

---

国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金)  
2019 年第 2 季度报告  
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一九年七月十八日

---

## § 1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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》、《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2019 年 3 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日 17:00 止。本次大会审议了《关于国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，本次会议议案于 2019 年 4 月 1 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“根据《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》和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》有关规定，同意修改国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金类别、基金合同终止条款、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费用、收益分配原则、更名为“国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金”并修订《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等。为实施国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案，授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行修改和补充，并根据《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》相关

内容对国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金实施转型。”自本次基金份额持有人大会决议生效公告之日即 2019 年 4 月 2 日起，修改后的《国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。具体可查阅本基金管理人于 2019 年 4 月 2 日披露的《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金报告期为 2019 年 4 月 1 日，国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金报告期自 2019 年 4 月 2 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

基金简称	国泰沪深300指数增强
基金主代码	000512
交易代码	000512
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月2日
报告期末基金份额总额	724,397,163.72份
投资目标	本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>（1）指数化投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。</p> <p>（2）指数增强策略</p>

	<p>本基金为指数增强型基金，在复制标的指数的基础上，主要利用指数增强量化投资策略进行个股精选，构建股票组合。具体来讲，量化投资策略主要用于精选个股，包括优选标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好或者基本面优质的股票等，力求在紧密跟踪标的指数的基础上获取超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略以国泰量化多因子模型为基础，结合组合优化模型，精选具有较高投资价值的股票构建投资组合。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度上的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会。国泰量化多因子模型基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、收益因子、成长性因子、风险因子和流动性因子等六大类对股票超额收益具有较强解释度的因子，通过构建多因子模型进行量化分析，建立股票价值评估体系。</p> <p>①价值因子 价值因子可以参考以下指标：市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）等。</p> <p>②盈利质量因子 本基金考察投资标的的盈利质量，可以参考以下指标：总资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）、销售毛利率、资产负债率、自由现金流等。</p> <p>③收益因子 收益因子可以参考以下指标：派息率等。</p> <p>④成长性因子 成长性因子可以参考以下指标：PEG、营业收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、可持续增长率（留存收益率*净资产收益率）等。</p> <p>⑤风险因子 风险因子可以参考以下指标：股价波动率、价格动量等。</p>
--	---

	<p>⑥流动性因子</p> <p>流动性因子可以参考以下指标：成交量、换手率、流通市值等。</p> <p>根据评价结果优选股票，构建股票投资组合。此外，基金管理人将依据市场环境的变化，定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，动态调整并更新各类因子的具体组合及权重。</p> <p>(3) 风险控制与调整</p> <p>本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>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0.50%，年跟踪误差不超过8%。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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>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，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。</p> <p>3、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资</p>
--	--

	<p>产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>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、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。</p> <p>7、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资于股票期权按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。</p> <p>8、融资与转融通证券出借投资策略</p> <p>本基金在参与融资与转融通证券出借业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模与转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑融资与转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。</p>	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%	
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。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰沪深 300 指数增强 A	国泰沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代	000512	002063

