至2014年9月兼任金鑫证券投资基金的基金经理，2011年8月起兼任国泰事件驱动策略混合型证券投资基金（原国泰事件驱动策略股票型证券投资基金）的基金经理，2013年9月至2015年2月兼任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2014年2月至2015年3月兼任国泰策略驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2014年3月起兼任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2014年9月起兼任国泰金鑫股票型证券投资基金（原金鑫证券投资基金）的基金经理。2013年9月至2014年3月任投资副总监，2014年3月起任权益投资总监。

2、历任基金经理

2004年6月至2008年3月，由何江旭担任基金经理；2008年4月至2011年1月27日由余荣权、程洲担任基金经理，2011年1月28日起由程洲担任基金经理，2013年11月18日起至2014年3月17日由程洲和贾成东共同担任基金经理，2014年3月17日起至2015年2月25日由王航和贾成东共同担任基金经理，2015年2月26日起由王航担任本基金的基金经理。

（五）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，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。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：

主任委员：

张峰：总经理、董事

委员：

周向勇：副总经理

黄焱：总经理助理兼投资总监兼权益投资（事业）部总经理

吴晨：绝对收益投资（事业）部副总监

张则斌：权益投资总监

（六）上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

第二节 基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：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

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%。净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个、综合柜员占比达到84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一

级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工210余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力争，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年9月末，中国建设银行已托管537只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自

2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

第三节 相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）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：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层 | |
| | | 客户服务专线：400-888-8688，021-31089000 | |
| | | 传真：021-31081861 | 网址：www.gtfund.com |
| 2 | 国泰基金 电子交易平台 | 电子交易网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面 | |
| | | 智能手机APP平台：iphone 交易客户端、Android 交易客户端 | |
| | | 电话：021-31081738 | 联系人：李静姝 |

（二）其它销售机构

1、销售银行及券商

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|--------------|------------------------------|-----------------|
| 1 | 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 | |
| 2 | 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：客户服务中心 | 传真：010-85109219 |
| | | 网址：www.95599.cn | |
| 3 | 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：田国立 | 联系人：客户服务中心 |
| | | 客服电话：95566 | 网址：www.boc.cn |
| 4 | 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 | |
| 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：牛锡明 | 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：高天、虞谷云 | 客户服务热线：95528 |
| 8 | 华夏银行股份有 限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 | |
| | | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 | |
| | | 法定代表人：吴建 | 客户服务热线：95577 |
| | | 网址：www.hxb.com.cn | |
| 9 | 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：www.bank.ecitic.com |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 | |
| 12 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 注册地址: 北京市西城区金融大街3号 | |
| | | 法定代表人: 李国华 | 法定代表人: 李国华 |
| | | 客服电话: 95580 | 客服电话: 95580 |
| | | 网址: www.psbc.com | |
| 13 | 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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 | |
| 17 | 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 | |
| 18 | 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: 王璇 宋永成 |
| | | 电话: 0755-25188269 | 传真: 0755-25188785 |

| | | | |
|----|--------------------|--------------------------------|-----------------------|
| | | 客服电话：4001961200 | 网址：www.4001961200.com |
| 19 | 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.bankofd1.com |
| 20 | 平安银行股份有 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：王昕 |
| | | 电话：0755-22168032 | 客服电话：95511-3 或 95501 |
| | | 网址：www.bank.pingan.com | |
| 21 | 哈尔滨银行股份 有限公司 | 注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 | |
| | | 法定代表人：郭志文 | 联系人：武艳凤 |
| | | 电话：0451-86779018 | 传真：0451-86779218 |
| | | 客服电话：95537、400-60-95537 | |
| | | 网址：http://www.hrccb.com.cn | |
| 22 | 广州农村商业银 行股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 | |
| | | 法定代表：黄子励 | 联系人：戴一挥 |
| | | 电话：020-22389298 | 电话：020-22389188 |
| | | 客服电话：020-961111 | 网址：www.grcbank.com |
| 23 | 东莞农村商业银 行股份有限公司 | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 | |
| | | 法定代表：何沛良 | 联系人：何茂才 |
| | | 电话：0769-22866255 | 电话：0769-22866255 |
| | | 客服电话：0769-961122 | 网址：www.drcbank.com |
| 24 | 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 |
| 25 | 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：王常青 | 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 |

