

# 国泰优势行业混合型证券投资基金 更新招募说明书摘要

（2019 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 2018 年 3 月 8 日证监许可【2018】397 号文注册募集。本基金的基金合同生效日为 2018 年 5 月 17 日。

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：因经济、政治、社会环境等因素的变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别行业或个别证券特有的非系统性风险，流动性风险，基金管理人在基金管理运作过程中产生的运作管理风险，本基金的特定风险以及由某些不可抗力因素造成的其他风险等。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金投资科创板股票时，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险和政策风险等。

本基金可投资中小企业私募债，中小企业私募债由于发行人自身特点，存在一定的违约风险。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，属于中等预期风险和预期收益的产品。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件。

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、基金产品资料概要等信息披露文件，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。

本招募说明书根据 2019 年 9 月 1 日生效的《信息披露办法》和《基金合同》、《托管协议》的修订更新了相关章节，并更新了基金管理人章节的相关内容，上述内容更新截止日为 2019 年 11 月 15 日。本招募说明书所载其他内容截止日为 2019 年 5 月 17 日，投资组合报告为 2019 年 1 季度报告，净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 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 2019 年 11 月 15 日，本基金管理人共管理 119 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）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金、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）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投

资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

### 三、主要人员情况

#### 1、董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982 年 1 月至 1992 年 10 月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年 11 月至 1998 年 2 月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理。1998 年 3 月至 2015 年 10 月在国泰基金管理有限公司工作，其中 1998 年 3 月至 1999 年 10 月任总经理，1999 年 10 月至 2015 年 8 月任董事长。2015 年 1 月至 2016 年 8 月，在中建投信托有限责任公司任纪委书记，2015 年 3 月至 2016 年 8 月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016 年 8 月至 11 月，在建投投资有限责任公司、建投华文传媒投资有限责任公司任监事长、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。2013-2019 年任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 总经理。2019 年 4 月起任 Investments & Asset Management Corporate Governance Implementation & Institutional Relations 主管。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，2019 年 7 月起任国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2019 年 4 月起任投资总监（FOF）。2015 年 8 月起任公司职工监事。

吴洪涛，监事，大学本科。曾任职于恒生电子股份有限公司。2003 年 7 月至 2008 年 1 月，任金鹰基金管理有限公司运作保障部经理。2008 年 2 月加入国泰基金管理有限公司，历任信息技术部工程师、运营管理部总监助理、运营管理部副总监，现任运营管理部总监。2019 年 5 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。

倪莹，硕士研究生，18 年金融从业经历。曾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、信息技术部兼运营管理部总监、公司总经理助理，2019 年 6 月起担任公司首席信息官。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

彭凌志，硕士研究生，12 年证券基金从业经历。2002 年 7 月至 2004 年 7 月在上海良友集团有限责任公司任资产管理部科员，2004 年 9 月至 2007 年 3 月在上海交通大学学习，2007 年 3 月至 2015 年 8 月在平安资产管理有限责任公司任投资经理。2015 年 9 月加入国泰基金管理有限公司，2015 年 12 月起任国泰互联网+股票型证券投资基金和国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经

理，2016 年 6 月至 2017 年 9 月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 4 月任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）的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰优势行业混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月起兼任国泰消费优选股票型证券投资基金的基金经理。

## （2）历任基金经理

本基金自基金成立以来一直由彭凌志担任本基金的基金经理，无基金经理变更事宜。

## 5、投资决策委员会

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。

## 第二部分 基金托管人

### （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 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

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、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 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 300 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

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，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、存托业务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 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 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、直销机构

| 序号 | 机 构 名 称                | 机 构 信 息                                                                                  |
|----|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1  | 国泰基金管理<br>有限公司直销<br>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<br>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<br>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、其他销售机构

##### （1）销售银行

| 序号 | 机 构 名 称          | 机 构 信 息                         |
|----|------------------|---------------------------------|
| 1  | 中国工商银行股<br>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：陈四清      电话：95588         |
|    |                  | 网址：www.icbc.com.cn              |
| 2  | 中国农业银行股<br>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<br>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：      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<br>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<br>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<br>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<br>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  | 中信银行股份有<br>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 |
| 9  | 中国民生银行股<br>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     |
| 10 | 中国邮政储蓄银<br>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               |                         |
| 11 | 上海农村商业银<br>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        |
| 12 | 渤海银行股份有            | 注册地址: 天津市河东区海河东路 218 号         |                         |