码		
报告期末下属分级基金的份额总额	724, 109, 103. 60 份	288, 060. 12 份

## 2.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	国泰结构转型灵活配置混合
基金主代码	000512
交易代码	000512
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月19日
报告期末基金份额总额	28, 906, 139. 91份
投资目标	通过深入研究，积极投资于我国长期经济结构转型过程中符合经济发展方向、增长前景确定且估值水平合理的优质企业，分享经济转型发展带来的高成长和高收益，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过深入分析国家产业政策并综合判断经济结构转型趋势，积极挖掘我国长期经济结构转型过程中符合经济结构调整、产业转型升级方向，且具有较高成长性和合理估值水平的上市公司股票，构建并动态优化投资组合。</p> <p>具体而言，本基金的投资策略分为两个层次：首先是大类资产配置，即采用基金管理人的资产配置评估模型（Melva），依据对宏观经济、企业盈利、流动性、估值水平等相关因素的分析，确定不同资产类别的配置比例；在大类资产配置的基础上，本基金将在受益于我国经济结构转型的产业领域内，采取自下而上的选股方法，通过系统分析上市公司基本面和估值水平，深入挖掘具有较高成长性且估值水平合理的上市公司股票，在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下，完成本基金投资组合的构建，并依据我国经济转型的推进和市场环境的演变对投资组合进行动态调整。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国泰结构转型灵活配置混合 A	国泰结构转型灵活配置混合 C
下属两级基金的交易代码	000512	002063
报告期末下属两级基金的份额总额	15,674,164.43 份	13,231,975.48 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 3.1.1 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 4 月 2 日 (基金合同生效日) - 2019 年 6 月 30 日)	
	国泰沪深 300 指数增强 A	国泰沪深 300 指数增强 C
1. 本期已实现收益	3,444,115.58	604,862.90
2. 本期利润	34,602,006.76	-1,710,703.59
3. 加权平均基金份额 本期利润	0.0883	-0.1959
4. 期末基金资产净值	1,160,864,842.03	457,111.11
5. 期末基金份额净值	1.6032	1.5869

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不

含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.1.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日)	
	国泰结构转型灵活配置混 合 A	国泰结构转型灵活配置 混合 C
1.本期已实现收益	-1,078.49	-1,006.20
2.本期利润	438,750.21	366,759.10
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0280	0.0277
4.期末基金资产净值	28,925,859.06	24,186,418.89
5.期末基金份额净值	1.845	1.828

注:(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期:2019年4月2日-2019年6月30日)

#### 3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 国泰沪深 300 指数增强 A:

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-
----	------	-------	------	-------	-----	----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		④
2019年4月2日至2019年6月30日	-2.18%	1.28%	-3.51%	1.43%	1.33%	-0.15%

注：自2019年4月2日起国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型为国泰沪深300指数增强型证券投资基金。

## 2. 国泰沪深300指数增强 C:

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 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
2019年4月2日至2019年6月30日	-2.16%	1.28%	-3.51%	1.43%	1.35%	-0.15%

注：自2019年4月2日起国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型为国泰沪深300指数增强型证券投资基金。

### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰沪深300指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年4月2日至2019年6月30日)