| | | | |
|----|--------------------|---|----------------------|
| 26 | 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 |
| 27 | 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：林生迎 |
| | | 电话：0755-82943666 | 传真：0755-82943636 |
| | | 网址：www.newone.com.cn | |
| | | 客服电话：400-888-8111/95565 | |
| 28 | 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：陈有安 | 联系人：田薇 |
| | | 电话：010-66568430 | 传真：010-66568990 |
| | | 客服电话：400-8888-888 | |
| | | 网址：www.chinastock.com.cn | |
| 29 | 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 | |
| 30 | 申万宏源证券有 限公司 | 注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 | |
| | | 法定代表人：李梅 | 联系人：黄莹 |
| | | 电话：021-33388211 | 客服电话：4008895523 |
| | | 网址：www.swhysc.com | |
| 31 | 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.xyzq.com.cn |
| 32 | 中信证券（浙江） 有限责任公司 | 注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层 | |
| | | 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 | |
| 33 | 万联证券有 限公司 | 注册地址: 广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层 | |
| | | 法定代表人: 张建军 | 联系人: 罗创斌 |
| | | 电话: 020-38286651 | 传真: 020-22373718-1013 |
| | | 客服电话: 400-888-8133 | 网址: www.wlzq.com.cn |
| 34 | 民生证券股份有 限公司 | 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12-18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.msizq.com |
| 35 | 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 |
| 36 | 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: 潘鑫军 | 联系人: 吴宇 |
| | | 电话: 021-63325888 | 传真: 021-63326173 |
| | | 客服电话: 95503 | 网址: www.dfzq.com.cn |
| 37 | 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 |
| 38 | 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 | |
| 39 | 光大证券股份有 限公司 | 注册地址: 上海市静安区新闻路1508号 | |
| | | 法定代表人: 薛峰 | 联系人: 刘晨 |
| | | 电话: 021-22169999 | 传真: 021-22169134 |

