

# 国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）

## 更新招募说明书摘要

（2019年第一号）

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

### 重要提示

国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2009年12月3日证监许可[2009]1295号文核准募集。《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2010年2月10日正式生效。

根据基金合同的有关规定，本基金的封闭期于2013年2月18日届满，基金管理人国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）向深圳证券交易所申请终止本基金估值优先、估值进取基金份额上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上（2013）61号）的同意，自本基金封闭期届满日次日（2013年2月19日）起，本基金的估值优先、估值进取基金份额终止上市。

封闭期届满后，基金管理人按照基金合同的约定，将估值优先份额和估值进取份额转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额，本基金的基金名称变更为国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF），基金简称和基金代码不变，基金简称仍为“国泰估值”，基金代码仍为“160212”。

本基金转换完成后，基金合同中除仅适用于国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的条款外，继续适用于转换后的国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）。

根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及本基金基金合同的约定，本基金自2015年8月8日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由“国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）”修改为“国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）”，基金合同部分条款相应修订。

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。

在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投

资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素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，由于基金投资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等。投资有风险，投资者认购（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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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2019年2月10日，投资组合报告为2018年4季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31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

设立日期：1998年3月5日

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

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：021-31089000, 4008888688

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2019年2月10日，本基金管理人共管理100只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值

精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合型证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰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、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰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、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金

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、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合型证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金。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

#### （一）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月起调入国泰基金管理有限公司任公司党委书记，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，23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月任公司副总经理，2016年7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，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月任中国上市公司协会军工委员会副会长，2016年8月至2018年1月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。

（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。

倪鉴，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，历任审计部总监助理、纪检监察室副主任，现任审计部总监、风险管理部总监。2017年3月起任公司职工监事。

### （三）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。

李辉，大学本科，19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，21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，20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。

### （四）本基金基金经理：

#### 1、现任基金经理

杨飞，硕士研究生，11年证券基金从业经历。2008年7月至2009年8月在诺德基金管理有限公司任助理研究员，2009年9月至2011年2月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011年2月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014年10月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2015年3月起兼任国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（原国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015年5

月起兼任国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（原国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015年5月至2016年5月任国泰成长优选混合型证券投资基金（原国泰成长优选股票型证券投资基金）的基金经理，2016年2月至2017年10月任国泰大健康股票型证券投资基金的基金经理，2016年4月至2017年5月任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2017年3月起兼任国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

## 2、历任基金经理

自本基金成立至2011年2月28日由余荣权、程洲担任基金经理，自2011年3月1日至2011年4月10日，由程洲担任本基金的基金经理，自2011年4月11日至2011年12月23日，由程洲、周广山共同担任本基金的基金经理，自2011年12月23日至2012年8月5日由周广山、刘夫共同担任本基金的基金经理，自2012年8月6日至2013年9月8日由刘夫担任本基金的基金经理，自2013年9月9日至2015年3月25日由邓时锋担任本基金的基金经理，自2015年3月26日起由杨飞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：

周向勇：总经理

执行委员：

张玮：总经理助理

委员：

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

胡松：养老金投资总监、养老金及专户投资（事业）部总监

（六）上述人员之间均不存在近亲属或家属关系。

## 第二节 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

名称：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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## 二、主要人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 第三节 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### （一）场外直销机构

序号	机构名称	机构信息
1	国泰基金管理有限公司	地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

	公司直销柜台	客户服务专线：400-888-8688, 021-31089000	
		传真：021-31081861 网址： <a href="http://www.gtfund.com">www.gtfund.com</a>	
2	国泰基金 电子交易平台	电子交易网站： <a href="http://www.gtfund.com">www.gtfund.com</a> 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

## （二）场外其他销售机构

### 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）	
		电话：95588	
		网址： <a href="http://www.icbc.com.cn">www.icbc.com.cn</a>	
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：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： <a href="http://www.95599.cn">www.95599.cn</a>	
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：陈四清	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址： <a href="http://www.boc.cn">www.boc.cn</a>
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：田国立	客服电话：95533
		网址： <a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>	
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：彭纯	客服电话：95559
		联系人：王菁	电话：021-58781234
		网址： <a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a>	
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：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
7	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
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：洪崎	联系人：王志刚、穆婷
		电话：010-58560666	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	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
13	上海银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号	
		法定代表人：金煜	联系人：王笑
		客服电话：95594	传真：021-684761111