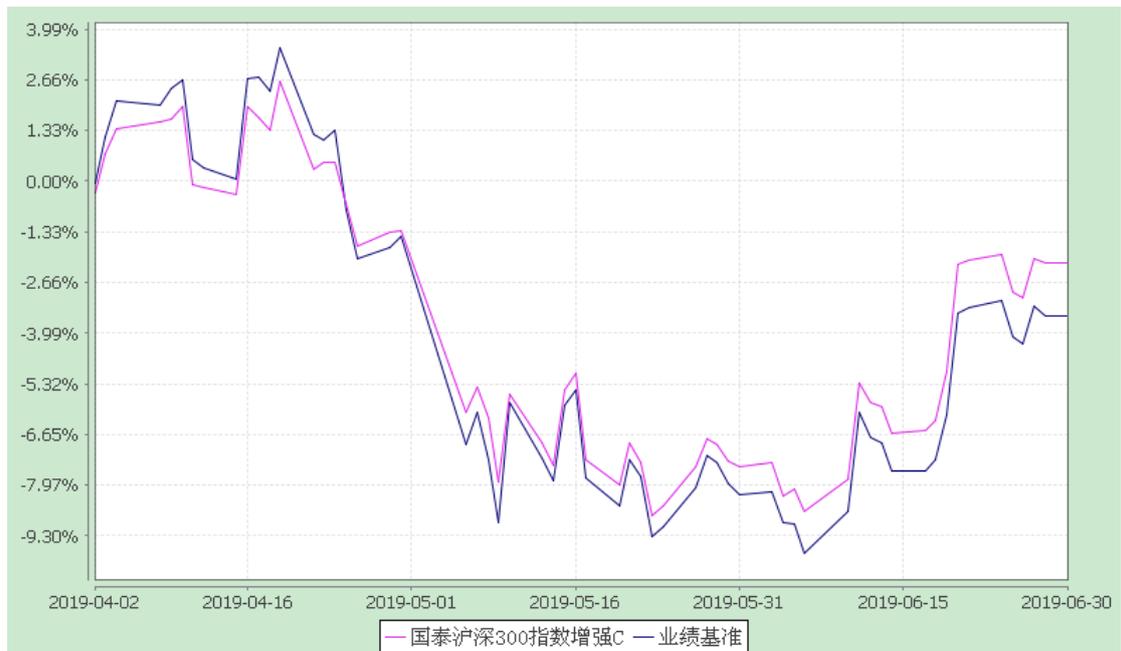
#### 1、国泰沪深300指数增强 A



注：1) 本基金合同生效日为 2019 年 4 月 2 日，截止至 2019 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年。

2) 本基金的建仓期为 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

## 2、国泰沪深 300 指数增强 C



注：1) 本基金合同生效日为 2019 年 4 月 2 日，截止至 2019 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年。

2) 本基金的建仓期为 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2019年4月1日-2019年4月1日)

#### 3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 国泰结构转型灵活配置混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2019年4月1日	1.54%	-	1.25%	-	0.29%	-

##### 2. 国泰结构转型灵活配置混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2019年4月1日	1.56%	-	1.25%	-	0.31%	-

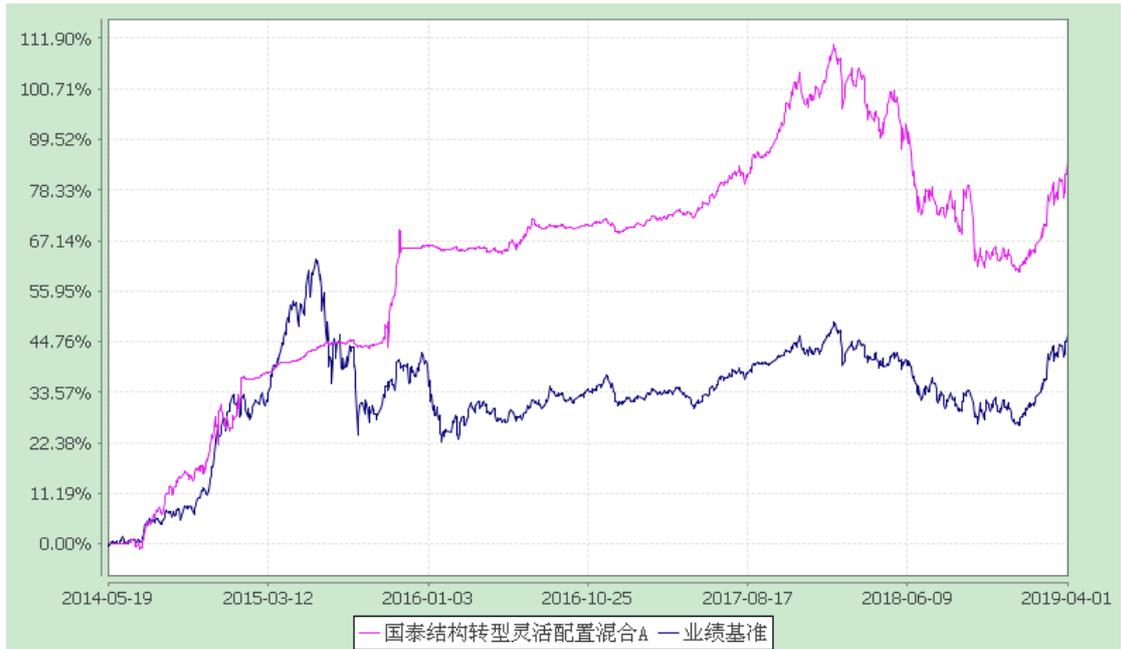
#### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

