

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书摘要 (2018 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

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】364 号文）核准募集，于 2013 年 7 月 12 日至 2013 年 8 月 8 日公开募集，募集结束后本基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 12 日生效。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金的保本期最长为每 3 年一个周期，在每一个保本期内均设置该保本期的目标收益率，在运作期间，如基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日达到或超过预设目标收益率，则国泰目标收益保本混合型证券投资基金当期保本期提前到期。国泰目标收益保本混合型证券投资基金第一个保本期的目标收益率为 15%。自 2014 年 11 月 24 日起至 2014 年 12 月 12 日止国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日超过 15%，即国泰目标收益保本混合型证券投资基金已于 2014 年 12 月 12 日触发第一个保本期提前到期的条件。依据国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同的约定，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的第一个保本期提前到期并进入过渡期。过渡期结束后的下一日起，由于不再符合保本基金存续条件，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书报中国证监会备案，但并不表明中国证监会对本基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能

力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

投资有风险，投资人申购本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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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2018年7月16日，投资组合报告为2018年2季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30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：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

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：辛怡

联系电话：（021）31089000，400888688

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 2018 年 7 月 16 日，本基金管理人共管理 99 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、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（原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、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、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、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、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、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、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、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、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、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰宁益定期开放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、国泰民安增益定期开放

灵活配置混合型证券投资基金、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、国泰安心回报混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰安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。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。

（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。1982年1月至1992年10月在中国建设银行总行工作，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11月至1998年2月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月至2015年10月在国泰基金管理有限公司工作，其中1998年3月至1999年10月任总经理，1999年10月至2015年8月任董事长。2015年1月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任纪委书记，2015年3月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016年8月至11月，在建投投资有限责任公司、建投传媒华文公司任监事长、纪委书记。2016年11月起任公司党委书记，2017年3月起任公司董事长、法定代表人。

方志斌，董事，硕士研究生。2005年7月至2008年7月，任职宝钢国际经营财务部。2008年7月至2010年2月，任职金茂集团财务总部。2010年3月至今，在中国建银投资有限责任公司工作，历任长期股权投资部助理业务经理、业务经理，战略发展部业务经理、处长。2014年4月至2015年11月，任建投华科投资有限责任公司董事。2014年2月至2017年11月，任中国投资咨询有限责任公司董事。2017年12月起任公司董事。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006 年 7 月起在中国建银投资有限责任公司工作，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，战略发展部处长，现任战略发展部总经理助理。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 年至 1994 年任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994 年至 1996 年任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996 年至 1998 年任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998 年至 2017 年任忠利亚洲中国地区总经理；2002 年至今任中意人寿保险有限公司董事；2007 年至今任中意财产保险有限公司董事；2007 年至 2017 年任中意财产保险有限公司总经理；2013 年至今任中意资产管理有限公司董事；2017 年至今任忠利集团大中华区股东代表。2010 年 6 月起任公司董事。

吕胜，董事，硕士。1991 年 7 月至 1994 年 6 月，在水利水电规划设计总院任科员。1994 年 6 月至 1997 年 1 月，在电力工业部经济调节司任副主任科员、主任科员。1997 年 1 月至 2003 年 1 月，在国家电力公司财务与资产管理部任一级职员、副处长。2003 年 1 月至 2008 年 1 月，在国家电网公司建设运行部任处长。2008 年 1 月至 2008 年 8 月，在国网信息通信有限公司任总会计师、党组成员。2008 年 8 月至 2017 年 12 月在英大泰和财产保险股份有限公司任总会计师、党组成员。2017 年 12 月至今，在中国电力财务有限公司任总会计师、党委委员。2018 年 3 月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，22 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月在中国建银投资有限责任公司工作，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月至2016年7月7日任公司副总经理，2016年7月8日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，先后任助教、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。

常瑞明，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起在工商银行工作，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。