		网址: <a href="http://www.bosc.cn">www.bosc.cn</a>
14	南京银行股份有限公司	注册地址: 南京市玄武区中山路 288 号
		办公地址: 南京市玄武区中山路 288 号
		法定代表人: 胡升荣 联系人: 胡阳华
		客服电话: 95302 传真: 025-86775376
		网址: <a href="http://www.njcb.com.cn">www.njcb.com.cn</a>
15	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: <a href="http://www.bank.pingan.com">www.bank.pingan.com</a>
16	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: <a href="http://www.drcbank.com">www.drcbank.com</a>
17	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: 范敏祺
		电话: 021-38676161 传真: 021-38670161
		客服电话: 95521 网址: <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>
18	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: <a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a>
19	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: <a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
20	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: <a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>
		客服电话: 400-888-8111/95565
21	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 2-6 层
		办公地址: 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: 陈共炎 联系人: 辛国政
		电话: 010-83574507 传真: 010-83574807
		客服电话: 4008-888-888 或 95551
		网址: <a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a>
22	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: <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>
23	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: <a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>
24	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: <a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a>
25	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: 95322 网址: <a href="http://www.wlzq.cn">www.wlzq.cn</a>
26	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 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: <a href="http://www.msza.com">www.msza.com</a>

27	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
28	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
29	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
30	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
31	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：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
32	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：广州市天河北路183号大都会广场5、7、8、17、18、19、38-44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
33	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	
		客服电话：95548	传真：010-60836029	
		网址： <a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a>		
34	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： <a href="http://www.ewww.com.cn">www.ewww.com.cn</a>	
35	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001		
		办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层		
		法定代表人：姜晓林	联系人：刘晓明	
		电话：0531-89606165	传真：0532-85022605	
		客服电话：95548	网址： <a href="http://sd.citics.com">sd.citics.com</a>	
36	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路228号		
		办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼		
		法定代表人：周易	联系人：庞晓芸	
		电话：0755-82492193	网址： <a href="http://www.htzq.com.cn">www.htzq.com.cn</a>	
		客服电话：95597		
37	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： <a href="http://www.95579.com">www.95579.com</a>	
38	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： <a href="http://www.ccnew.com">www.ccnew.com</a>		
39	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		

	限公司	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 电话：0531-68889155 客服电话：95538	联系人：吴阳 传真：0531-68889185 网址：www.zts.com.cn
40	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 联系电话：0755-82825551 客服电话：400-800-1001 网址：www.essence.com.cn	联系人：陈剑虹 传真：0755-82558355
		客服电话：400-800-1001	
		网址：www.essence.com.cn	
		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 电话：0471-4972343 客服电话：0471-4961259	联系人：王旭华 传真：0471-4961259 网址：www.cnht.com.cn
		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 电话：0769-22119341 客服电话：0769-961130	联系人：梁健伟 传真：0769-22116999 网址：www.dgzq.com.cn
43	东莞证券有限责任公司	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 电话：0755-82023442 网址：www.china-invs.cn 客服电话：400-600-8008、95532	联系人：张鹏 传真：0755-82026539
		客服电话：400-600-8008、95532	
		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 电话：0592-5161642 客服电话：0592-5163588	联系人：赵钦 传真：0592-5161140 网址：www.xmzq.cn
		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
		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
46	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
47	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	
48	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
49	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
50	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：95321	网址：www.cindasc.com
51	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
52	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: <a href="http://www.hlzqgs.com">www.hlzqgs.com</a>
53	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: <a href="http://www.gyzq.com.cn">www.gyzq.com.cn</a>
54	平安证券股份有限公司	注册地址: 深圳市福田中心区金田路 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: <a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a>
55	方正证券股份有限公司	注册地址: 湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中中心 4、5 号楼 3701-3717
		法定代表人: 施华 联系人: 郭瑞军
		电话: 0731-85832503 传真: 0731-85832214
		客服电话: 95571 网址: <a href="http://www.foundersc.com">www.foundersc.com</a>
56	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: <a href="http://www.huaan.com">www.huaan.com</a>
57	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: 王逍
		电话: 021-64339000
		客服电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918
		网址: <a href="http://www.cfsc.com.cn">www.cfsc.com.cn</a>
58	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: <a href="http://www.gjzq.com.cn">www.gjzq.com.cn</a>
59	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
		客服电话：400-990-8826 传真：0755-83217421
		网址： <a href="http://www.citicsf.com">www.citicsf.com</a>
60	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： <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a>
61	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： <a href="http://www.hx168.com.cn">www.hx168.com.cn</a>
62	财通证券股份有限公司	注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 法定代表人：沈继宁 联系人：陶志华 电话：40086-95336 传真：0571-87828088 客服电话：95536 网址： <a href="http://www.ctsec.com">www.ctsec.com</a>
63	宁波银行股份有限公司	注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 法定代表人：陆华裕 客服电话：95574 网址： <a href="http://www.nbcb.com.cn">www.nbcb.com.cn</a>
64	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： <a href="http://www.czbank.com">www.czbank.com</a>
65	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： <a href="http://www.jnbank.com.cn">www.jnbank.com.cn</a>	