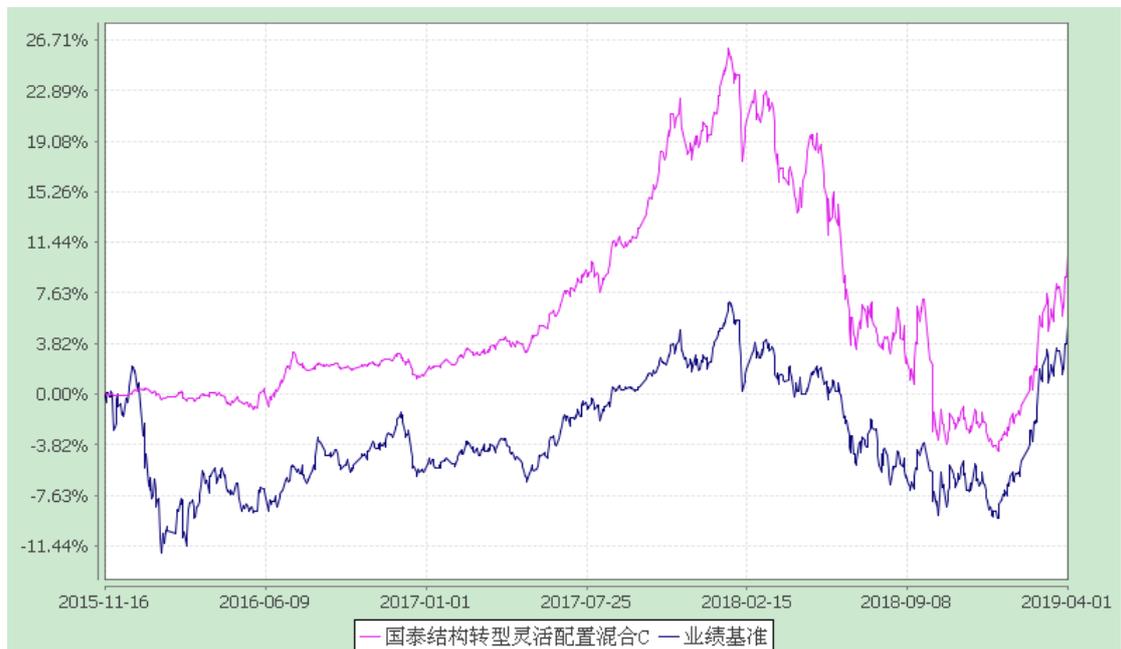
(2014年5月19日至2019年4月1日)

##### 1、国泰结构转型灵活配置混合 A



注：本基金的合同生效日为 2014 年 5 月 19 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2、国泰结构转型灵活配置混合 C



注：本基金的合同生效日为 2014 年 5 月 19 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
艾小军	本基金的基金经理、国泰黄金ETF、国泰上证180金融ETF、国泰上证180金融ETF联接、国泰深证TMT50指数分级、国泰沪深300指数、国泰黄金ETF联接、	2019-04-02	-	18年	硕士。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

	<p>国泰 中证 军工 ETF、 国泰 中证 全指 证券 公司 ETF、 国泰 国证 航天 军工 指数 (LO F)、 国泰 中证 申万 证券 行业 指数 (LO F)、 国泰 量化 成长 优选 混合、 国泰 量化 价值 精选 混合、 国泰 策略 价值 灵活 配置 混合、 国泰 CES 半导</p>			<p>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 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任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 月起至 2019 年 5 月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 月至 2019 年 4 月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，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基</p>
--	--	--	--	--

	体行业 ETF、 国泰 中证 500指 数增 强、上 证5 年期 国债 ETF、 上证 10年 期国 债 ETF 的基 金经 理、投 资总 监(量 化)、 金融 工程 总监			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）的基金经理，2019年4月起兼任国泰沪深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变更而来）的基金经理，2019年5月起兼任国泰CES半导体行业交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证500指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）的基金经理，2019年7月起兼任上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证计算机主题交易型开放式指数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。
--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕

---

交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### **4.3 公平交易专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### **4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