| | | | |
|----|------------------|--|--------------------|
| | | 客服电话：95525、10108998、400-888-8788 | |
| | | 网址：www.ebscn.com | |
| 40 | 广发证券股份有 限公司 | 注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43 | |
| | | 办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼 | |
| | | 法定代表人：孙树明 | 联系人：黄岚 |
| | | 电话：020-87555888 | 传真：020-87555305 |
| | | 客服电话：95575 | 网址：www.gf.com.cn |
| 41 | 中信证券股份有 限公司 | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场 | |
| | | 法定代表人：王东明 | 联系人：陈忠 |
| | | 电话：010-84588888 | 传真：010-84865560 |
| | | 网址：www.cs.ecitic.com | |
| 42 | 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二大街42号写字楼101 | |
| | | 办公地址：天津市河西区宾水道8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 |
| 43 | 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） | |
| | | 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 |
| 44 | 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 | |
| 45 | 长江证券股份有 | 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：027-65799999 | 传真：027-85481900 |
| | | 客服电话：95579 | 网址：www.95579.com |
| 46 | 国海证券股份有 限公司 | 注册地址：广西桂林市辅星路13号 | |
| | | 法定代表人：张雅锋 | 联系人：牛孟宇 |
| | | 电话：0755-83709350 | 传真：0755-83704850 |
| | | 客服电话：95563 | 网址：www.ghzq.com.cn |
| 47 | 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：菅明军 | 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 | |
| 48 | 中泰证券有限公 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：0531-68889185 |
| | | 客服电话：95538 | 网址：www.qlzq.com.cn |
| 49 | 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 | |
| | | 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 | |
| 50 | 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：王旭华 |
| | | 电话：0471-4972343 | 传真：0471-4961259 |
| | | 客服电话：0471-4961259 | 网址：www.cnht.com.cn |
| 51 | 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 |
| 52 | 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. | |
| | | 法定代表人：龙增来 | 联系人：刘毅 |
| | | 电话：0755-82023442 | 传真：0755-82026539 |
| | | 网址：www.china-invs.cn | |
| | | 客服电话：400-600-8008、95532 | |
| 53 | 长城国瑞证券有 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：王勇 | 联系人：赵钦 |
| | | 电话：0592-5161642 | 传真：0592-5161140 |
| | | 客服电话：0592-5163588 | 网址：www.xmzq.cn |
| 54 | 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：刘闻川 |
| | | 电话：021-68778081 | 传真 021-68778117 |
| | | 客服电话：400-820-9898 | 网址：www.cnhbstock.com |
| 55 | 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 |
| 56 | 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 | |
| 57 | 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 |
| 58 | 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：010-66045527 |
| | | 客服电话：010-66045678 | 网址：www.txsec.com |
| 59 | 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 |
| 60 | 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 |
| 61 | 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 | |
| 62 | 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 |
| 63 | 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 |
| 64 | 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 |
| 65 | 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 |
| 66 | 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 | |
| | | 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 |
| 67 | 东海证券股份有限公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 | |
| | | 法定代表人：刘化军 | 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 |
| 68 | 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 | |
| | | 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 |
| 69 | 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、95573 | |
| | | 网址：www.i618.com.cn | |
| 70 | 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 |
| 71 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街8号 | |
| | | 法定代表人：宋德清 | 联系人：黄恒 |
| | | 电话：010-58568235 | 传真：010-58568062 |
| | | 客服电话：010-58568118 | 网址：www.hrsec.com.cn |
| 72 | 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 |
| 73 | 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.jhzq.com.cn |
| 74 | 广州证券有限责任公司 | 注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主 楼10楼 20楼 | |
| | | 法定代表人：刘东 | 联系人：林洁茹 |
| | | 电话：020-88836655 | 传真：020-88836654 |
| | | 客服电话：020-961303 | 网址：www.gzs.com.cn |
| 75 | 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 |
| 76 | 浙商证券股份有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7 | |
| | | 法定代表人：吴承根 | 联系人：毛亚莉 |
| | | 电话：021-64318893 | 传真：021-64713795 |
| | | 客服电话：967777 | 网址：www.stocke.com.cn |
| 77 | 中银国际证券有限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 | |
| | | 法定代表人：许刚 | 联系人：王炜哲 |
| | | 电话：021-20328309 | 传真：021-50372474 |
| | | 客服电话：4006208888 | 网址：www.bocichina.com |
| 78 | 新时代证券有限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街1号A座8层 | |
| | | 法定代表人：马金声 | 联系人：孙恺 |
| | | 电话：010-83561149 | 传真：010-83561094 |
| | | 客服电话：4006989898 | 网址：www.xsdzq.cn |
| 79 | 西南证券股份有限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号 | |
| | | 法定代表人：余维佳 | 联系人：张煜 |
| | | 电话：023-63786141 | 传真：023-63786212 |
| | | 网址：http://www.swsc.com.cn | |

| | | | |
|----|------------------|---|----------------------|
| 80 | 国都证券有限责任公司 | 注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 | |
| | | 法定代表人：常喆 | 联系人：黄静 |
| | | 电话：010-84183333 | 传真：010-84183311-3389 |
| | | 客服电话：4008188118 | 网址：www.guodu.com |
| 81 | 开源证券有限责任公司 | 注册地址：西安市锦业路1号都市之门B座5层 | |
| | | 法定代表人：李刚 | 联系人：王姣 |
| | | 电话：029-68633210 | 客服电话：400-860-8866 |
| | | 网址：www.kysec.cn | |
| 82 | 华安证券股份有限公司 | 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座 | |
| | | 法定代表人：李工 | 联系人：汪燕 |
| | | 电话：0551-65161675 | 传真：0551-65161600 |
| | | 客服电话：4008096518 | 网址：www.huaan.com |
| 83 | 华鑫证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 | |
| | | 法定代表人：俞洋 | 联系人：王道 |
| | | 电话：021-64339000 | 传真：021-54668802 |
| | | 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918 | |
| | | 网址：www.cfsc.com.cn | |
| 84 | 杭州联合农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：杭州市建国中路99号 | |
| | | 法定代表：张晨 | 联系人：仇侃宁 |
| | | 电话：0571-87923225 | 传真：0571-87923214 |
| | | 客服电话：96592 | 网址：www.urcb.com |
| 85 | 包商银行股份有限公司 | 注册地址：内蒙古包头市钢铁大街6号 | |
| | | 法定代表：李镇西 | 法定代表：刘芳 |
| | | 电话：0472-5189051 | 电话：0472-5189057 |
| | | 客服电话：96016（北京、内蒙古地区） | |
| | | 网址：www.bsb.com.cn | |
| 86 | 山东寿光农村商 | 注册地址：山东寿光市银海路19号 | |

