

国泰金鼎价值精选混合型 证券投资基金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：中国建设银行股份有限公司

重要提示

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（以下简称“国泰金鼎价值基金”或“本基金”）由金鼎证券投资基金转型而来。基金转型经 2007 年 3 月 9 日金鼎证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会 2007 年 3 月 27 日证监基金字[2007]88 号文核准。自 2007 年 4 月 11 日起，由《金鼎证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》生效。

国泰基金管理有限公司（“本基金管理人”或“基金管理人”或“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集中申购的核准，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。

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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，基金管理人并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 4 月 11 日，投资组合报告为 2019 年 1 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

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：021-31089000，4008888688

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 4 月 11 日，本基金管理人共管理 104 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国

泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金(由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来)、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)(由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来,国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来)、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金(LOF)、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰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证券投资基金转型而来)、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金(由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来)、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来)、国泰沪深300指数增强型证券投资基金(由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来)。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:

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。

丁琪，董事，硕士，高级政工师。1994年7月至1995年8月，在西北电力集团物资总公司任财务科职员。1995年8月至2000年5月，在西北电力集团财务有限公司任财务部干事。2000年6月至2005年8月，在国电西北公司财务部任成本电价处干事、资金运营处副处长。2005年8月至2012年10月，在中国电力财务有限公司西北分公司任副总经理（主持工作）、总经理、党组副书记。2012年10月至2014年11月，在中国电力财务有限公司华中分公司任总经理、党组副书记。2014年11月至今，在中国电力财务有限公司任副总经理、党组成员、党委委员。2019年4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。

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、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。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，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。

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。

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。1998年8月至2001年4月任职于中国工商银行北京分行营业部；2001年5月至2006年2月任职于大成基金管理有限公司，任高级产品经理；2006年3月至2014年12月任职于信达澳银基金管理有限公司，历任市场总监、北京分公司总经理、总经理助理；2015年1月至2018年7月任职于国寿安保基金管理有限

公司，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年金融从业经历。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，2019年3月起转任公司副总经理。

刘国华，博士研究生，25年金融从业经历。曾任职于山东省国际信托投资公司、万家基金管理有限公司；2008年4月加入国泰基金管理有限公司，先后担任产品规划部总监、公司首席产品官、公司首席风险官，2019年3月起担任公司督察长。

（四）本基金的基金经理

1、现任基金经理

饶玉涵，硕士研究生，9年证券基金从业经历。2010年7月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员和基金经理助理。2015年9月起任国泰区位优势混合型证券投资基金的基金经理，2016年1月起兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理，2016年7月起兼任国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金的基金经理，2018年3月起兼任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理。

2、历任基金经理

国泰金鼎价值基金：2007年4月11日至2008年4月由崔海峰担任基金经理，2008年4月起至2018年3月12日由邓时锋担任基金经理，2018年3月13日起至今由饶玉涵担任基金经理。

金鼎基金（2000年5月16日至2007年4月10日）：2000年5月至2002年5月由张以杰担任基金经理，2002年5月至2003年1月由胡定超担任基金经理，2003年1月至2004年3月由何江旭担任基金经理，2004年3月至2007年2月由徐学标担任基金经理，2007年4月至2008年4月由崔海峰担任基金经理。

（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：FOF 投资总监

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

6、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：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)。

2018 年 6 月末，本集团资产总额 228,051.82 亿元，较上年末增加 6,807.99 亿元，增幅 3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加 93.27 亿元至 1,814.20 亿元，增幅 5.42%；净利润较上年同期增加 84.56 亿元至 1,474.65 亿元，增幅 6.08%。

2017 年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位；在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 315 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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

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。

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 2018 年二季度末，中国建设银行已托管 857 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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”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”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

第三节 相关服务机构

一、基金份额销售机构

（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

（二）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：	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：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	
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：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：田国立	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：彭纯	客服电话：95559
		联系人：王菁	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：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	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	
		客服电话：95580	
		网址：www.psbc.com	
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	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
14	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	
15	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	
16	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：www.nbc.com.cn	
17	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	
18	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：王滨	
		电话：020-38322888	传真：020-87310955
		客服电话：400-830-8003	
		网址：www.cgbchina.com.cn	
19	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：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	
20	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	
		办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼	
		法定代表人：杨德红	
		客服电话：95521	网址：www.gtja.com
21	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：无
		客服电话：95587 4008-888-108	网址：www.csc108.com
22	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