黄晓衡，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1975年7月至1991年6月，在中国建设银行江苏省分行工作，先后任职于计划处、信贷处、国际业务部，历任副处长、处长。1991年6月至1993年9月，任中国建设银行伦敦代表处首席代表。1993年9月至1994年7月，任中国建设银行纽约代表处首席代表。1994年7月至1999年3月，在中国建设银行总行工作，历任国际部副总经理、资金计划部总经理、会计部总经理。1999年3月至2010年1月，在中国国际金融有限公司工作，历任财务总监、公司管委会成员、顾问。2010年4月至2012年3月，任汉石投资管理有限公司（香港）董事总经理。2013年8月至2016年1月，任中金基金管理有限公司独立董事。2017年3月起任公司独立董事。

吴群，独立董事，博士研究生，高级会计师。1986年6月至1999年1月在中国财政研究院研究生部会计教研室工作，历任讲师、副研究员、副主任、主任。1991年起兼任中国财政研究院研究生部（财政部财政科研所研究生部）硕士生导师。1999年1月至2003年6月在沪江德勤北京分所工作，历任技术部/企业风险管理部高级经理、总监，管理咨询部总监。

2003年6月至2005年11月，在中国电子产业工程有限公司工作,担任财务部总经理。

2014年9月至2016年7月兼任中国上市公司协会军工委员会副会长，2016年8月起兼任中国上市公司协会军工委员会顾问。2005年11月至2016年7月在中国电子信息产业集团有限公司工作，历任审计部副主任、资产部副主任（主持工作）、主任。2012年3月至2016年7月，担任中国电子信息产业集团有限公司总经济师。2003年1月至2016年11月，在中国电子信息产业集团有限公司所投资的境内外多个公司担任董事、监事。2017年5月起兼任首约科技（北京）有限公司独立董事。2017年10月起任公司独立董事。

2、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，先后于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。

Yezdi 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Generali Investments Asia Limited首席执行官。2016年12月1日起任Generali Investments Asia Limited执行董事。2014年12月起任公司监事。

刘锡忠，监事，研究生。1989年2月至1995年5月，中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1995年6月至2005年6月，在华北电力集团财务有限公司工作，历任部门经理、副总经理。2005年7月起在中国电力财务有限公司工作，历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任，现任风险管理部主任。2017年3月起任公司监事。

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 月至 2018 年 3 月任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2009 年 5 月至 2018 年 3 月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 9 月至 2018 年 3 月兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任权益投资总监。2015 年 8 月起任公司职工监事。

倪莹，监事，硕士研究生。1998 年 7 月至 2001 年 3 月，任新晨信息技术有限责任公司项目经理。2001 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，历任信息技术部总监、运营管理部总监，现任公司总经理助理。2017 年 2 月起任公司职工监事。

宋凯，监事，大学本科。2008 年 9 月至 2012 年 10 月，任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012 年 12 月加入国泰基金管理有限公司，现任纪检监察室副主任、审计部总监助理。2017 年 3 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。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

陈星德，博士，16 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。

李辉，大学本科，18 年金融从业经历。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、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人，2015 年 8 月至 2017 年 2 月任公司总经理助理，2017 年 2 月起担任公司副总经理。

封雪梅，硕士研究生，20 年金融从业经历，曾就职于中国工商银行北京分行营业部、大成基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司，2015 年 1 月至 2018 年 7 月在国寿安保

基金管理有限公司工作，任总经理助理，2018 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，19 年证券从业经历。1999 年 7 月至 2014 年 2 月就职于中国证监会陕西监管局，历任稽查处副主任科员、主任科员、行政办公室副主任、稽查处二处副处长等；2014 年 2 月至 2014 年 12 月就职于中国证监会上海专员办，任副处长；2015 年 1 月至 2015 年 2 月就职于上海申乐实业控股集团有限公司，任副总经理；2015 年 2 月至 2016 年 3 月就职于嘉合基金管理有限公司，2015 年 7 月起任公司督察长；2016 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，担任公司督察长。