| | | | |
|----|-------------------------|--|--------------------|
| | | 法定代表人：颜廷军 | 联系人：周淑贞 |
| | | 电话：0536-5293756 | 传真：0536-5293756 |
| | | 客服电话：0536-96633 | |
| 87 | 晋商银行股份有 限公司 | 注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座 | |
| | | 法定代表人：上官永清 | |
| | | 客服电话：95105588 | 网址：www.jshbank.com |
| 88 | 宁波银行股份有 限公司 | 注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号 | |
| | | 法定代表人：陆华裕 | |
| | | 客服电话：96528（上海地区 962528） | |
| | | 网址：www.nbcb.com.cn | |
| 89 | 浙商银行股份有 限公司 | 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号 | |
| | | 法定代表人：张达洋 | |
| | | 客服电话：95527 | |
| | | 网址：http://www.czbank.com | |
| 90 | 张家港农村商业 银行股份有限公 司 | 注册地址：张家港市人民中路 66 号 | |
| | | 法定代表人：王自忠 | 联系人：朱芳 |
| | | 电话：0512-96065 | 客服电话：0512-96065 |
| | | 传真：051256968259 | |
| | | 网址：http://www.zrcbank.com | |
| 91 | 广发银行股份有 限公司 | 注册地址：广州市东风东路 713 号 | |
| | | 法定代表人：董建岳 | |
| | | 电话：020-38322256 | 传真：020-87310955 |
| | | 客服电话：400-830-8003 | |
| | | 网址：http://www.cgbchina.com.cn/ | |
| 92 | 苏州银行股份有 限公司 | 注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号 | |
| | | 法定代表人：王兰凤 | |
| | | 电话：0512-69868390 | 传真：0512-69868370 |
| | | 客服电话：0512-96067 | |
| | | 网址： www.suzhoubank.com | |

2、第三方销售机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------------------------|------------------------------------|----------------------|
| 1 | 诺亚正行（上海） 基金销售投资顾问 有限公司 | 注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室 | |
| | | 法定代表人：汪静波 | 联系人：方成 |
| | | 电话：021-38602377 | 传真：021-38509777 |
| | | 客服电话：4008215399 | 网址：www.noah-fund.com |
| 2 | 上海好买基金销售 有限公司 | 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室 | |
| | | 法定代表人：杨文斌 | 联系人：薛年 |
| | | 电话：021-20613999 | 传真：021-68596916 |
| | | 客服电话：400-700-9665 | 网址：www.ehowbuy.com |
| 3 | 杭州数米基金销售 有限公司 | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号 | |
| | | 法定代表人：陈柏青 | 联系人：周熾旻 |
| | | 电话：0571-28829790 | 传真：0571-26698533 |
| | | 客服电话：4000-766-123 | 网址：www.fund123.cn |
| 4 | 深圳众禄基金销售 有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元 | |
| | | 法定代表人：薛峰 | 联系人：童彩平 |
| | | 电话：0755-33227950 | 传真：0755-82080798 |
| | | 客服电话：4006-788-887 | |
| | | 网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com | |
| 5 | 上海长量基金销售 投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 | |
| | | 法定代表人：张跃伟 | 联系人：敖玲 |
| | | 电话：021-58788678-8201 | 传真：021-58787698 |
| | | 客服电话：400-089-1289 | 网址：www.erichfund.com |
| 6 | 北京展恒基金销售 有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 | |
| | | 法定代表人：闫振杰 | 联系人：焦琳 |
| | | 电话：010-62020088-8288 | 传真：010-62020088-8802 |
| | | 客服电话：4008886661 | |