23	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	
24	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	
		客服电话：4008-888-888 或 95551	网 址： www.chinastock.com.cn
25	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	
26	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：陈飙
		电话：021-33388254	客服电话：95523 4008895523
		网址：www.swhysc.com	
27	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	
		办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号	
		法定代表人：杨华辉	
		客服电话：95562	网址：www.xyzq.com.cn
28	万联证券股份有 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：甘蕾
		电话：020-38286026	传真：020-38286588
		客服电话：95322	网址：www.wlzq.cn
29	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：www.msq.com
30	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
31	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
32	上海证券有限责 任公司	注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼	
		法定代表人：李俊杰	联系人：邵珍珍
		电话：021-53686888	传真：021-53686100-7008
		客服电话：4008918918	网址：www.shzq.com
33	国盛证券有限责 任公司	注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京 银行南昌分行营业大楼	
		办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京 银行南昌分行营业大楼	
		法定代表人：徐丽峰	联系人：占文驰
		电话：0791-86283372	传真：0791-86281305
		网址：www.gszq.com	
34	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	
35	世纪证券有限责 任公司	注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼	
		办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层	
		法定代表人：姜昧军	
		客服电话：4008323000	网址：www.csc.com.cn
36	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：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦
		法定代表人：孙树明
		客服电话：95575 网址：www.gf.com.cn
37	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：天津市南开区宾水西道 8 号
		法定代表人：王春峰 联系人：蔡霆
		电话：022-28451991 传真：022-28451892
		客服电话：400-651-5988 网址：www.ewww.com.cn
38	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
		客服电话：95548 网址：sd.citics.com
39	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、上海市东方路 18 号保利广场 E 座
		法定代表人：周易 联系人：张宇明
		电话：021-68498507 网址：www.htzq.com.cn
		客服电话：95597
40	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：李新华 联系人：奚博宇
		电话：027-65799999 传真：027-85481900
		客服电话：95579 网址：www.95579.com
41	国海证券股份有 限公司	注册地址：广西桂林市辅星路 13 号
		办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号
		法定代表人：何春梅
		客服电话：95563 网址：www.ghzq.com.cn
42	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
		法定代表人：菅明军

		客服电话：95377	网址：www.ccnew.com
43	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	
		客服电话：95538	网址：www.zts.com.cn
44	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	
		办公地址：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	
		客服电话：400-800-1001	
		网址：www.essence.com.cn	
45	恒泰证券股份有 限公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座	
		办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑恒泰证券办公楼	
		法定代表人：庞介民	
		客服电话：4001966188	网址：www.cnht.com.cn
46	东莞证券股份有 限公司	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：陈照星	联系人：李荣
		电话：0769-22115712	传真：0769-22115712
		客服电话：95328	网址：www.dgzq.com.cn
47	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	
		办公地址：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	
		法定代表人：高涛	
		客服电话：95532	网址：www.china-invs.cn
48	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	
		办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼	
		法定代表人：王勇	

		客服电话：400-0099-886	网址：www.gwgsc.com
49	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
50	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	
51	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
52	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	
		办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505	
		法定代表人：林义相	
		客服电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
53	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：张志刚	联系人：唐静
		电话：95321	传真：无
		客服电话：95321	网址：www.cindasc.com
54	中国民族证券有 限责任公司	注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼	
		办公地址：北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼	
		法定代表人：姜志军	
		客服电话：400-889-5618	网址：www.e5618.com
55	华龙证券股份有 限公司	注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼	
		办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼	
		法定代表人：陈牧原	
		客服电话：95368	网址：www.hlzq.com

56	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
57	西部证券股份有 限公司	注册地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室	
		法定代表人：徐朝晖	联系人：梁承华
		电话：029-87211522	传真：029-87211478
		客服电话：95582	网址：www.westsecu.com
58	平安证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
		法定代表人：何之江	联系人：王阳
		电话：021-38637436	传真：021-33830395
		客服电话：95511-8	网址：stock.pingan.com
59	德邦证券股份有 限公司	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：朱磊
		电话：021-68761616	传真：021-68767880
		客服电话：4008888128	网址：www.tebon.com.cn
60	中航证券有限公 司	注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层	
		办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号 中航资本大厦 35 层	
		法定代表人： 王晓峰	
		客服电话：95335	网址：www.avicsec.com
61	东海证券股份有 限公司	注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层	
		办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦	
		法定代表人：赵俊	
		客 服 电 话 ： 95531 ； 400-888-8588	网址：www.longone.com.cn
62	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	
		办公地址：北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼	
		法定代表人：施华	