4、本基金的基金经理

（1）现任基金经理

艾小军，硕士，17 年证券基金从业经历。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月兼任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任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）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月兼任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金和国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程总监。

（2）历任基金经理

本基金自转型之日（2015 年 1 月 16 日）起至 2015 年 7 月 16 日由邱晓华、姜南林共同担任基金经理；自 2015 年 7 月 17 日至 2017 年 3 月 5 日由邱晓华担任本基金的基金经理；自 2017 年 3 月 6 日起至 2017 年 8 月 10 日由邱晓华、艾小军共同担任本基金的基金经理；自 2017 年 8 月 11 日起由艾小军担任本基金的基金经理。

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：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

陈星德：副总经理

吴晨：固收投资总监、绝对收益投资（事业）部总监

邓时锋：权益投资总监、权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：海外投资总监、国际业务部总监

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：田国立

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。本行于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)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016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《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等10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220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

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、

战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产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。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，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、(R)QFII、(R)QDII、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 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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 “国泰基金”微信交易平台	
		电话：021-31081738	联系人：李静姝

2、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：周慕冰	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	
2	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：陈四清	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址：www.boc.cn
3	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：田国立	客服电话：95533
		网址：www.ccb.com	
4	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：李建红	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
5	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市中山东一路12号	
		办公地址：上海市中山东一路12号	
		法定代表人：高国富	电话：021-61618888
		联系人：高天、虞谷云	客户服务热线：95528
6	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
7	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

8	渤海银行股份 有限公司	注册地址：天津市河东区海河东路 218 号	
		法定代表人：李伏安	联系人：陈玮
		客服电话：95541	传真：022-58316259
		网址：www.cbhb.com.cn	
9	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
10	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：吴昊、冯小航
		电话：0451-86779608	传真：0451-86779218
		客服电话：95537	网址：www.hrbb.com.cn
11	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：王继康	联系人：卢媛薇、陈捷
		客服电话：95313	电话：020-28852729
		网址：www.grcbank.com	
12	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：林培珊、杨亢
		客服电话：0769-961122	电话：0769-22866254
		网址：www.drcbank.com	
13	国泰君安证券股 份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	
		法定代表人：杨德红	联系人：芮敏祺
		电话：021-38676161	传真：021-38670161
		客服电话：95521	网址：www.gtja.com
14	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：许梦园
		电话：010-85156398	传真：010-65182261
		客服电话：95587 4008-888-108	网址：www.csc108.com

15	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：周杨
		电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
		客服电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
16	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：黄婵君
		电话：0755-82960167	传真：0755-83734343
		网址：www.newone.com.cn	
		客服电话：400-888-8111/95565	
17	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：邓颜
		电话：010-66568292	传真：010-66568990
		客服电话：400-8888-888	
		网址：www.chinastock.com.cn	
18	海通证券股份有 限公司	注册地址：上海市广东路 689 号	
		法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
		电话：021-23219000	传真：021-63602722
		客服电话：95553	
		网址：www.htsec.com	
19	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：95523 4008895523
		网址：www.swhysc.com	
20	万联证券有限责 任公司	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：甘蕾
		电话：020-38286026	传真：020-38286588
		客服电话：400-888-8133	网址：www.wlzq.com.cn
21	东吴证券股份有 限公司	注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号	
		法定代表人：范力	联系人：陆晓