| | | | |
|----|------------------|--|------------------------|
| | | 网址: www.myfund.com | |
| 7 | 浙江同花顺基金销售有限公司 | 注册地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 | |
| | | 法定代表人: 凌顺平 | 联系人: 杨翼 |
| | | 电话: 0571-88911818-8565 | 传真: 0571-86800423 |
| | | 客服电话: 4008-773-776 0571-88920897 | 网址: www.5ifund.com |
| 8 | 江苏金百临投资咨询有限公司 | 注册地址: 无锡市滨湖区锦溪路 99 号 | |
| | | 法定代表: 费晓燕 | 联系人: 袁丽萍 |
| | | 电话: 0510-82758877 | 传真: 0510-88555858 |
| | | 客服电话: 0510-9688988 | 网址: www.jsjbl.com |
| 9 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 | |
| | | 法定代表: 其实 | 联系人: 朱钰 |
| | | 电话: 021-54509988-1071 | 传真: 021-64383798 |
| | | 客服电话: 4001818188 | 网址: www.1234567.com.cn |
| 10 | 万银财富(北京)基金销售有限公司 | 注册地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 | |
| | | 法定代表: 李招弟 | 联系人: 刘媛 |
| | | 电话: 010-59393923 | 传真: 010-59393074 |
| | | 客服电话: 4008080069 | 网址: www.wy-fund.com |
| 11 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 | |
| | | 法定代表: 盛大 | 联系人: 叶志杰 |
| | | 电话: 021-50583533 | 传真: 021-50583633 |
| | | 客服电话: 400-005-6355 | |
| | | 网址: www.leadfund.com.cn | |
| 12 | 鼎信汇金(北京)投资管理有限公司 | 注册地址: 北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室 | |
| | | 法定代表: 齐凌峰 | 联系人: 阮志凌 |
| | | 电话: 010-82151989 | 传真: 010-82158830 |
| | | 客服电话: 400-158-5050 | 网址: www.9ifund.com |
| 13 | 浙江金观诚财富管 | 注册地址: 杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 801 | |

| | | | |
|----|----------------------|---|----------------------|
| | 理有限公司 | 法定代表人：陆彬彬 | 联系人：鲁盛 |
| | | 电话：0571-56028617 | 传真：0571-56899710 |
| | | 客服电话：400-068-0058 | |
| | | 网址：www.jincheng-fund.com | |
| 14 | 嘉实财富管理有限 公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 | |
| | | 法定代表人：赵学军 | 联系人：张倩 |
| | | 电话：021-20289890 | 客服电话：400-021-8850 |
| | | 传真：021-20280110、010-85097308 | |
| | | 网址：www.harvestwm.cn | |
| 15 | 宜信普泽投资顾问 （北京）有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 | |
| | | 法定代表人：沈伟桦 | 联系人：王巨明 |
| | | 电话：010-52858244 | 传真：010-85894285 |
| | | 客服电话：400-6099-500 | 网址：www.yixinfund.com |
| 16 | 一路财富（北京） 信息科技有限公司 | 办公地址：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208 | |
| | | 客户服务热线：400-001-1566 | |
| | | 公司网站： http://www.yilucaifu.com | |
| 17 | 北京增财基金销售 有限公司 | 办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 | |
| | | 客户服务热线：400-001-8811 | |
| | | 公司网站： http://www.zcvc.com.cn | |
| 18 | 上海联泰资产管理 有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 | |
| | | 客户服务热线：4000-466-788 | |
| | | 公司网站： http://www.91fund.com.cn | |
| 19 | 上海汇付金融服务 有限公司 | 办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室 | |
| | | 客服电话：400-820-2819 | |
| | | 公司网站： http://a0918660.atobo.com.cn | |
| 20 | 上海陆金所资产管 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 | |