|    |                    |                                    |                       |
|----|--------------------|------------------------------------|-----------------------|
|    | 限公司                | 法定代表人：李伏安                          | 联系人：陈玮                |
|    |                    | 客服电话：95541                         | 传真：022-58316259       |
|    |                    | 网址：www.cbhb.com.cn                 |                       |
| 13 | 青岛银行股份有<br>限公司     | 注册地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦           |                       |
|    |                    | 法定代表人：郭少泉                          | 联系人：叶旻                |
|    |                    | 电话：0532-68629960                   | 传真：0532-85709725      |
|    |                    | 客服电话：96588（青岛）400-669-6588（全国）     |                       |
|    |                    | 网址：www.qdccb.com                   |                       |
| 14 | 深圳农村商业银<br>行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦    |                       |
|    |                    | 法定代表人：李伟                           | 联系人：王璇 宋永成            |
|    |                    | 电话：0755-25188269                   | 传真：0755-25188785      |
|    |                    | 客服电话：4001961200                    | 网址：www.4001961200.com |
| 15 | 上海银行股份有<br>限公司     | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号             |                       |
|    |                    | 法定代表人：金煜                           | 联系人：王笑                |
|    |                    | 客服电话：95594                         | 传真：021-684761111      |
|    |                    | 网址：www.bosc.cn                     |                       |
| 16 | 南京银行股份有<br>限公司     | 注册地址：南京市玄武区中山路 288 号               |                       |
|    |                    | 办公地址：南京市玄武区中山路 288 号               |                       |
|    |                    | 法定代表人：胡升荣                          | 联系人：胡阳华               |
|    |                    | 客服电话：95302                         | 传真：025-86775376       |
|    |                    | 网址：www.njcb.com.cn                 |                       |
| 17 | 中原银行股份有<br>限公司     | 注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座 |                       |
|    |                    | 办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座 |                       |
|    |                    | 法定代表人：窦荣兴                          | 联系人：牛映雪               |
|    |                    | 电话：0371-85517710                   | 传真：0371-85519869      |
|    |                    | 客服电话：95186                         | 网址：www.zybank.com.cn  |
| 18 | 光大银行股份有<br>限公司     | 注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心        |                       |
|    |                    | 法定代表人：李晓鹏                          | 联系人：刘昭宇               |
|    |                    | 电话：010-63636363                    | 传真：010-63636713       |

|    |                |                                                                  |                                                          |
|----|----------------|------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
|    |                | 客户服务热线：95595                                                     | 网址： <a href="http://www.cebbank.com">www.cebbank.com</a> |
| 19 | 平安银行股份有<br>限公司 | 注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦                                   |                                                          |
|    |                | 法定代表人：肖遂宁                                                        | 联系人：王昕                                                   |
|    |                | 电话：0755-22168032                                                 | 客服电话：95511-3 或 95501                                     |
|    |                | 网址： <a href="http://www.bank.pingan.com">www.bank.pingan.com</a> |                                                          |
| 20 | 东莞农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号                                           |                                                          |
|    |                | 法定代表：何沛良                                                         | 联系人：林培珊、杨亢                                               |
|    |                | 客服电话：0769-961122                                                 | 电话：0769-22866254                                         |
|    |                | 网址： <a href="http://www.drcbank.com">www.drcbank.com</a>         |                                                          |
| 21 | 包商银行股份有<br>限公司 | 注册地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号                                              |                                                          |
|    |                | 法定代表：李镇西                                                         | 法定代表：刘芳                                                  |
|    |                | 电话：0472-5189051                                                  | 电话：0472-5189057                                          |
|    |                | 客服电话：96016（北京、内蒙古地区）                                             |                                                          |
|    |                | 网址： <a href="http://www.bsb.com.cn">www.bsb.com.cn</a>           |                                                          |
| 22 | 晋商银行股份有<br>限公司 | 注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座                                    |                                                          |
|    |                | 法定代表：阎俊生                                                         |                                                          |
|    |                | 客服电话：95105588                                                    | 网址： <a href="http://www.jshbank.com">www.jshbank.com</a> |
| 23 | 浙商银行股份有<br>限公司 | 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号                                             |                                                          |
|    |                | 法定代表人：张达洋                                                        |                                                          |
|    |                | 客服电话：95527                                                       |                                                          |
|    |                | 网址： <a href="http://www.czbank.com">www.czbank.com</a>           |                                                          |
| 24 | 昆仑银行股份有<br>限公司 | 注册地址：新疆克拉玛依市世纪大道 7 号                                             |                                                          |
|    |                | 法定代表人：蒋尚军                                                        | 联系人：张碧华、王翔宇                                              |
|    |                | 客服电话：4006696569                                                  | 传真：010-89025421                                          |
|    |                | 网址： <a href="http://www.klb.cn">www.klb.cn</a>                   |                                                          |
| 25 | 广发银行股份有<br>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                                        |                   |
| 26 | 苏州银行股份有限公司         | 注册地址: 江苏省苏州工业园区钟园路 728 号                                       |                   |
|    |                    | 法定代表人: 王兰凤                                                     |                   |
|    |                    | 电话: 0512-69868365                                              | 传真: 0512-69868370 |
|    |                    | 客服电话: 0512-96067                                               |                   |
|    |                    | 网址: <a href="http://www.suzhoubank.com">www.suzhoubank.com</a> |                   |
| 27 | 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司 | 注册地址: 浙江省绍兴市柯桥笛扬路 1363 号                                       |                   |
|    |                    | 法定代表: 俞俊海                                                      | 联系人: 孟建潮          |
|    |                    | 电话: 0575-84788101                                              | 传真: 0575-84788134 |
|    |                    | 客服电话: 0575-81105323                                            |                   |
|    |                    | 网址: www.borf.cn                                                |                   |