## 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： <a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>
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： <a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a>
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： <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>
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	
5	上海长量基金销售有限公司	网址： <a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a> 及 <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a>	
		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： 何昳
		电话： 021-58788678-8201	传真： 021—58787698
		客服电话： 400-820-2899	网址： <a href="http://www.erichfund.com">www.erichfund.com</a>
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： <a href="http://www.myfund.com">www.myfund.com</a>	
7	浙江同花顺基金销售公司	注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室	
		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： <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>
8	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： <a href="http://www.1234567.com.cn">www.1234567.com.cn</a>
9	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： <a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a>
10	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： 李兴春	联系人： 叶志杰
		电话： 021-50583533	传真： 021-50583633
		客服电话： 400-921-7755	
		网址： <a href="http://www.leadfund.com.cn">www.leadfund.com.cn</a>	
11	浙江金观诚基金	注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10	

	销售有限公司	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
12	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：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
13	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	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：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
14	一路财富（北京）基金销售股份有限公司	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
15	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：www.zcvc.com.cn
16	上海联泰基金销售有限公司	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	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
		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中龙园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	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	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
23	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
24	深圳富济基金销售有限公司	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
25	珠海盈米基金销售有限公司	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
26	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: <a href="http://www.xincai.com">www.xincai.com</a>
27	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: 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: <a href="http://www.520fund.com.cn">www.520fund.com.cn</a>
28	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: 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: <a href="http://www.snjijin.com">www.snjijin.com</a>
29	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: 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: <a href="http://www.hcjjjin.com">www.hcjjjin.com</a>
30	万家财富基金销售（天津）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: 李修辞 联系人: 邵玉磊
		电话: 010-59013795
		网址: <a href="http://www.wanjiawealth.com">www.wanjiawealth.com</a>
31	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: 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: <a href="http://www.5irich.com">www.5irich.com</a>
32	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: 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： <a href="http://www.igesafe.com">www.igesafe.com</a>		
33	北京肯特瑞基金销售有限公司	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：江卉	联系人：赵德赛	
		电话：010-89188343	客服电话：95118	
		网址： <a href="http://fund.jd.com">fund.jd.com</a>		
34	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：钟斐斐	联系人：戚晓强	
		电话：010-61840688	传真：010-61840699	
		客服电话：4000618518		
35	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：周斌	联系人：张鼎	
		电话：010-59313555	传真：010-59313586	
		客服电话：4008980618		
36	上海华夏财富投资管理有限公司	网址： <a href="http://www.chtwm.com">www.chtwm.com</a>		
		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：李一梅	联系人：仲秋玥	
		电话：010-88066632	传真：010-88066552	
37	通华财富（上海）基金销售有限公司	客服电话：400-817-5666		
		网址： <a href="http://www.amcfuture.com">www.amcfuture.com</a>		
		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	
38	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
39	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
40	北京百度百盈基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101	
		办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科大厦	
		法定代表人：张旭阳	传真：010-61951007
		联系人：孙博超	电话：010-61952703
		客服电话：010-59922163	网址：www.baiyingfund.com

### （三）场内销售机构

具有中国证监会认定的基金代销业务资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购业务；具有中国证监会认定的基金代销业务资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务，具体名单可在深圳证券交易所网站查询。

## 二、注册登记人

序号	机构名称	机构信息	
1	中国证券登记结算有限责任	注册地址：北京市西城区金融大街27号投资广场22、23层	
		办公地址：北京市西城区金融大街27号投资广场22、23层	
		法定代表人：金颖	传真：010-58598907

	公司	联系人：朱立元	电话：010-58598839
--	----	---------	-----------------

### 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

### 四、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

## 第四节 基金名称

国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）

## 第五节 基金类型和存续期间

（一）基金的类别：混合型证券投资基金

（二）基金的运作方式：契约型开放式

本基金《基金合同》生效后，在封闭期内不开放申购、赎回业务。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