二季度受前期获利盘回吐以及北上资金持续大幅流出的影响，4月份A股大幅下挫，上证指数单月跌幅达到8.32%，前期表现较好的行业如计算机、通信、半导体等行业跌幅更甚。5月份受中美贸易谈判局势恶化，美国针对中国2000亿美元加征关税至25%并启动其余3000多亿美元关税加征程序影响，A股持续承压，在监管层呵护下A股维持窄幅震荡，以半导体为主的自主可控、国产替代相关主题表现出色。临近季末，受美国经济走弱、美联储重启降息预期影响，尤其是G20中美元首峰会前市场预期中美贸易局势有所缓和，市场风险偏好逐步回升。整体上A股表现先抑后扬，风格上大盘蓝筹股表现较好，成长性中小盘股表现较弱，上证指数小幅下跌3.62%，大盘蓝筹股的表征指数如上证50上涨3.24%，沪深300指数下跌1.21%，成长性中小盘股表征指数如中证500下跌10.76%，中小盘指下跌10.99%，创业板指下跌10.75%。

---

在行业表现上，以消费、白酒为主的防御行业表现较好。申万一级行业中表现较好的食品饮料、家电和银行，涨幅分别为 12.14%、2.54%和 1.26%，表现落后的为传媒、轻工、钢铁，分别下跌了 15.79%、14.11%、13.17%。

组合主要在沪深 300 成分股内进行量化基本面选股，在价值、成长之间保持平衡的同时，坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金 A 在 2019 年 4 月 1 日的净值增长率为 1.54%，同期业绩比较基准收益率为 1.25%。

国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金 C 在 2019 年 4 月 1 日的净值增长率为 1.56%，同期业绩比较基准收益率为 1.25%。

国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 在 2019 年 4 月 2 日至 2019 年 6 月 30 日期间的净值增长率为-2.18%，同期业绩比较基准收益率为-3.51%。

国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 在 2019 年 4 月 2 日至 2019 年 6 月 30 日期间的净值增长率为-2.16%，同期业绩比较基准收益率为-3.51%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

国际环境来看，在美国经济以及全球经济面临下滑的情况下，预计中美贸易纠纷短期内恶化的可能性较小，中长期来看，中美战略竞争的格局，尤其包括科技领域的竞争预计将长期化。国内环境来看，受全球经济下滑压力、美联储降息预期影响，国内货币政策可操作空间更为宽松，叠加减税降费将逐步反映到上市公司利润，上市公司整体业绩有望向好，在科创板上市开板的背景下，预计国内外宏观政策友好以及流动性相对宽松有利于市场风险偏好的持续。此外 A 股纳入 MSCI、富时指数权重因子将持续提升，尤其是中盘股将纳入指数且权重提升较大，预计外资将保持持续的净流入。总体上我们对 A 股市场保持区间震荡的观点。在中美科技竞争长期化的背景下，包括自主可控、国产替代尤其是科创板开板利好相关领域公司估值提升，风格上有业绩支撑的真成长类股票有望重新获得资金的青睐。行业上我们继续看好长期受益于中国经济结构转型以及关键领域有望突破的计算机、半导体、通信、军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工，以及受益科创板开板和风险偏好提升的证券公司行业。

我们的投资组合仍然会维持价值、成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

#### **4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期：2019年4月2日-2019年6月30日)

#### 5.1.1 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	986,715,970.75	80.64
	其中：股票	986,715,970.75	80.64
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	226,472,247.00	18.51
7	其他各项资产	10,378,616.07	0.85
8	合计	1,223,566,833.82	100.00

#### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.1.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	39,449,810.00	3.40
C	制造业	314,270,028.51	27.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,786,088.61	1.70
E	建筑业	44,014,928.00	3.79
F	批发和零售业	31,713,614.68	2.73
G	交通运输、仓储和邮政业	41,966,970.33	3.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,262,738.05	2.00
J	金融业	368,871,758.40	31.76
K	房地产业	64,137,542.00	5.52
L	租赁和商务服务业	20,855,976.30	1.80
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,654,596.00	0.14
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	13,265,586.00	1.14
S	综合	-	-
	合计	983,249,636.88	84.67

