

# 国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）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

本基金经中国证券监督管理委员会 2016 年 1 月 5 日证监许可【2016】20 号文注册，并依据中国证监会机构部函【2017】508 号文（《关于国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）延期募集备案的回函》）进行募集。

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

本基金投资于证券市场，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。投资人根据所持有的基金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，由于市场或个股流动性不足或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运作风险，本基金的特定风险等。

本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金可投资资产支持证券，存在与基础资产相关的风险、与资产支持证券相关的风险、与专项计划管理相关的风险和其他风险。本基金在法律法规允许的前提下可进行融资、转融通证券出借业务，存在信用风险、流动性风险、投资风险和合规风险等风险，基金份额持有人需承担由此带来的风险与成本。

投资有风险，投资人认购（或申购）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，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

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 10 月 27 日，投资组合报告为 2018 年 3 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。

## 第一部分 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：壹亿壹仟万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：021-31089000，400-888-8688

股权结构：

| 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 10 月 27 日，本基金管理人共管理 93 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、国泰中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、国泰中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、国泰中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。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，历任审计部总监助理、纪检监察室副主任，现任审计部总监。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。

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，2018 年 8 月起兼任国泰结构转型灵活配置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

本基金自成立之日起至今一直由艾小军担任基金经理，无基金经理变更事宜。

## 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。

## 第二部分 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”。

### 第三部分 相关服务机构

#### 一、基金份额销售机构

##### 1、场外销售机构

###### （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<br>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）其他场外销售机构

###### ①销售银行及券商

| 序号 | 机构名称           | 机构信息                   |            |
|----|----------------|------------------------|------------|
| 1  | 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 |            |
|    |                | 法定代表人：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                   |                      |
| 2 | 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      |
| 3 | 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<br>4008-888-108           | 网址：www.csc108.com    |
| 4 | 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 |
| 5 | 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                 |                      |
| 6 | 中国银河证券股份有限公司 | 客服电话：400-888-8111/95565              |                      |
|   |              | 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      |
| 7 | 海通证券股份有限公司   | 客服电话：400-8888-888                    |                      |
|   |              | 网址：www.chinastock.com.cn             |                      |
|   |              | 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                     |                      |

|    |            |                                        |                          |
|----|------------|----------------------------------------|--------------------------|
| 8  | 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<br>4008895523 |
|    |            | 网址：www.swhysc.com                      |                          |
| 9  | 兴业证券股份有限公司 | 注册地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦               |                          |
|    |            | 法定代表人：兰荣                               | 联系人：谢高得                  |
|    |            | 电话：021-38565785                        | 传真：021-38565783          |
|    |            | 客服电话：400-888-8123                      | 网址：www.xyzq.com.cn       |
| 10 | 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       |
| 11 | 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       |
| 12 | 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        |
| 13 | 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                     |                          |
| 14 | 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                                   |                      |
| 15 | 广发证券股份有<br>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    |
| 16 | 中信证券股份有<br>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                               |                      |
| 17 | 渤海证券股份有<br>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     |
| 18 | 中信证券（山东）<br>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 |
| 19 | 长江证券股份有<br>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    |
| 20 | 国海证券股份有<br>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 |
| 21 | 中泰证券股份有<br>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  |
| 22 | 安信证券股份有<br>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                                                                                                  |                    |
| 23 | 中国中投证券有<br>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<br>心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13.<br>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                                                                                                |                    |
| 24 | 中国国际金融股<br>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<br>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                                                                                                     |                    |
| 25 | 天相投资顾问有<br>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   |
| 26 | 信达证券股份有<br>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 |

|    |            |                                             |                      |
|----|------------|---------------------------------------------|----------------------|
| 27 | 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                           |                      |
| 28 | 平安证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区中心区金田路 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：stock.pingan.com  |
| 29 | 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  |
| 30 | 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                          |                      |
| 31 | 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     |
| 32 | 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：www.cfsc.com.cn                          |                      |
| 33 | 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.gjzq.com.cn                                   |
| 34 | 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                                       |                                                      |
| 35 | 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> |
| 36 | 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                                  |

## ②第三方销售机构

| 序号 | 机构名称           | 机构信息                                      |                                                          |
|----|----------------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 1  | 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> |
| 2  | 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     |
| 3 | 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    |                       |
| 4 | 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  |
| 5 | 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<br>0571-88920897  | 网址：www.5ifund.com     |
| 6 | 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 |
| 7 | 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  |

|    |                      |                                          |                  |
|----|----------------------|------------------------------------------|------------------|
| 8  | 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                       |                  |
| 9  | 泰诚财富基金销售有限公司（大连）有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号                    |                  |
|    |                      | 法定代表人：林卓                                 |                  |
|    |                      | 电话：0411-88891212                         | 传真：0411-84396536 |
|    |                      | 客服电话：4006411999                          |                  |
|    |                      | 网址：www.taichengcaifu.com                 |                  |
| 10 | 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                  |                  |
| 11 | 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                          |                  |
| 12 | 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                            |                 |
| 13 | 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：www.520fund.com.cn                       |                 |
| 14 | 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：www.hcjijin.com                          |                 |
| 15 | 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：李修辞                                    | 联系人：邵玉磊         |
|    |                | 电话：010-59013795                             |                 |
|    |                | 网址：www.wanjiawealth.com                     |                 |
| 16 | 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：www.5irich.com                           |                 |
| 17 | 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：www.igesafe.com                          |                 |
| 18 | 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                              |                 |
|    |                  | APP 下载网址：danjuanapp.com                      |                 |
| 19 | 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                              |                 |
|    |                  | 网址：www.chtwm.com                             |                 |
| 20 | 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：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                        |                 |
| 21 | 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：兰奇                                      | 联系人：庄洁茹         |
|    |                  | 电话：021-60818110                              | 客服电话：95156 转 5  |
|    |                  | 网址：www.tonghuafund.com                       |                 |
| 22 | 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 |