		电话：0512-62938521	传真：0512-65588021
		全国客服电话：95330	网址：www.dwzq.com.cn
22	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
23	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：徐丽峰	联系人：周欣玲
		电话：0791-86281305	传真：0791-86281305
		网址：www.gsstock.com	
24	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、李芳芳
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：95525、10108998、400-888-8788	
		网址：www.ebscn.com	
25	广发证券股份 有限公司	注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室	
		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
26	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（二期）北座	
		法定代表人：张佑君	联系人：侯艳红
		电话：010-60838888	传真：010-60836029
		网址：www.cs.ecitic.com	
27	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 室	
		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
28	中信证券（山东） 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：赵艳青
		电话：0532-85023924	传真：0532-85022605
		客服电话：95548	网址：www.citicssd.com
29	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：崔少华	联系人：奚博宇
		电话：027-65799999	传真：027-85481900
		客服电话：95579	网址：www.95579.com
30	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
31	中泰证券股份有 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.zts.com.cn
32	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：王连志	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	
33	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

34	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：高涛	联系人：张鹏
		电话：0755-82023442	传真：0755-82026539
		网址：www.china-invs.cn	
		客服电话：400-600-8008、95532	
35	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.xmqz.cn
36	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
37	中国国际金融股 份有限公司	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	
38	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
39	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
40	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	
41	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
42	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
43	平安证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层	
		法定代表人：谢永林	联系人：周一涵
		电话：021-38637436	传真：021-33830395
		客服电话：95511-8	网址：stock.pingan.com
44	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
45	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	
46	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
47	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
48	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塔19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
49	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：www.swsc.com.cn	
50	国都证券股份有 限公司	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
51	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
52	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	
		客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918	
		网址：www.cfsc.com.cn	
53	国金证券股份有限 公司	注册地址：四川省成都市东城根上街95号	
		办公地址：四川省成都市东城根上街95号	
		法定代表人：冉云	联系人：贾鹏
		电话：028-86690058	传真：028-86690126
		客户服务电话：4006600109	网址：www.gjq.com.cn

54	中信期货有限公司	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（二期）北座13层1301-1305室、14层	
		办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层	
		法定代表人：张皓	联系人：洪诚
		电话：0755-23953913	传真：0755-83217421
		网址：www.citicsf.com	
55	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	
		法定代表人：李季	联系人：王怀春
		电话：0991-2307105	传真：0991-2301927
		客服电话：4008000562	网址： www.hysec.com
56	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	
		办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	
		法定代表人：杨炯洋	联系人：谢国梅
		联系电话：010-52723273	传真：028-86150040
		客户服务电话：95584	网址： www.hx168.com.cn
57	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
58	山东寿光农村商业银行股份有限公司	注册地址：山东寿光市银海路19号	
		法定代表：颜廷军	联系人：周淑贞
		电话：0536-5293756	传真：0536-5293756
		客服电话：0536-96633	
59	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：阎俊生	
		客服电话：95105588	网址： www.jshbank.com
60	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：www.czbank.com	
61	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：www.zrcbank.com	
62	广发银行股份有限公司	注册地址：广东省越秀区东风东路 713 号	
		法定代表人：杨明生	
		电话：020-38322888	传真：020-87310955
		客服电话：400-830-8003	
		网址：www.cgbchina.com.cn	
63	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：0512-69868365	传真：0512-69868370
		客服电话：0512-96067	
		网址： www.suzhoubank.com	
64	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	

(2) 第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息	
1	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室	
		办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋	
		法定代表人：汪静波	联系人：李娟
		电话：021-38602377	传真：021-38509777

		客服电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
2	上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	
		办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906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	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室	
		办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F	
		法定代表人：陈柏青	联系人：韩爱彬
		电话：0571-28829790	传真：0571-26698533
		客服电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
4	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	
		办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	
		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	
		办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层	
		法定代表人：张跃伟	联系人：何昶
		电话：021-58788678-8201	传真：021-58787698
		客服电话：400-820-2899	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	注册地址：杭州市文二西路1号903室	