### 5.1.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.03

C	制造业	139,702.32	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	152,488.00	0.01
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	39,603.76	0.00
J	金融业	2,748,001.94	0.24
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,466,333.87	0.30

### 5.1.3 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

#### 5.1.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	750,300	66,484,083.00	5.72
2	600519	贵州茅台	58,698	57,758,832.00	4.97
3	600585	海螺水泥	557,100	23,119,650.00	1.99
4	600048	保利地产	1,811,700	23,117,292.00	1.99

5	002304	洋河股份	176,800	21,491,808.00	1.85
6	601888	中国国旅	235,262	20,855,976.30	1.80
7	601668	中国建筑	3,478,100	19,999,075.00	1.72
8	600016	民生银行	2,943,700	18,692,495.00	1.61
9	601628	中国人寿	640,300	18,133,296.00	1.56
10	601398	工商银行	3,063,300	18,042,837.00	1.55

#### 5.1.3.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002797	第一创业	418,400	2,652,656.00	0.23
2	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.03
3	601611	中国核建	19,600	152,488.00	0.01
4	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
5	600909	华安证券	9,400	61,476.00	0.01

#### 5.1.4 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。

#### 5.1.5 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。

#### 5.1.6 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。

#### 5.1.7 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。

#### 5.1.8 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。

## 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值 变动(元)	风险说明
IF1907	IF1907	82.00	93,603,000.00	3,566,340.00	-
公允价值变动总额合计(元)					3,566,340.00
股指期货投资本期收益(元)					127,689.32
股指期货投资本期公允价值变动(元)					3,566,340.00

### 5.1.9.2 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。

### 5.1.10 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。

### 5.1.11 投资组合报告附注

**5.1.11.1** 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“民生银行”、“中国人寿”、“工商银行”公告违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据民生银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司银川、太原、济南、宁波等下属分行、支行由于流动资金贷款严重违反审慎经营规则、授信业务调查审查不审慎、在项目贷款中未认真核实项目资本金和股东借款到账依据真实性等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据中国人寿 2018 年到 2019 年发布的公告，公司湖南、鞍山等分支公司由于财务科目虚列资金、在保险统计信息系统提交的业务统计表与实际情况不符，受到了当地保监会的罚款、公开批评等监管处罚。

根据工商银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，工商银行西安、贵州、广东、湖南、湖北等省下属分行、支行由于在代理销售保险业务过程中存在欺骗投保人的行为、授信业务严重违反审慎经营规则、违规签发银行承兑汇票、贷后管理不到位等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

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。

**5.1.11.2** 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。

### **5.1.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,225,456.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,553.64
5	应收申购款	103,605.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,378,616.07

### **5.1.11.4 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。

### **5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

#### **5.1.11.5.1 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。

#### **5.1.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 5.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2019年4月1日-2019年4月1日)

### 5.2.1 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	33,548,600.12	62.67
	其中：股票	33,548,600.12	62.67
2	固定收益投资	49,000.00	0.09
	其中：债券	49,000.00	0.09
	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	19,912,453.94	37.20
7	其他各项资产	24,410.29	0.05
8	合计	53,534,464.35	100.00

### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	174,980.00	0.33
B	采矿业	2,605,026.00	4.90
C	制造业	13,189,973.12	24.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,323,330.00	2.49
E	建筑业	36,800.00	0.07
F	批发和零售业	106,960.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,919,820.00	3.61
H	住宿和餐饮业	183,300.00	0.35

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,094,260.00	2.06
J	金融业	10,080,979.00	18.98
K	房地产业	2,014,472.00	3.79
L	租赁和商务服务业	629,820.00	1.19
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	188,880.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	33,548,600.12	63.17