## 2、场内发售机构



场内将通过上海证券交易所内具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售。具体名单详见本基金份额发售公告。

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

## 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

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

## 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

## 第四部分 基金的名称

国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）

## 第五部分 基金类型和存续期限

- 1、基金类型：股票型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型上市开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

## 第六部分 投资目标

本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 第七部分 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款等固定收益类品种、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 85%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；本基金所持有的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。

如法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人可在履行适当程序后对上述资产配置比例进行调整。

## 第八部分 投资策略

- 1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## 2、固定收益类投资工具投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

## 3、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，坚持价值投资理念，把握市场交易机会。在严格遵守法律法规的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

# 第九部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证申万证券行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布、维护或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为业绩比较基准组成部分的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十部分 风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 第十一部分 基金投资组合报告

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 10 月 23 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至 2018 年 9 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     | 208,946,676.97 | 93.25        |
|    | 其中：股票    | 208,946,676.97 | 93.25        |
| 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 | —              | —            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 13,987,068.61  | 6.24   |
| 7 | 其他各项资产            | 1,133,513.90   | 0.51   |
| 8 | 合计                | 224,067,259.48 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### （1）积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### （2）指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | -              | -            |
| 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  | -              | -            |
| J  | 金融业              | 208,946,676.97 | 94.35        |
| 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        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |

|  |    |                |       |
|--|----|----------------|-------|
|  | 合计 | 208,946,676.97 | 94.35 |
|--|----|----------------|-------|

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### （1）期末指数投资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  | 600030 | 中信证券 | 2,297,644 | 38,347,678.36 | 17.32        |
| 2  | 600837 | 海通证券 | 2,361,518 | 21,159,201.28 | 9.55         |
| 3  | 601211 | 国泰君安 | 1,093,200 | 16,387,068.00 | 7.40         |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 950,110   | 14,964,232.50 | 6.76         |
| 5  | 000776 | 广发证券 | 860,123   | 11,912,703.55 | 5.38         |
| 6  | 600958 | 东方证券 | 1,042,420 | 9,308,810.60  | 4.20         |
| 7  | 000166 | 申万宏源 | 1,971,674 | 8,872,533.00  | 4.01         |
| 8  | 600999 | 招商证券 | 663,333   | 8,709,562.29  | 3.93         |
| 9  | 601901 | 方正证券 | 1,197,521 | 6,610,315.92  | 2.98         |
| 10 | 601377 | 兴业证券 | 1,351,727 | 6,136,840.58  | 2.77         |

#### （2）期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 4、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。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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“中信证券”、“方正证券”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。

中信证券于 2017 年 9 月 21 日收到证监会北京局监管措施决定书，中信证券北京安外大街证券营业部存在违规为机构客户通过邮寄资料方式开立账户；客户的账户资料用印缺失、日期涂改；采用违规手段为客户开户申请单套印印章等行为。上述行为违反了证券公司内控指引、证券公司经纪业务管理等制度，被责令整改。

方正证券常州延陵西路证券营业部于 2017 年 12 月 14 日被证监会江苏局采取监管措施，营业部在 2014 年至 2017 年期间存在违反规定，委托无资质个人进行客户招揽活动的行为，违反了证券公司监督管理条例，被责令整改。

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）其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 38,855.34    |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 2,760.69     |
| 5  | 应收申购款   | 1,091,897.87 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 1,133,513.90 |

### （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

#### ①期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### ②期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 第十二部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2018 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。



| 阶段                                   | 净值增长率①  | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①-③   | ②-④    |
|--------------------------------------|---------|----------|----------|----------|-------|--------|
| 2017 年 4 月 27 日至<br>2017 年 12 月 31 日 | -4.09%  | 1.08%    | -7.16%   | 1.13%    | 3.07% | -0.05% |
| 2018 年上半年                            | -20.23% | 1.62%    | -20.68%  | 1.67%    | 0.45% | -0.05% |
| 2017 年 4 月 27 日至<br>2018 年 6 月 30 日  | -23.49% | 1.33%    | -26.35%  | 1.38%    | 2.86% | -0.05% |

注：2017 年 4 月 27 日为基金合同生效日。

## 第十三部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、基金上市费用和年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、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 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致

的数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径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。

## 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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 3、标的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用许可费的收取下限为每季度人民币 50,000 元（基金合同生效日所在季度除外），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

自基金合同生效之日起，标的指数使用许可费每日计提，按季支付。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季度前 10 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。

中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计算方法的，本基金将采用调整后的费率或方法计算指数使用许可费。基金管理人应及时通知基金托管人，并依照有关规定最迟于新的费率和计算方法实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 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。

基金管理人和基金托管人可根据基金运作情况调低基金管理费率和基金托管费率，无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 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纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十四部分 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 6 月 9 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“第三部分 基金管理人”中的相关内容；
- 3、更新了“第四部分 基金托管人”中的相关内容；
- 4、更新了“第五部分 相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 5、更新了“第十部分 基金的投资”中基金投资组合报告，更新至 2018 年 9 月 30 日；
- 6、更新了“第十一部分 基金的业绩”，更新至 2018 年 6 月 30 日；
- 7、更新了“第二十三部分 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

二零一八年十二月十日