（三）基金存续期间：不定期

（四）基金封闭期

本基金《基金合同》生效后，封闭期为三年（含三年），封闭期届满后转为上市开放式

基金（LOF）。按照《基金合同》的约定，国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的封闭期于2013年2月18日届满，封闭期届满后，本基金管理人按照基金合同的约定，将估值优先份额和估值进取份额转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额，国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金名称变更为“国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）”。

#### （五）基金类别变更

根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及本基金基金合同的约定，本基金自2015年8月8日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由“国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）”修改为“国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）”，基金合同部分条款相应修订。

## 第六节 投资目标

坚持价值投资的理念，力争在有效控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。

## 第七节 投资范围和投资对象

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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它金融工具。若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。

## 第八节 投资理念

坚持价值投资理念和估值优势原则，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法，精选具有竞争力及估值优势的优质公司，通过科学的组合管理，实现投资目标。

## 第九节 投资策略

### （一）资产配置

本基金的资产配置策略主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境，重点考察市场估值水平，使用联邦（FED）模型和风险收益规划模型，确定大类资产配置方案。

#### 1. 联邦模型（Fed model）

本基金使用联邦模型分析市场PE与国债收益率之间的关系，判断我国股票市场和债券市场的估值水平是否高估或低估，为配置债券和股票的比例提供了客观的标准。本基金在该资产配置模型中使用7年国债到期收益率与剔除PE为负和大于100的个股的平均市盈率倒

数之差来判断债券市场与股票市场的相对投资价值。

## 2. 风险收益规划模型

利用联邦模型的结果，同时结合对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

### （二）行业配置

本基金的行业配置主要利用 ROIC 的持续性以及周期性规律，来优化配置相应的行业。ROIC，投资资本回报率，是评估资本投入回报有效性的常用指标。该指标主要用于衡量企业运用所有债权人和股东投入为企业获得现金盈利的能力，也用来衡量企业创造价值的能力。

在宏观经济处于周期底部阶段时，应选择 ROIC 低于其长期平均水平较多的行业进行超配，分享经济复苏时行业盈利能力恢复所带来的收益；在宏观经济处于周期顶部阶段时，应选择低配 ROIC 明显高于其长期平均水平的行业，规避经济回落时行业盈利快速下滑的风险。

### （三）个股选择策略

本基金的个股选择主要采取“自下而上”的策略。通过对企业的基本面和市场竞争格局进行分析，重点考察具有竞争力和估值优势上市公司股票，在实施严格的风险管理手段的基础上，获取持续稳定的经风险调整后的合理回报。

第一步，利用“企业竞争力模型”，对上市公司的资源基础竞争力、经营过程竞争力、业绩表现竞争力进行总体评价，筛选具有竞争力的优质上市公司，构成具有竞争力优势的股票池。

企业竞争力模型的主要指标体系：

1. 资源基础指标：包括企业总资产、净资产、人力资源数量和质量等指标；
2. 经营过程指标：包括总资产周转率、存货周转率、成本控制水平等体现经营管理水平的技术指标；
3. 业绩表现指标：包括利润总额、净利润率、市场份额、净资产收益率等财务指标。

本基金采用主观赋权法，对上述指标进行加权，得出上市公司竞争力综合排名。

第二步，通过相对价值评估，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票投资组合。

在企业竞争力股票池范围内，本基金利用相对价值评估，形成可投资的股票组合。相对价值评估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股息贴现模型、自由现金流贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA 等方法。

第三步，实地调研。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。

第四步，构建投资组合。本基金将在案头分析和实地调研的基础上构建投资组合。在构建投资组合过程中，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。

#### （四）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，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

#### （五）权证投资策略

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。

1. 考虑标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值；
2. 计算权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，为权证的具体操作提供依据。

#### （六）资产支持证券投资策略

对各档次资产支持证券利率敏感度进行综合分析。在给定提前还款率下，分析各档次资产支持证券的收益率和加权平均期限的变化情况。

### 第十节 投资决策依据和程序

#### （一）投资依据

1. 有关法律、法规、基金合同等的相关规定；
2. 经济运行态势和证券市场走势。

#### （二）投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；确定基金的投资策略和在不同阶段的重大资产配置比例，包括大类资产配置比例（股票、转债及其他债券）以及各类属资产内部行业比例等；审批基金经理提出的投资组合计划和重大单项投资。基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

#### （三）投资程序

1. 金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，结合公司内外研究报告，对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算与归因分析，依此提出研究分析报告。
2. 投资决策委员会依据金融工程部、研究开发部等部门提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