(2) 第三方销售机构

| 序号 | 机构名称           | 机构信息                                        |                       |
|----|----------------|---------------------------------------------|-----------------------|
| 1  | 诺亚正行基金销售有限公司   | 注册地址: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室            |                       |
|    |                | 办公地址: 上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋                   |                       |
|    |                | 法定代表人: 汪静波                                  | 联系人: 李娟               |
|    |                | 电话: 021-38602377                            | 传真: 021-38509777      |
|    |                | 客服电话: 400-821-5399                          | 网址: www.noah-fund.com |
| 2  | 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    |
| 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  |
| 5 | 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     |
| 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 |
| 7 | 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.zseffund.com   |
| 8 | 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                |                       |
| 9 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区太月园 3 号楼 5 层 521 室         |                       |
|   |                  | 办公地址：北京市海淀区太月园 3 号楼 5 层 521 室         |                       |

|    |                    |                                                 |                      |
|----|--------------------|-------------------------------------------------|----------------------|
|    | 司                  | 法定代表：齐凌峰                                        | 联系人：阮志凌              |
|    |                    | 电话：010-82050520                                 | 传真：010-82086110      |
|    |                    | 客服电话：400-158-5050                               | 网址：www.9ifund.com    |
| 10 | 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                        |                      |
| 11 | 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：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                             |                      |
| 12 | 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：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 |
| 13 | 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                            |                      |
| 14 | 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 |
| 15 | 汇付基金销售有限公司           | 注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元        |                      |
|    |                      | 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                          |                      |
| 16 | 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                   |                      |
| 17 | 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             |                      |
| 18 | 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                  |                      |
| 19 | 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                        |                 |
| 20 | 北京微动利基金销售有限公司    | 注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 3 层 342 室         |                 |
|    |                  | 办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 342 室和 341 室      |                 |
|    |                  | 法定代表人：季长军                                      |                 |
|    |                  | 客户服务电话：400-188-5687                            |                 |
|    |                  | 网址：www.buyforyou.com.cn                        |                 |
| 21 | 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                                |                 |
| 22 | 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                               |                 |
| 23 | 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：黄玮                                        | 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                |                         |
| 24 | 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                   |                         |
| 25 | 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                   |                         |
| 26 | 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                    |                         |
| 27 | 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                   |                         |
| 28 | 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                               |                  |
| 29 | 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                      |                  |
| 30 | 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                             |                  |
| 31 | 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                        |                  |
| 32 | 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                       |                  |
| 33 | 北京植信基金销售有限公司     | 注册地址: 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67           |                  |
|    |                  | 办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号                     |                  |
|    |                  | 法定代表人: 于龙                                     | 联系人: 吴鹏          |

|    |                  |                                |                        |
|----|------------------|--------------------------------|------------------------|
|    |                  | 电话：010-56075718                | 传真：010-67767615        |
|    |                  | 客服电话：4006-802-123              |                        |
|    |                  | 网址：www.zhixin-inv.com          |                        |
| 34 | 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     |
| 35 | 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        |
| 36 | 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：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

法定代表人：陈勇胜

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路 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

联系人：丁媛

经办律师：黎明、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

国泰优势行业混合型证券投资基金

## 第五部分 基金类别、运作方式和存续期限

- 1、基金类型：混合型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

## 第六部分 投资目标

在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

## 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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政

府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、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）。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，投资于优势行业证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

## 第八部分 投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

### 2、行业投资策略

本基金主要投资于优势行业的证券。本基金所称的优势行业是指盈利增长潜力大、估值合理的行业。优势行业的评估即从盈利和估值两方面进行。

第一，盈利方面包括行业现期的盈利能力和未来的盈利增长潜力，主要通过定性分析和定量分析两种方式分析评价。定性方面，主要评价行业是否符合经济发展趋势、是否景气向上、未来发展空间是否较大，是否有政策支持。定量方面，则用行业预期主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率等指标来衡量。通过这些指标与市场平均水平和行业历史水平比较，结合定性分析结果，评价行业盈利能力和盈利增长潜力。