| | | | |
|----|----------------------|---|------------------|
| | 理有限公司 | 法定代表人：郭坚 | |
| | | 客户服务电话：400-821-9031 | |
| | | 网站：www.lufunds.com | |
| 21 | 泰诚财富基金销售 (大连)有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号 | |
| | | 法定代表人：林卓 | |
| | | 电话：0411-88891212 | 传真：0411-84396536 |
| | | 客服电话：4006411999 | |
| | | 网址： www.taichengcaifu.com | |
| 22 | 北京钱景财富投 资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 | |
| | | 法定代表人：赵荣春 | |
| | | 电话：010-57418829 | 传真：010-57569671 |
| | | 客服电话：400-893-6885 | |
| | | 网址： http://www.qianjing.com | |
| 23 | 北京乐融多源投 资咨询有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层 | |
| | | 法定代表人：董浩 | |
| | | 客户服务电话：400-068-1176 | |
| | | 网址： www.jimufund.com | |
| 24 | 北京微动利投资 管理有限公司 | 注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室 | |
| | | 法定代表人：梁洪军 | |
| | | 客户服务电话：400-819-6665 | |
| | | 网址： http://www.buyforyou.com.cn | |
| 25 | 深圳市新兰德证券 投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# | |
| | | 公司地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 | |

| | | | |
|----|----------------------|--|------------------|
| | | 客户服务电话：400-166-1188 | |
| | | 网址： http://8.jrj.com.cn/ | |
| 26 | 上海凯石财富基金销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 | |
| | | 法定代表人：陈继武 | 联系人：李晓明 |
| | | 电话：021-63333319 | 传真：021-63333390 |
| | | 客服电话：4000-178-000 | |
| | | 网址： www.lingxianfund.com | |
| 27 | 深圳富济财富管理 有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 | |
| | | 法定代表人：齐小贺 | 联系人：马力佳 |
| | | 电话：0755-83999907-815 | 传真：0755-83999926 |
| | | 客服电话：0755-83999907 | |
| | | 网址： www.jinqianwo.cn | |
| 28 | 江苏江南农村商业 银行股份有限公司 | 注册地址：常州市和平中路413号 | |
| | | 法定代表人：陆向阳 | 联系人：包静 |
| | | 电话：0519-89995170 | 传真：0519-89995170 |
| | | 客服电话：(0519)96005 | |
| | | 网址： www.jnbank.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：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16-19楼 | |
| | | 法定代表人：唐建光 | 传真：021-31081800 |
| | | 联系人：何晔 | |
| | | 客户服务专线：400-888-8688，021-31089000 | |

三、律师事务所和经办律师

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|----------------|---------------------------------|-------------|
| 1 | 北京市金杜律师事 务所 | 注册地址：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层 | |
| | | 负责人：王玲 | 联系人：王建平、王恩顺 |

| | | | |
|--|--|-----------------|-----------------|
| | | 电话：010-58785588 | 传真：010-58785599 |
| | | 经办律师：王建平、王恩顺 | |

四、会计师事务所和经办注册会计师

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|----------------------|----------------------------------|------------------|
| 1 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼 | |
| | | 执行事务合伙人：李丹 | 联系人：黄靖婷 |
| | | 联系电话：（021）23238888 | 传真：（021）23238800 |
| | | 经办注册会计师：许康玮、黄靖婷 | |

第四节 基金的名称

国泰金马稳健回报证券投资基金

第五节 基金的类型和存续期限

一、基金存续期间

不定期

二、基金类型

契约型开放式

第六节 投资目标

通过股票、债券资产和现金类资产的合理配置，高度适应中国宏观经济的发展变化。紧盯不同时期对中国GDP增长具有重大贡献或因GDP的高速增长而获得较大受益的行业和上市公司，最大程度地分享中国宏观经济的成长成果，为基金份额持有人谋求稳健增长的长期回报。

第七节 投资范围

限于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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金组合投资的基本范围：股票资产 40%-95%；债券资产 55%-0；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。如果法律法规对投资比例限制有最新规定的，本基金从其规定。

第八节 投资策略

本基金采取定性与定量分析相结合的方式，通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险；通过对不同时期与 GDP 增长密切相关的投资、消费、进出口等因素的深层研究，准确预期并把握对 GDP 增长贡献度大及受 GDP 增长拉动受益度大的重点行业及上市公司；通过个股选择，挖掘具有成长潜力且被当前市场低估的重点上市公司。在债券投资方面，主要基于长期利率趋势以及中短期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资管理。

