

**国泰金牛创新成长混合型  
证券投资基金更新招募说明书**  
(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：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金根据 2007 年 4 月 20 日中国证券监督管理委员会《关于同意国泰金牛创新成长股票型证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2007]118 号）核准募集。本基金的基金合同生效日为 2007 年 5 月 18 日。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰金牛创新成长股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，本基金自 2015 年 8 月 8 日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由“国泰金牛创新成长股票型证券投资基金”修订为“国泰金牛创新成长混合型证券投资基金”，基金合同和托管协议部分条款相应修订。

国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”或“管理人”）保证本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审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均不表明其对本基金的价值和收益作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。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》、基金产品资料概要。

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 18 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。

## 目 录

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| 第一节 绪 言.....                 | 4   |
| 第二节 释 义.....                 | 4   |
| 第三节 基金管理人.....               | 8   |
| 第四节 基金托管人.....               | 22  |
| 第五节 相关服务机构.....              | 24  |
| 第六节 基金的募集.....               | 49  |
| 第七节 基金合同的生效.....             | 50  |
| 第八节 基金份额的申购、赎回与转换.....       | 50  |
| 第九节 基金的投资.....               | 59  |
| 第十节 基金的业绩.....               | 71  |
| 第十一节 基金的财产.....              | 71  |
| 第十二节 基金资产的估值.....            | 72  |
| 第十三节 基金的收益与分配.....           | 77  |
| 第十四节 基金的费用与税收.....           | 78  |
| 第十五节 基金的会计与审计.....           | 80  |
| 第十六节 基金的信息披露.....            | 81  |
| 第十七节 风险揭示.....               | 85  |
| 第十八节 基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 90  |
| 第十九节 基金合同内容摘要.....           | 92  |
| 第二十节 基金托管协议的内容摘要.....        | 103 |
| 第二十一节 对基金份额持有人的服务.....       | 110 |
| 第二十二节 其他应披露的事项.....          | 111 |
| 第二十三节 招募说明书的存放和查阅方式.....     | 112 |
| 第二十四节 备查文件.....              | 112 |

## 第一节 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他相关法律法规的规定以及《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 第二节 释 义

招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

|           |                                             |
|-----------|---------------------------------------------|
| 基金或本基金：   | 指国泰金牛创新成长混合型证券投资基金；                         |
| 本合同、基金合同： | 指《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充；      |
| 招募说明书：    | 指《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；              |
| 发售公告：     | 指《国泰金牛创新成长股票型证券投资基金份额发售公告》；                 |
| 中国：       | 指中华人民共和国（仅为本基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）； |

|              |                                                                                                                                            |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 法律法规：        | 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件；                                                                                           |
| 托管协议：        | 指《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金基金托管协议》及其任何有效修订和补充；                                                                                                     |
| 《基金法》：       | 指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订； |
| 《销售办法》：      | 指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                        |
| 《运作办法》：      | 指《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                                                             |
| 《信息披露办法》：    | 指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                                  |
| 《证券法》：       | 指由中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议于 2005 年 10 月 27 日修订通过的自 2006 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券法》及不时作出的修订；                                            |
| 《流动性风险管理规定》： | 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；                                                             |
| 元：           | 指中国法定货币人民币元；                                                                                                                               |
| 业务规则：        | 指《国泰基金管理有限公司开放式基金业务规则》；                                                                                                                    |
| 中国证监会：       | 指中国证券监督管理委员会；                                                                                                                              |
| 银行监管机构：      | 指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构；                                                                                                                 |
| 基金管理人：       | 指国泰基金管理有限公司；                                                                                                                               |
| 基金托管人：       | 指中国农业银行股份有限公司；                                                                                                                             |
| 基金销售代理人：     | 指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构；                                                                                                 |

|            |                                                                           |
|------------|---------------------------------------------------------------------------|
| 销售机构：      | 指基金管理人及基金销售代理人；                                                           |
| 基金销售网点：    | 指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点；                                                 |
| 注册登记：      | 指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等； |
| 注册登记机构：    | 指国泰基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的机构；                                                |
| 基金合同当事人：   | 指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；                             |
| 个人投资者：     | 指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的自然人；                                        |
| 机构投资者：     | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；          |
| 合格境外机构投资者： | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者；                         |
| 投资者：       | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；                        |
| 基金合同生效日：   | 指基金募集期满，基金募集情况符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；    |
| 募集期：       | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；                   |
| 存续期：       | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限；                                                       |
| 日/天：       | 指公历日；                                                                     |
| 月：         | 指公历月；                                                                     |
| 工作日：       | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；                                                   |
| T 日：       | 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；                                                |
| T+n 日：     | 指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；                                           |
| 认购：        | 指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；                                      |

|           |                                                                                      |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| 申购：       | 指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；                                                    |
| 赎回：       | 指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；                                                |
| 转换：       | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；                  |
| 基金账户：     | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；                                |
| 交易账户：     | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户；                                        |
| 定期定额投资计划： | 指投资者通过有关销售机构提出申请，定期、定额申购本基金，由销售机构按照约定的扣款日期、扣款金额及扣款方式在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式； |
| 转托管：      | 指基金份额持有人将其所持有的某一基金的基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为；                             |
| 基金收益：     | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；                                              |
| 基金资产总值：   | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；                                     |
| 基金资产净值：   | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；                                                                   |
| 基金份额净值：   | 指基金资产净值除以基金份额余额所得的基金单位份额的价值；                                                         |
| 基金资产估值：   | 指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；                                                |