	销售公司	办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼	
		法定代表人：凌顺平	联系人：杨翼
		电话：0571-88911818-8653	传真：0571-86800423
		客服电话：4008-773-772 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 号楼二层	
		办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座	
		法定代表：其实	联系人：朱钰
		电话：021-54509977	传真：021-64383798
		客服电话：4001818188	网址：www.1234567.com.cn
10	众升财富（北京） 基金销售有限公 司	注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室	
		办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08	
		法定代表：李招弟	联系人：李艳
		电话：010-59497361	传真：010-64788016
		客服电话：400-876-9988	网址：www.zscffund.com
11	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	
		办公地址：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
12	浙江金观诚基金 销售有限公司	注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室	
		办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚 财富	
		法定代表：徐黎云	联系人：孙成岩
		电话：0571-88337888	传真：0571-56899710

		客服电话：400-068-0058	
		网址：www.jincheng-fund.com	
13	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	
14	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：400-6099-200	网址：www.yixinfund.com
15	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	
		办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
		法定代表人：吴雪秀	联系人：徐越
		客服电话：400-001-1566	联系电话：010-88312877
		网址：www.yilucaifu.com	
16	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	
		办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层	
		法定代表人：燕斌	联系人：兰敏
		电话：021-52822063	传真：021-52975270
		客服电话：400-166-6788	网址：www.66zichan.com
17	汇付基金销售有 限公司	注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层	
		办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼	
		法定代表人：金佶	联系人：陈云卉
		客服电话：400-821-3999	
		手机客户端：天天盈基金	
18	上海陆金所基金	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	

	销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼	
		法定代表人：鲍东华	
		客户服务电话：400-821-9031	
		网站：www.lufunds.com	
19	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公园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	
20	北京钱景基金销售有限公司	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：www.qianjing.com	
21	北京虹点基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元	
		办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层	
		法定代表人：胡伟	
		客户服务电话：400-618-0707	
		网址：www.hongdianfund.com	
22	北京微动利基金销售有限公司	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：www.buyforyou.com.cn	
23	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704	
		公司地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层	

		客户服务电话：400-166-1188	
		法定代表人：张彦	联系人：文雯
		电话：010-83363101	
		网址：8. jrj. com. cn	
24	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：陈继武	联系人：李晓明
		电话：021-63333319	传真：021-63333390
		客服电话：4006-433-389	
		网址：www. lingxianfund. com	
25	深圳富济财富管理有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位	
		办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位	
		法定代表：刘鹏宇	联系人：杨涛
		电话：0755-83999907-815	传真：0755-83999926
		客服电话：0755-83999907	
		网址：www. jinqianwo. cn	
26	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491	
		办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 单元	
		法定代表：肖雯	联系人：李孟军
		电话：18500050725	传真：021-63333390
		客服电话：020-89629099	
		网址：www. yingmi. cn	
27	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	
		办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	
		法定代表：李昭琛	联系人：付文红
		电话：010-62676405	传真：010-82607151
		客服电话：010-62675369	
		网址：www. xincai. com	

28	上海万得基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座	
		法定代表人：王廷富	联系人：姜吉灵
		电话：021-51327185	传真：021-50710161
		客服电话：400-821-0203	
		网址：www.520fund.com.cn	
29	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号	
		办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号（苏宁总部）	
		法定代表人：钱燕飞	联系人：喻明明
		电话：025-66996699-884131	传真：025-66008800-884131
		客服电话：95177	
		网址：www.snjijin.com	
30	北京汇成基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108	
		法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
		电话：010-56282140	传真：010-62680827
		客服电话：400-619-9059	
		网址：www.hcjijin.com	
31	天津万家财富资产管理有限公司	办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋大厦 A 座 5 层	
		法定代表人：李修辞	联系人：邵玉磊
		电话：010-59013795	
		网址：www.wanjiawealth.com	
32	北京创金启富基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A	
		法定代表人：梁蓉	联系人：李婷婷
		电话：010-66154828	传真：010-63583991
		客服电话：400-6262-818	
		网址：www.5irich.com	
33	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室	
		办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室	
		法定代表人：李悦章	联系人：曹庆展