第九节 业绩比较基准

业绩基准=60%×【上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均】+40%×【上证国债指数】（在其它较理想的业绩基准出现以后，经一定程序会对现有业绩基准进行替换）

第十节 风险收益特征

本基金属于中低风险的平衡型基金产品，基金的预期收益高于债券型基金，风险程度低于激进的股票型基金。

第十一节 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月21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2015年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）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 | 1,002,576,496.91 | 80.25 |
| | 其中：股票 | 1,002,576,496.91 | 80.25 |
| 2 | 固定收益投资 | 80,922,385.28 | 6.48 |
| | 其中：债券 | 80,922,385.28 | 6.48 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 161,821,518.77 | 12.95 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,942,654.06 | 0.32 |
| 8 | 合计 | 1,249,263,055.02 | 100.00 |

（二）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 | - | - |
| C | 制造业 | 486,407,086.99 | 39.07 |
| 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 | 33,620,970.16 | 2.70 |
| 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 | 27,466,706.61 | 2.21 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| J | 金融业 | 164,629,309.33 | 13.22 |
| K | 房地产业 | 111,523,363.50 | 8.96 |
| 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 | 82,565,040.00 | 6.63 |
| 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 | 96,364,020.32 | 7.74 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,002,576,496.91 | 80.53 |

（三）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 | 002739 | 万达院线 | 1,193,806 | 96,364,020.32 | 7.74 |
| 2 | 000150 | 宜华健康 | 2,425,564 | 92,389,732.76 | 7.42 |
| 3 | 002572 | 索菲亚 | 2,205,980 | 84,533,153.60 | 6.79 |
| 4 | 002508 | 老板电器 | 2,297,127 | 82,811,428.35 | 6.65 |
| 5 | 002672 | 东江环保 | 4,281,000 | 76,373,040.00 | 6.13 |
| 6 | 300203 | 聚光科技 | 2,793,562 | 67,185,166.10 | 5.40 |
| 7 | 002236 | 大华股份 | 1,566,288 | 52,956,197.28 | 4.25 |
| 8 | 600401 | *ST海润 | 21,000,000 | 47,040,000.00 | 3.78 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 2,578,354 | 37,540,834.24 | 3.02 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 1,651,813 | 36,653,730.47 | 2.94 |

（四）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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|---------------|------|
| 3 | 金融债券 | 80,654,000.00 | 6.48 |
| | 其中：政策性金融债 | 80,654,000.00 | 6.48 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 268,385.28 | 0.02 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 80,922,385.28 | 6.50 |

（五）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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 018001 | 国开1301 | 600,000 | 60,546,000.00 | 4.86 |
| 2 | 110240 | 11国开40 | 100,000 | 10,124,000.00 | 0.81 |
| 3 | 110225 | 11国开25 | 100,000 | 9,984,000.00 | 0.80 |
| 4 | 128009 | 歌尔转债 | 2,076 | 268,385.28 | 0.02 |

（六）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。

（七）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。

（八）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。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

（十一）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（除“*st 海润”公告其子公司违规情况外），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2015年4月24日上海证券交易所发布《关于对海润光伏科技股份有限公司股东、董事长兼总经理 YANG HUAIJIN（杨怀进）、股东江阴市九润管业有限公司、江苏紫金电子集团有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》，上交所决定对海润光伏科技股份有限公司股东、董事长兼总经理 YANG HUAIJIN（杨怀进）予以公开谴责；对海润光伏科技股份有限公司股东江阴市九润管业有限公司、江苏紫金电子集团有限公司和海润光伏科技股份有限公司董事李延人、任向东、吴益善、张永欣、张正，独立董事洪冬平、金曹鑫、徐小平予以通报批评。对于上述纪律处分，将抄报江苏省人民政府，并记入上市公司诚信档案。

本基金管理人此前投资*st 海润股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就*st 海润受处罚事件进行了及时分析和研究，认为*st 海润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。

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、其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,046,520.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,860,495.62 |
| 5 | 应收申购款 | 35,637.49 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 3,942,654.06 |
|---|----|--------------|