- 流动性受限资产：**指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
- 指定媒介：**指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
- 不可抗力：**指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等；
- 基金产品资料概要：**指《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）。

### 第三节 基金管理人

#### 一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

成立日期：1998 年 3 月 5 日

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1 亿元人民币

联系人：辛怡

联系电话：（021）31089000，4008888688

基金管理人股权结构如下：

| 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

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

#### （一）董事会成员：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982 年 1 月至 1992 年 10 月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年 11 月至 1998 年 2 月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理。1998 年 3 月至 2015 年 10 月在国泰基金管理有限公司工作，其中 1998 年 3 月至 1999 年 10 月任总经理，1999 年 10 月至 2015 年 8 月任董事长。2015 年 1 月至 2016 年 8 月，在中建投信托有限责任公司任纪委书记，2015 年 3 月至 2016 年 8 月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016 年 8 月至 11 月，在建投投资有限责任公司、建投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。

## （二）监事会成员：

梁凤玉，监事会主席，硕士研究生，高级会计师。1994 年 8 月至 2006 年 6 月，先后于建设银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作，任业务经理、副行

长、副总经理等职。2006 年 7 月至 2007 年 3 月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007 年 4 月至 2008 年 2 月在中国投资咨询公司任财务总监。2008 年 3 月至 2012 年 8 月在中国建银投资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012 年 9 月至 2014 年 8 月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014 年 12 月起任公司监事会主席。

Yezdi Phiroze Chinoy, 监事, 大学本科。1995 年 12 月至 2000 年 5 月在 Jardine Fleming India 任公司秘书及法务。2000 年 9 月至 2003 年 2 月, 在 Dresdner Kleinwort Benson 任合规部主管、公司秘书兼法务。2003 年 3 月至 2008 年 1 月任 JP Morgan Chase India 合规部副总经理。2008 年 2 月至 2008 年 8 月任 Prudential Property Investment Management Singapore 法律及合规部主管。2008 年 8 月至 2014 年 3 月任 Allianz Global Investors Singapore Limited 东南亚及南亚合规部主管。2014 年 3 月 17 日起任 Generali Investments Asia Limited 首席执行官。2016 年 12 月 1 日起任 Generali Investments Asia Limited 执行董事。2014 年 12 月起任公司监事。

刘锡忠, 监事, 研究生。1989 年 2 月至 1995 年 5 月, 中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1995 年 6 月至 2005 年 6 月, 在华北电力集团财务有限公司工作, 历任部门经理、副总经理。2005 年 7 月起在中国电力财务有限公司工作, 历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任, 现任风险管理部主任。2017 年 3 月起任公司监事。

邓时锋, 监事, 硕士研究生。曾任职于天同证券。2001 年 9 月加盟国泰基金管理有限公司, 历任行业研究员、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。

（三）高级管理人员：

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

李辉，大学本科，19年金融从业经历。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司，2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司，2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司，2005年7月至2007年7月任职于AIG集团，2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司，先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人，2015年8月至2017年2月任公司总经理助理，2017年2月起担任公司副总经理。

封雪梅，硕士研究生，21年金融从业经历。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。

#### （四）本基金基金经理及相关研究人员配备

##### 1、现任基金经理

程洲，硕士研究生，CFA，19 年证券基金从业经历。曾任职于申银万国证券研究所。2004 年 4 月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级策略分析师、基金经理助理，2008 年 4 月至 2014 年 3 月任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2009 年 12 月至 2012 年 12 月任金泰证券投资基金的基金经理，2010 年 2 月至 2011 年 12 月任国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的基金经理，2012 年 12 月至 2017 年 1 月任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）的基金经理，2013 年 12 月起兼任国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月起兼任国泰金牛创新成长混合型证券投资基金（原国泰金牛创新成长股票型证券投资基金）的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 6 月起兼任国泰大农业股票型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 3 月起兼任国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月起兼任国泰鑫睿混合型证券投资基金的基金经理。

##### 2、历任基金经理

2007 年 5 月 18 日至 2009 年 12 月 1 日，由何江旭担任本基金的基金经理，2009 年 12 月 2 日起至 2015 年 1 月 25 日由范迪钊担任本基金的基金经理，2015 年 1 月 26 日起至今由程洲担任本基金的基金经理。