第二，估值方面主要评估行业现阶段估值是否合理。本基金采用市盈率、市净率、市销率、PEG、EV/EBITDA 等多种估值方法评估行业的估值水平，并将

行业估值水平与市场平均水平和行业历史水平比较，精选估值合理的行业，获得较好的安全边际。

本基金将结合盈利和估值两个方面的分析，选择盈利增长潜力大、估值合理的优势行业进行投资，以获得行业估值和盈利能力同时增长的倍乘效应。

### 3、股票投资策略

本基金结合对优势行业中各公司财务指标的分析和各公司在所属行业当中的竞争地位、企业的盈利前景及成长空间等的分析研究，精选出有竞争优势、在产业链中有定价权的公司进行投资。

### 4、债券投资策略

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

### 5、资产支持证券投资策略

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，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### 6、中小企业私募债投资策略

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。

### 7、非公开发行股票投资策略

本基金从发展前景和估值水平两个角度出发，通过定性和定量分析相结合的方法评价定向增发项目对上市公司未来价值的影响。结合定向增发发行价格与市场交易价格价差的大小，理性做出投资决策。

### 8、权证投资策略

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

## 9、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。

## 10、国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

## 第九部分 业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%。

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

- 1、沪深 300 指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；
- 2、沪深 300 指数编制和发布有一定的历史，有较高的知名度和市场影响力；
- 3、沪深 300 指数是中证指数有限公司编制推出的沪深两个市场第一个统一指数；
- 4、中债综合指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数。该指数的样本主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等。

基于本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

随着法律法规和市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 2 个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

## 第十部分 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，属于中等预期风险和预期收益的产品。

## 第十一部分 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。

### 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              | 624,478,819.38 | 90.95        |
|    | 其中：股票             | 624,478,819.38 | 90.95        |
| 2  | 固定收益投资            | 378,000.00     | 0.06         |
|    | 其中：债券             | 378,000.00     | 0.06         |
|    | 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      | 43,525,788.15  | 6.34         |
| 7  | 其他各项资产            | 18,222,504.77  | 2.65         |
| 8  | 合计                | 686,605,112.30 | 100.00       |

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | —              | —     |
| C | 制造业              | 145,631,847.57 | 21.74 |
| 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           | 41,384,593.08  | 6.18  |
| 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  | 410,183,143.53 | 61.24 |
| J | 金融业              | 7,421,428.00   | 1.11  |
| 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       | 19,857,807.20  | 2.96  |
| 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               | 624,478,819.38 | 93.24 |

### 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  | 600570 | 恒生电子 | 711,138   | 62,267,243.28 | 9.30         |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 2,366,112 | 45,855,250.56 | 6.85         |
| 3  | 300033 | 同花顺  | 401,086   | 40,048,437.10 | 5.98         |
| 4  | 600588 | 用友网络 | 1,051,890 | 35,659,071.00 | 5.32         |
| 5  | 002153 | 石基信息 | 716,736   | 23,401,430.40 | 3.49         |
| 6  | 002410 | 广联达  | 736,082   | 21,942,604.42 | 3.28         |
| 7  | 002463 | 沪电股份 | 1,817,874 | 20,960,087.22 | 3.13         |
| 8  | 002916 | 深南电路 | 168,408   | 20,951,639.28 | 3.13         |
| 9  | 603899 | 晨光文具 | 563,628   | 20,854,236.00 | 3.11         |
| 10 | 603883 | 老百姓  | 329,765   | 20,735,623.20 | 3.10         |

#### 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） | 378,000.00 | 0.06         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 378,000.00 | 0.06         |

#### 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<br>(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-------------|--------------|
| 1  | 113531 | 百姓转债 | 3,780 | 378,000.00  | 0.06         |

#### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 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“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   | 511,628.58    |
| 2  | 应收证券清算款 | 17,306,134.83 |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 13,641.97     |
| 5  | 应收申购款   | 391,099.39    |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 18,222,504.77 |

### （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。

## 第十二部分 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   |
|--------------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 2018 年 5 月 17 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | -17.59% | 1.19%     | -17.86%    | 1.15%         | 0.27% | 0.04% |

注：2018 年 5 月 17 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。法律法规另有规定的，从其规定。

## 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》、《公开募集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2019年6月29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、根据 2019 年 9 月 1 日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》绪言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容；
- 2、更新了“重要提示”中招募说明书内容的截止日期等相关内容；
- 3、更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容。

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**

**二零一九年十二月三十一日**