		电话：010-68983311	传真：010-65983333
		客服电话：400-066-8586	
		网址：www.igesafe.com	
34	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06	
		办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院	
		法定代表人：江卉	联系人：赵德赛
		电话：010-89188343	客服电话：95118
		网址：fund.jd.com	
35	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	
		办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507	
		法定代表人：钟斐斐	联系人：戚晓强
		电话：010-61840688	传真：010-61840699
		客服电话：4000618518	
		APP下载网址：danjuanapp.com	
36	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室	
		办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室	
		法定代表人：周斌	联系人：张鼎
		电话：010-59313555	传真：010-59313586
		客服电话：4008980618	
		网址：www.chtwm.com	
37	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室	
		办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层	
		法定代表人：李一梅	联系人：仲秋玥
		电话：010-88066632	传真：010-88066552
		客服电话：400-817-5666	
		网址：www.amcfortune.com	
38	通华财富（上海）基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室	
		办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融	

		广场3号楼9楼	
		法定代表人：兰奇	联系人：庄洁茹
		电话：021-60818110	客服电话：95156转5
		网址：www.tonghuafund.com	
39	北京植信基金销售有限公司	注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67	
		办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号	
		法定代表人：于龙	联系人：吴鹏
		电话：010-56075718	传真：010-67767615
		客服电话：4006-802-123	
		网址：www.zhixin-inv.com	
40	和耕传承基金销售有限公司	注册地址：郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间	
		办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6F	
		法定代表人：李淑慧	联系人：胡静华
		电话：0371-85518396	传真：0371-85518397
		客服电话：4000-555-671	
		网址：www.hgccpb.com	
41	腾安基金销售（深圳）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	
		办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦	
		法定代表人：刘明军	
		联系人：白冰	电话：15112686889
		客服电话：95017	网址：tenganxinxi.com
42	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室	
		办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层	
		法定代表人：钱昊旻	传真：010-59336586
		联系人：徐英	电话：010-59336539
		客服电话：4008909998	网址：www.jnlc.com

（二）登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

法定代表人：陈勇胜

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元

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

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：魏佳亮

经办注册会计师：许康玮、魏佳亮

四、基金的名称

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型和运作方式

1、基金类型：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、投资目标

本基金力图通过灵活的大类资产配置，积极把握个股的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

七、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、资产支持证券、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的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

其中，股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%以上；其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。

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。

八、投资策略

1、资产配置策略

本基金管理人依据 Melva 资产评估体系，通过考量宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关变量指标的变化，评估确定一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

2、股票投资策略

（1）盈利能力股票筛选

本基金的股票资产投资主要以具有投资价值的股票作为投资对象，采取自下而上精选个股策略，利用 ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司，构成具有盈

利能力的股票备选池。

（2）价值评估分析

本基金通过价值评估分析，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票池。价值评估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，基金管理人根据不同行业特征和市场特征灵活进行运用，努力为从估值层面持有人发掘价值。

（3）实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过对上市公司的外部合作机构和相关行政管理部门进一步调研，对上述结论进行核实。

（4）投资组合建立和调整

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，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品种的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

3、债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下稳健的超额收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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，将对证券市场 and 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。

基金管理人应当在季度报告、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。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$

采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要基于以下原因：

1、沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。

2、该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。

3、沪深 300 指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度，且指数历史表现强于市场平均收益水平。

因此，沪深 300 指数是衡量该混合型基金股票投资业绩的理想基准。同时，根据目标资产配置比例，业绩比较基准中加入了中证全债指数并按照该混合型基金的目标资产配置比例来安排。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。

十、风险收益特征

本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

十一、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2018年7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2018年6月30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	31,026,640.00	70.56
	其中：股票	31,026,640.00	70.56
2	固定收益投资	1,203,530.00	2.74
	其中：债券	1,203,530.00	2.74
	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金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,708,266.14	26.63
7	其他资产	34,490.30	0.08
8	合计	43,972,926.44	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	2,062,662.00	4.73
B	采矿业	649,000.00	1.49
C	制造业	13,591,012.00	31.14