		客服电话：95571	网址：www.foundersec.com
63	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	
64	湘财证券股份有 限公司	注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	
		办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	
		法定代表人：孙永祥	
		客服电话：95351	网址：www.xcsc.com
65	华融证券股份有 限公司	注册地址：北京市西城区金融大街8号	
		办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号	
		法定代表人：祝献忠	
		客服电话：95390	网址：www.hrsec.com.cn
66	日信证券有限责 任公司	注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号	
		法定代表人：孔佑杰	联系人：陈韦杉
		电话：010-66413306	传真：010-66412537
		客服电话：010-88086830	网址：www.rxzq.com.cn
67	江海证券有限公 司	注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
		法定代表人：赵洪波	联系人：姜志伟
		电话：0451-87765732	传真：0451-82337279
		客服电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
68	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
69	浙商证券股份有 限公司	注册地址：浙江省杭州市江干区五星路201号	
		法定代表人：吴承根	联系人：高扬

		电话：0571-87902974	传真：0571-87901913
		客服电话：95345	网址：www.stocke.com.cn
70	中银国际证券股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	
		办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	
		法定代表人：宁敏	
		客服电话：4006208888	网址：www.bocichina.com
71	新时代证券股份有限公司	注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501	
		办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501	
		法定代表人：叶顺德	
		客服电话：95399	网址：www.xsdzq.cn
72	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：廖庆轩	联系人：周青
		电话：023-67616310	传真：023-63786212
		网址：www.swsc.com.cn	
73	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	
		办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层	
		客服电话：4008188118	网址：www.guodu.com
74	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	
75	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	
		办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号	
		法定代表人：章宏韬	
		客服电话：95318	网址：www.hazq.com
76	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	
		办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号	
		法定代表人：俞洋	

		客服电话：95323	网址：www.cfsc.com.cn
77	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
78	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	
		客服电话：400-990-8826	网址：www.citicsf.com
79	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：李琦	联系人：王怀春
		电话：0991-2307105	传真：0991-2301927
		客服电话：4008000562	网址：www.hysec.com
80	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	
		客户服务电话：95584	网址：www.hx168.com.cn
81	华泰联合证券有限责任公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A，02-04），17A，18A，24A-26A	
		法定代表人：吴晓东	客服电话：0755-82492010
		网址：www.lhzq.com	
82	九州证券股份有限公司	注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路108号	
		办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼	
		法定代表人：魏先锋	
		客服电话：95305	网址：www.jzsec.com

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：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明	联系人：韩爱彬
		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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层	
		法定代表人：张跃伟	联系人：邱燕芳
		电话：021-20691935	传真：021-20691861
		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：李晓芳
		电话：010-59601366	传真：010-62020355

		客服电话：4008188000	
		网址：www.myfund.com	
7	浙江同花顺基金销售有限公司	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：董一锋
		电话：0571-88911818	传真：0571-86800423
		客服电话：4008-773-772	网址：www.5ifund.com
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号东方财富大厦	
		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
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：聂婉君	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
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	
		办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层	
		法定代表：李兴春	联系人：郭丹妮
		电话：021-50583533	传真：021-50583633
		客服电话：95733	
		网址：www.leadfund.com.cn	
11	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	
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 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元	
		办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层 (100022)	
		法定代表人：赵学军	联系人：李雯
		电话：010-60842306	客服电话：400-021-8850
		传真：021-20280110、010-85712195	
		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	
		办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809	
		法定代表人：戎兵	联系人：魏晨
		电话：010-52858244	传真：010-5964 4496
		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	注册地址：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：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层	
		法定代表人：吴雪秀	联系人：董宣
		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：尹彬彬	联系人：兰敏
		电话：021-52822063	传真：021-52975270
		客服电话：400-166-6788	网址：www.66liantai.com
17	汇付基金销售有	注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元	