### 5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	23,200	1,823,520.00	3.43
2	000651	格力电器	20,000	982,800.00	1.85
3	600276	恒瑞医药	13,200	867,900.00	1.63
4	002415	海康威视	20,000	737,000.00	1.39
5	600000	浦发银行	62,000	709,280.00	1.34
6	600887	伊利股份	22,600	672,802.00	1.27
7	600900	长江电力	39,000	659,100.00	1.24
8	000661	长春高新	2,000	646,180.00	1.22
9	600048	保利地产	44,000	645,480.00	1.22
10	600585	海螺水泥	16,000	635,200.00	1.20

### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	49,000.00	0.09
8	其他	-	-
9	合计	49,000.00	0.09

#### 5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110053	苏银转债	490	49,000.00	0.09

#### 5.2.6 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。

#### 5.2.7 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。

#### 5.2.8 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。

#### 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.2.9.1 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。

##### 5.2.9.2 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。

#### **5.2.10 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。

#### **5.2.11 投资组合报告附注**

5.2.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“浦发银行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据2018年5月4日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字〔2018〕4号，浦发银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求、提供不实说明材料、不配合调查取证、以贷转存，虚增存贷款、票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严、国内信用证业务贸易背景审查不严、贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款、违规通过同业投资转存款方式，虚增存款、票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理、对代理收付资金的信托计划提供保本承诺、以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产、投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大、修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符、为非保本理财产品出具保本承诺函、向关系人发放信用贷款、向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符、收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。等共计十九项违规事实。中国银监会决定对其罚款5845万元，没收违法所得10.927万元，罚没合计5855.927万元。

根据浦发银行2018年4月到2019年3月期间发布的公告，公司信用卡中心、郑州、杭州、上海、乌鲁木齐等下属分行、支行由于信用卡业务授信不审慎、违规开展存贷业务、员工管理不到位、违规开展票据业务等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

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。

5.2.11.2 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。

### 5.2.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,819.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,489.56
5	应收申购款	11,100.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,410.29

### 5.2.11.4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。

### 5.2.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	000651	格力电器	982,800.00	1.85	重大事项

## § 6 开放式基金份额变动

### 6.1 国泰沪深300指数增强型证券投资基金

单位：份

项目	国泰沪深300指数增 强A	国泰沪深300指数 增强C
基金合同生效日的基金份额总额	15,674,164.43	13,231,975.48
基金合同生效日起至报告期期末基 金总申购份额	710,365,909.60	44,102.79

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,930,970.43	12,988,018.15
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	724,109,103.60	288,060.12

## 6.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

项目	国泰结构转型灵活配置混合A	国泰结构转型灵活配置混合C
本报告期期初基金份额总额	15,679,591.32	13,231,975.48
报告期基金总申购份额	6,106.09	-
减：报告期基金总赎回份额	11,532.98	-
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,674,164.43	13,231,975.48

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

#### 7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

#### 7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

#### 7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

## 7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金

#### 8.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年4月2日至2019年4月24日	12,641,195.85	-	12,641,195.85	-	-
	2	2019年4月25日	-	30,354,207.84	-	30,354,207.84	4.19%
	3	2019年4月29日至2019年5月9日	-	62,060,937.97	-	62,060,937.97	8.57%
	4	2019年4月25日至2019年6月30日	-	260,955,968.56	-	260,955,968.56	36.02%
	5	2019年5月17日至2019年6月30日	-	182,561,148.27	-	182,561,148.27	25.20%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 8.2 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

### 8.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年4月1日	12,641,195.85	-	-	12,641,195.85	43.73%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

### 8.3 影响投资者决策的其他重要信息

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》、《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2019 年 3 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日 17:00 止。本次大会审议了《关于国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，本次会议议案于 2019 年 4 月 1 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“根据《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》和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》有关规定，同意修改国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金类别、基金合同终止条款、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费用、收益分配原则、更名为“国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金”并修订《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等。为实施国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案，授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规

---

的要求和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行修改和补充，并根据《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金实施转型。”自本次基金份额持有人大会决议生效公告之日即 2019 年 4 月 2 日起，修改后的《国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。具体可查阅本基金管理人于 2019 年 4 月 2 日披露的《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- 2、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇一九年七月十八日