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	844,800.00	1.94
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	4,295,450.00	9.84
J	金融业	9,241,446.00	21.17
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	342,270.00	0.78
S	综合	-	-
	合计	31,026,640.00	71.09

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	601318	中国平安	50,000	2,929,000.00	6.71
2	601233	桐昆股份	112,000	1,928,640.00	4.42
3	600036	招商银行	70,000	1,850,800.00	4.24
4	002142	宁波银行	96,300	1,568,727.00	3.59
5	002410	广联达	50,000	1,386,500.00	3.18
6	002714	牧原股份	30,000	1,333,800.00	3.06
7	600570	恒生电子	25,000	1,323,750.00	3.03
8	002456	欧菲科技	80,000	1,290,400.00	2.96
9	600196	复星医药	29,200	1,208,588.00	2.77
10	000001	平安银行	120,000	1,090,800.00	2.50

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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,203,530.00	2.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,203,530.00	2.76

5. 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	110042	航电转债	5,000	525,750.00	1.20
2	113014	林洋转债	3,000	270,720.00	0.62
3	128028	赣锋转债	2,000	207,940.00	0.48
4	110040	生益转债	2,000	199,120.00	0.46

6. 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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 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。

10. 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。

11. 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“招商银行”和“宁波银行”深圳分行违规外）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。

根据2018年5月4日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字（2018）1号，招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户、为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保、未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目、高管人员在获得任职资格核准前履职、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务、未严格审查贸易背景真实性开立信用证、违规签订保本合同销售同业非保本理财产品、非真实转让信贷资产、违规向典当行发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等共计十四项违规事实。中国银监会决定对其罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。

根据深银监罚决字（2017）1号，宁波银行深圳分行存在商业汇票线下转贴现业务未按规定记账、票据代理转贴现业务未按规定记账并计量风险加权资产等行为，违反了相关法律法规，深圳银监局对其罚款170万元。

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。

（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	8,075.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,525.29
5	应收申购款	12,889.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,490.30

(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	110042	航电转债	525,750.00	1.20
2	113014	林洋转债	270,720.00	0.62
3	128028	赣锋转债	207,940.00	0.48
4	110040	生益转债	199,120.00	0.46

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

本基金业绩截止日为2018年6月30日，并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪守信守、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
2015年1月16日至 2015年12月31日	49.90%	2.71%	7.23%	1.50%	42.67%	1.21%
2016年度	-9.47%	1.70%	-5.64%	0.84%	-3.83%	0.86%

2017年度	3.46%	0.81%	12.53%	0.39%	-9.07%	0.42%
2018年上半年	-16.38%	1.15%	-6.18%	0.69%	-10.20%	0.46%
2015年1月16日至 2018年6月30日	17.40%	1.80%	6.82%	0.97%	10.58%	0.83%

注：2015年1月16日为基金合同生效日

十三、基金的费用与税收

（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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初3个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对基金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 2018 年 2 月 28 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“一、绪言”中的相关信息；
- 3、更新了“二、释义”中的相关信息；
- 4、更新了“三、基金管理人”中的相关信息；
- 5、更新了“四、基金托管人”中的相关信息；
- 6、更新了“五、相关服务机构”中的相关信息；

- 7、更新了“八、基金份额的申购与赎回”中的相关信息；
- 8、更新了“九、基金的投资”中基金投资组合报告，为本基金 2018 年 2 季度报告的内容；
- 9、更新了“十、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；
- 10、更新了“十二、基金资产的估值”中的相关信息；
- 11、更新了“十六、基金的信息披露”中的相关信息；
- 12、更新了“十七、风险揭示”中的相关信息；
- 13、更新了“二十、托管协议的内容摘要”中的相关信息；
- 14、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中的相关信息；
- 15、更新了“二十二、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
二〇一八年八月二十九日