3. 基金经理以基金合同、投资决策委员会决议、金融工程部和研究开发部研究报告等为依据建立基金的投资组合。
4. 交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。
5. 金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关绩效评估报告。稽核监察部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。
6. 基金经理结合个券的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和稽核监察部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果，对投资组合进行监控和调整。
7. 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并在招募说明书中更新。

## 第十一节 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率  $\times$  80% + 中证全债指数收益率  $\times$  20%

## 第十二节 风险收益特征

本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 第十三节 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2018 年 12 月 31 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	1,685,868,026.01	84.62
	其中：股票	1,685,868,026.01	84.62
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	109,700,484.55	5.51
	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	193,578,870.30	9.72
7	其他各项资产	3,118,798.19	0.16
8	合计	1,992,266,179.05	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	31,164,698.18	1.58
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,317,053,647.44	66.65
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	—	—
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	298,868,620.19	15.12
J	金融业	—	—
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	19,245,762.10	0.97
R	文化、体育和娱乐业	19,535,298.10	0.99
S	综合	—	—
	合计	1,685,868,026.01	85.31

（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	600566	济川药业	4,589,682	153,892,037.46	7.79
2	002737	葵花药业	8,364,176	123,622,521.28	6.26
3	000661	长春高新	694,590	121,553,250.00	6.15
4	300476	胜宏科技	10,082,579	117,966,174.30	5.97
5	603228	景旺电子	1,924,100	96,185,759.00	4.87
6	600406	国电南瑞	4,395,690	81,452,135.70	4.12
7	600271	航天信息	3,183,161	72,862,555.29	3.69
8	002815	崇达技术	4,730,988	69,119,734.68	3.50
9	603305	旭升股份	2,071,800	63,024,156.00	3.19
10	002916	深南电路	782,300	62,716,991.00	3.17

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（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

本基金本报告期末未持有债券。

（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）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）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、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,075,659.44
2	应收证券清算款	81,336.95
3	应收股利	-
4	应收利息	118,972.71
5	应收申购款	1,842,829.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,118,798.19

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

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。

## 第十四节 基金的业绩

本基金业绩截止日为 2018 年 12 月 31 日，并经基金托管人复核。

本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	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④

	率①	率标准差②	收益率③	准差④		
2010年2月10日(基金合同生效日)至2010年12月31日	14.00%	1.05%	-0.21%	1.28%	14.21%	-0.23%
2011年度	-24.91%	1.12%	-19.39%	1.04%	-5.52%	0.08%
2012年度	-10.16%	1.06%	7.08%	1.02%	-17.24%	0.04%
2013年1月1日至2013年2月18日	8.45%	1.03%	6.97%	1.00%	1.48%	0.03%
自2013年2月19日(基金转型起)至2013年12月31日	11.51%	1.46%	-12.14%	1.13%	23.65%	0.33%
2014年度	14.52%	1.24%	42.85%	0.97%	-28.33%	0.27%
2015年度	104.32%	3.03%	7.52%	1.99%	96.80%	1.04%
2016年度	1.52%	1.95%	-8.42%	1.12%	9.94%	0.83%
2017年度	27.98%	1.13%	17.08%	0.51%	10.90%	0.62%
2018年度	-43.51%	1.54%	-19.17%	1.07%	-24.34%	0.47%
自2013年2月19日(基金转型起)至2018年12月31日	91.49%	1.85%	16.96%	1.21%	74.53%	0.64%

注：本基金自2013年2月19日起转型为开放式基金，2013年2月18日为本基金转型前最后一日。

## 第十五节 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- (一)基金管理人的管理费；
- (二)基金托管人的托管费；
- (三)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

- （四）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
  - （五）基金份额持有人大会费用；
  - （六）基金的证券交易费用；
  - （七）基金的银行汇划费用；
  - （八）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。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### （一）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。

### （二）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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—7 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：

- （一）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；
- （二）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；
- （三）《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、信息披露费用等费用；

（四）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、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的有关规定，在至少一家指定报刊和基金管理人网站上公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第十六节 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方法》、《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9月22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”中的相关信息；
- 3、更新了“第四节 基金托管人”中的相关信息；
- 4、更新了“第五节 相关服务机构”中的相关信息；
- 5、更新了“第十一节 基金的投资”中的相关内容，其中基金投资组合报告，数据截止至2018年12月31日；
- 6、更新了“第十二节 基金的业绩”，数据截止2018年12月31日；
- 7、更新了“第二十五节 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](http://www.gtfund.com)。

国泰基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日