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 | 128009 | 歌尔转债 | 268,385.28 | 0.02 |

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 | 002739 | 万达院线 | 96,364,020.32 | 7.74 | 重大事项 |
| 2 | 000150 | 宜华健康 | 92,389,732.76 | 7.42 | 重大事项 |

第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为2015年6月30日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪尽职守、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 |
|----------------------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2004年6月18日至 2004年12月31日 | -3.50% | 0.62% | -6.93% | 0.81% | 3.43% | -0.19% |
| 2005年度 | -0.31% | 0.90% | 1.18% | 0.82% | -1.49% | 0.08% |
| 2006年度 | 128.01% | 1.27% | 75.25% | 0.86% | 52.76% | 0.41% |
| 2007年度 | 113.20% | 1.88% | 54.80% | 1.32% | 58.40% | 0.56% |
| 2008年度 | -53.79% | 2.66% | -44.25% | 1.70% | -9.54% | 0.96% |
| 2009年度 | 84.41% | 1.50% | 42.69% | 1.13% | 41.72% | 0.37% |
| 2010年度 | -4.71% | 1.29% | -8.66% | 0.85% | 3.95% | 0.44% |
| 2011年度 | -19.84% | 1.11% | -12.62% | 0.69% | -7.22% | 0.42% |

| | | | | | | |
|---------------------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 2012年度 | 2.44% | 0.91% | 3.20% | 0.65% | -0.76% | 0.26% |
| 2013年度 | -2.53% | 1.13% | -2.22% | 0.69% | -0.31% | 0.44% |
| 2014年度 | 11.37% | 1.09% | 30.82% | 0.64% | -19.45% | 0.45% |
| 2015年上半年 | 30.36% | 2.12% | 22.28% | 1.34% | 8.08% | 0.78% |
| 2004年6月18日至 2015年6月30日 | 341.43% | 1.48% | 161.83% | 1.01% | 179.60% | 0.47% |

第十三节 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

- （一）基金管理人的管理费；
- （二）基金托管人的托管费；
- （三）证券交易费用；
- （四）基金信息披露费用（国家另有规定的从其规定）；
- （五）基金份额持有人大会费用；
- （六）与基金相关的会计师费和律师费（国家另有规定的从其规定）；
- （七）照国家有关规定可以列入的其它费用。

二、基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（二）基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算

方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（三）上述一中（三）到（七）项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

三、与基金销售有关的费用

（一）本基金根据每次申购金额的大小，采用比例费率收取申购费，若投资人在一天之内如果同时有多笔申购，则适用费率按不同的单笔分别计算。

本基金申购费率为：

申购规模（M）

| | |
|-------------------|------------|
| 50 万元以下 | 1.5% |
| 50 万元（含）-500 万元 | 1.0% |
| 500 万元（含）-1000 万元 | 0.6% |
| 1000 万元（含）以上 | 1000 元（单笔） |

本基金的申购费用由申购人承担，由基金管理人收取，用于市场推广、销售等各项费用。

（二）本基金赎回费随基金持有时间的增加而递减，赎回费率为：

| | |
|-----------------|-------|
| 持有时间少于一年 | 0.5%； |
| 持有时间超过一年（含）少于两年 | 0.2%； |
| 持有时间超过两年（含） | 0 |

（注：1 年指 365 天，2 年为 730 天，以此类推。）

赎回费用由赎回人承担，其中 25% 归基金资产，其余部分用于支付注册登记费和手续费。

（三）转换费

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

（1）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25% 归转出基金

基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

(2) 转入基金申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

2、计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

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资产的损失，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。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等不列入基金费用。

五、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费。

六、本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十四节 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》、《公开募集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2015年8月1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、更新了“第三节 基金管理人”中的相关内容；
- 3、更新了“第四节 基金托管人”中的相关内容；
- 4、更新了“第五节 相关服务机构”中销售机构信息；
- 5、更新了“第九节 基金的投资”中基金投资组合报告，更新至2015年9月30日；
- 6、更新了“第十节 基金的业绩”，更新至2015年6月30日；

7、更新了“第二十二节 其他应披露的事项”，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

二〇一六年一月三十日