	限公司	办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天软件园C5幢
		法定代表人：金佶 联系人：甄宝林
		客服电话：021-34013999
		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
		法定代表人：王之光
		联系人：宁博宇 电话：021-20665952
		传真：021-22066653
		客服电话：4008219031
		网址：www.lufunds.com
19	泰诚财富基金销售有限公司	注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号
		办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号
		法定代表人：李春光
		电话：0411-88891212 传真：0411-84396536
		客服电话：4000411001
		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：郑毓栋
		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: 洪弘	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岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元	
		办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元	
		法定代表: 刘鹏宇	联系人: 刘勇
		电话: 0755-83999907-8814	传真: 0755-83999926
		客服电话: 0755-83999907	
		网址: www.fujifund.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: 邱湘湘
		电话: 020-89629099	传真: 020-89629011
		客服电话: 020-89629066	
		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	

		法定代表人：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	
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	
		法定代表人：黄祎	联系人：徐亚丹
		电话：021-50712782	传真：021-50710161
		客服电话：400-799-1888	
		网址：www.520fund.com.cn	
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）	
		法定代表人：王锋	联系人：张慧
		电话：025-66996699-882796	传真：025-66008800-882796
		客服电话：95177	
		网址：www.snjijin.com	
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	
		办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层	
		法定代表人：王伟刚	联系人：王骁骁
		电话：010-56251471	传真：010-62680827
		客服电话：400-619-9059	
		网址：www.hcjijin.com	
30	万家财富基金销售有限公司（天津）有限公司	注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室	
		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：王芳芳
		电话：010-59013842	
		网址：www.wanjiawealth.com	
31	北京创金启富基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室	
		办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室	

		法定代表人：梁蓉	联系人：李慧慧
		电话：010-66154828	传真：010-63583991
		客服电话：400-6262-818	
		网址：www.5irich.com	
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	
		法定代表人：叶精一	联系人：张林
		电话：010-68983311	传真：010-65983333
		客服电话：400-066-8586	
		网址：www.igesafe.com	
33	北京肯特瑞基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401	
		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：韩锦星
		电话：010-89188343	客服电话：95118
		网址：fund.jd.com	
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：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层	
		法定代表人：钟斐斐	
		联系人：侯芳芳	电话：010-61840688
		客服电话：4001599288	
		APP 下载网址：danjuanapp.com	
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	
		法定代表人：周斌	联系人：陈霞
		电话：010-59313555	传真：010-59313586
		客服电话：4008980618	
		网址：www.chtwm.com	

36	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 8 层	
		法定代表人：毛淮平	联系人：张静怡
		电话：010-88066632	传真：010-63136184
		客服电话：400-817-5666	
		网址：www.amcfortune.com	
37	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：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层	
		法定代表人：沈丹义	联系人：庄洁茹
		电话：021-60818056	客服电话：4001019301
		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：沈晨	电话：010-59336544
		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

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：021-58872935

传真：021-68870311

联系人：郑奕莉

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 基金的名称

国泰金鼎价值精选混合证券投资基金

第五节 基金类型和存续期限

- (一) 基金的类别：混合型基金；
- (二) 基金的运作方式：契约型开放式；
- (三) 基金存续期限：不定期。

第六节 投资目标

本基金为价值精选混合型基金，以量化指标分析为基础，在严密的风险控制前提下，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

第七节 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，包括国内依法发行上市的股票、债券、短期金融工具、权证、资产支持证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。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%；债券资产的投资比例占基金资产的 0-60%，其中资产支持证券类资产的投资比例占基金资产净值的 0%-10%；现金或到期日在一年以内的政府债券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。

第八节 投资策略

(一) 大类资产配置

本基金的大类资产配置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、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足各类基金风险-回

报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同，预测短期性回报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

在定量分析方面，主要采用均衡市盈率预测模型，并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算 A 股市场理论上均衡的市盈率水平，然后将其与 A 股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较，来判定股票市场系统性风险的高低，最后则根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外，本基金还参照股息率、收益率差距表（1/PE-银行利率）等指标，来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面，主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析，并对根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面，主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

（二）股票资产投资策略

本基金以量化分析为基础，从上市公司的基本面分析入手，建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和 α 值，运用组合优化模型，积极创建并持续优化基金的股票组合，在有效控制组合总体风险的前提下，谋求超额收益。

基金股票池的建立

本基金采取自下而上的方法，从个股选择入手，根据个股的基本面信息，运用多因子模型，选取各行业中具有内在价值的个股组成基金的一级股票池；在一级股票池的基础上，运用现金流折现模型和个股超额收益分析，筛选个股组建基金的二级股票池。

1、一级股票池个股筛选

本基金在建立一级股票池时，是以行业为单位，按照不同行业各自的特点，选取不同的估值因子构建多因子估值模型，对行业内的个股进行估值。本基金的行业分类以天相行业分类标准为依据。

本基金在运用估值模型对行业内个股内在价值估值的基础上，选取各行业内价值排名前 1/3 的个股组成基金的一级股票池。

2、二级股票池个股筛选

本基金二级股票池是以现金流折现模型和个股超额收益分析（个股的 α 值）做为筛选标准对基金一级股票池中的个股进行二次筛选。

本基金在运用现金流折现模型时，通过对上市公司未来业绩的预测和场景模拟等方法，

估算个股的未来现金流；在折现因子的确定上，本基金运用加权平均资本成本模型（WACC），充分考虑到股权成本和债券成本的差异和税务盾牌的作用，精确估算个股的折现值。对于周期性行业等现金流波动较大的行业，本基金在现金流折现的基础上，依据这类个股的市场表现，估算个股的 α 值，以 α 值作为二次选股的优先考虑因素。

本基金在一级股票池中选取折现值靠前的300个左右个股组成基金的二级股票池。

3、股票组合构建和调整

本基金在充分考虑个股内在价值和风险收益水平的基础上，在二级股票池中选取个股构建基金的股票组合，运用组合优化模型不断优化股票组合，以达到单位风险下的收益最大化。

（三）债券资产投资策略

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。

1、收益率曲线配置具体策略

当预测收益率曲线平行上移或是陡峭化时，适当地降低债券组合的平均久期；当预测收益率曲线平行下移或是平坦化时，适当地增加债券组合的平均久期；当预测收益率曲线剧烈平行上移时，同时降低债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线剧烈平行下移时，同时增加债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线（正向或是反向）蝴蝶型变化时，适当地将债券组合进行子弹型或是哑铃型配置。

2、债券置换策略

本基金以利差分析为基础，当债券利差增大时，适当增加企业债和金融债的数量、减少国债的数量，当债券利差减小时，适当增加国债的数量、减少企业债和金融债的数量；债券组合的平均信用等级保持在投资级（A+级）以上。

在通过上述配置方法构建债券组合之后，本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调整：

（1）短期经济运行指标，如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动，引起的市场实际利率的变动；

（2）中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动，导致整个投资组合重新估价；

（3）央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

(4) 债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与申购情况发生变化, 导致二级市场收益率产生波动;

(5) 由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价;

(6) 市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动;

(7) 单个券种或某一类别债券的定价偏差, 也就是市场失衡导致的投资机会等。

第九节 业绩比较基准

业绩比较基准: 65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率

上证综合指数以上海证券交易所上市所有股票为样本, 大部分为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票, 基本能够反映 A 股市场发展趋势。该指数具有较强的公正性与权威性, 市场代表性较强; 上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本, 按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数, 反映我国债券市场整体变动状况, 具有较强的市场代表性。

在本基金的运作过程中, 如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益, 则基金管理人在经过基金托管人同意后可以调整业绩比较基准进行适当调整, 并在报中国证监会核准后, 公告并予以实施。

第十节 风险收益特征

本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

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 2019 年 4 月 18 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 2019 年 3 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	737,487,738.72	75.14
	其中：股票	737,487,738.72	75.14
2	固定收益投资	36,237,658.90	3.69
	其中：债券	36,237,658.90	3.69
	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	40,000,260.00	4.08
	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	163,732,954.68	16.68
7	其他各项资产	4,028,742.98	0.41
8	合计	981,487,355.28	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	9,200,122.40	0.95
B	采矿业	-	-
C	制造业	307,619,966.92	31.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,091,061.81	2.07
F	批发和零售业	16,889,568.00	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	63,141,750.60	6.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,814,789.92	6.99
J	金融业	211,423,207.59	21.78
K	房地产业	41,307,271.48	4.26

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	737,487,738.72	75.97

(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	300357	我武生物	1,716,600	81,847,488.00	8.43
2	601688	华泰证券	2,951,586	66,145,042.26	6.81
3	600570	恒生电子	559,258	48,968,630.48	5.04
4	600030	中信证券	1,860,571	46,104,949.38	4.75
5	601128	常熟银行	5,648,102	42,360,765.00	4.36
6	601021	春秋航空	1,040,391	42,239,874.60	4.35
7	601318	中国平安	482,700	37,216,170.00	3.83
8	002050	三花智控	2,244,100	35,165,047.00	3.62
9	002179	中航光电	774,200	31,463,488.00	3.24
10	600004	白云机场	1,414,200	20,901,876.00	2.15

(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	30,006,000.00	3.09
	其中：政策性金融债	30,006,000.00	3.09
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）	6,231,658.90	0.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,237,658.90	3.73

（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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190302	19 进出 02	300,000	30,006,000.00	3.09
2	113020	桐昆转债	42,700	5,243,133.00	0.54
3	128047	光电转债	6,890	811,848.70	0.08
4	113021	中信转债	1,640	176,677.20	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

本基金本报告期末未投资股指期货。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“恒生电子”公告其违规情况外），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。

杭州恒生电子股份有限公司于2018年3月10日和2018年7月21日分别公告控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司涉及行政处罚事项进展公告。

2018年3月8日，恒生网络收到北京市西城区人民法院《执行通知书》、《报告财产令》、《执行裁定书》主要内容分别如下：恒生网络与证监会一案裁决已经生效，恒生网络未在规定的时间内履行义务，证监会向西城法院申请强制执行，依法冻结被执行人财产。

2018年7月19日，恒生网络收到西城法院出具的《失信决定书》以及《限制消费令》（两个文件的签署时间为2018年6月12日）。主要内容分别如下：将杭州恒生网络技术服务有限公司纳入失信被执行人名单。根据规定，恒生网络及其法定代表人宗梅苓被下达了限制消费令。

本基金管理人此前投资恒生电子股票时，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，本基金管理人就恒生电子处罚事项进行了及时分析和研究，认为恒生电子在积极配合监管机构处理处罚事项后续事宜，事件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、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	386,986.99
2	应收证券清算款	3,400,926.70
3	应收股利	-
4	应收利息	90,667.53
5	应收申购款	150,161.76

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,028,742.98

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处于转股期的可转换债券。

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。

第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为2018年12月31日，并经基金托管人复核。

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
2007年4月11日至 2007年12月31日	58.30%	1.69%	32.70%	1.41%	25.60%	0.28%
2008年度	-53.83%	2.33%	-47.00%	1.84%	-6.83%	0.49%
2009年度	84.39%	1.48%	48.51%	1.23%	35.88%	0.25%
2010年度	10.11%	1.22%	-8.02%	0.92%	18.13%	0.30%
2011年度	-23.76%	0.93%	-13.17%	0.75%	-10.59%	0.18%
2012年度	-5.06%	0.96%	3.57%	0.71%	-8.63%	0.25%
2013年度	29.66%	1.25%	-3.18%	0.75%	32.84%	0.50%
2014年度	11.10%	1.20%	34.22%	0.71%	-23.12%	0.49%
2015年度	60.21%	3.06%	10.08%	1.59%	50.13%	1.47%
2016年度	-20.58%	1.85%	-6.54%	0.94%	-14.04%	0.91%
2017年度	11.35%	0.96%	4.54%	0.36%	6.81%	0.60%
2018年度	-27.37%	1.30%	-14.78%	0.80%	-12.59%	0.50%

2007年4月11日至 2018年12月31日	59.24%	1.64%	2.91%	1.08%	56.33%	0.56%
----------------------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

第十三节 基金的费用与税收

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）基金财产拨划支付的银行费用；
- （四）基金合同生效后的信息披露费用；
- （五）基金份额持有人大会费用；
- （六）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （七）基金的证券交易费用；
- （八）在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- （九）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列支，法律法规另有规定时从其规定。

三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

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

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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

（二）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

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

四、不列入基金费用的项目

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

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

六、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

第十四节 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 11 月 24 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“第五节 相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 4、更新了“第十节 基金的投资”中基金投资组合报告，更新至2019年3月31日；
- 5、更新了“第十一节 基金的业绩”，更新至2018年12月31日；
- 6、更新了“第二十四节 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

二〇一九年五月二十五日