##### 3、相关研究人员配备

为确保实现基金合同规定的投资目标，本基金专门配备了精通基本面研究和数量分析的研究人员协助基金经理的投资管理工作。研究开发部在对宏观经济发展态势、利率走势和行业个股分析的基础上拟定投资建议；金融工程研究人员负责数量分析，根据历史模拟和风险测算的结果提出投资可行性分析。

#### （五）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

（六）上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

#### 四、基金管理人的职责

（一）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（二）办理基金备案手续；

（三）对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

（四）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（七）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（九）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（十）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（十一）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（十二）有关法律、法规和中国证监会规定的其它职责。

## 五、基金管理人的承诺

（一）基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

（二）基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- 1、将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- 2、不公平地对待其管理的不同基金财产；
- 3、利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

（三）基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营；
- 2、违反基金合同或托管协议；
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

7、违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

8、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

- 9、贬损同行，以抬高自己；
- 10、以不正当手段谋求业务发展；
- 11、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- 13、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（四）基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

（五）基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

## 六、基金经理的承诺

（一）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（二）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（三）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，且不利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（四）不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人的内部控制制度

### （一）内部控制制度概述

基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险，保证经营活动的合法合规和有效开展，制定了一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施，形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面，并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。

#### 1、内部风险控制遵循的原则

（1）全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

（2）独立性原则：公司设立独立的稽核监察部门，稽核监察部门保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；

（3）相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

（4）保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；

（5）定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

#### 2、内部会计控制制度

公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求，建立了完善的内部会计控制制度，实现了职责分离和岗位相互制约，确保会计核算的真实、准确、完整，并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立，保护基金资产的独立、安全。

#### 3、风险管理控制制度

公司为有效控制管理运营中的风险，建立了一整套完整的风险管理控制制度，其内容由一系列的具体制度构成，主要包括：岗位分离和空间分离制度、投资管理控制制度、信息技术控制、营销业务控制、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度、人力资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程，对公司面临的投资风险和管理风险进行有效的控制。

#### 4、监察稽核制度

公司实行独立的监察稽核制度，通过对稽核监察部门充分授权，对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循情况和有效性进行全面的独立监察稽核，确保公司经营的合法合规性和内部控制的有效性。

##### （二）基金管理人内部控制制度要素

##### 1、控制环境

公司经过多年的管理实践，建立了良好的控制环境，以保证内部会计控制和管理控制的有效实施，主要包括科学的公司治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经营理念、独立的监察稽核职能等方面。

（1）公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事 4 名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

（2）在组织结构方面，公司设立的执行委员会、投资决策委员会、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

（3）公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

（4）公司稽核监察部门拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

##### 2、控制的性质和范围

##### （1）内部会计控制

公司建立了完善的内部会计控制，保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。

首先，公司根据国家有关法律法规、有关会计制度和准则，制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及会计业务控制流程，做好基金业务和公司经营的核算工作，真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司财务状况。

其次，公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开，保证两者相互独立，各基金之间做到独立建账、独立核算，保证基金资产和公司资产之间、以及各基金资产之间的相互独立性。

公司建立了严格的岗位职责分离控制、凭证与记录控制、资产接触控制、独立稽核等制度，确保在基金核算和公司财务管理中做到对资源的有效控制、有关功能的相互分离和各岗位的相互监督等。

另外公司还建立了严格的财务管理制度，执行严格的预算管理和财务费用审批制度，加强成本控制和监督。

## （2）风险管理控制

公司在经营管理中建立了有效的风险管理控制体系，主要包括：

**岗位分离和空间隔离制度：**为保证各部门的相对独立性，公司建立了明确的岗位分离制度；同时实行空间隔离制度，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密；

**投资管理业务控制：**通过建立完整的研究业务控制、投资决策控制、交易业务控制，完善投资决策委员会的投资决策职能和风险管理委员会的风险控制职能，实行投资总监和基金经理分级授权制度和股票池制度，进行集中交易，以及风险管理部对投资交易实时监控等，加强投资管理控制，做到研究、投资、交易、风险控制的相互独立、相互制约和相互配合，有效控制操作风险；建立了科学先进的投资风险量化评估和管理体系，控制投资业务中面临的市场风险、集中风险、流动性风险等；建立了科学合理的投资业绩绩效评估体系，对投资管理的风险和业绩进行及时评估和反馈；

**信息技术控制：**为保证信息技术系统的安全稳定，公司在硬件设备运行维护、软件采购维护、网络安全、数据库管理、危机处理机制等方面均制定实施了完善的制度和控制流程；

**营销业务控制：**公司制定了完善的市场营销、客户开发和客户服务制度，以保证在营销业务中对有关法律法规的遵守，以及对经营风险的有效控制；

**信息披露控制和资料保全制度：**公司制定了规范的信息披露管理办法，保证信息披露的及时、准确和完整；在资料保全方面，建立了完善的信息资料保全备份系统，以及完整的会计、统计和各种业务资料档案；

**独立的监察稽核制度：**稽核监察部门有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

## （3）内部控制制度的实施

公司风险管理委员会首先从总体上制定了公司风险控制制度，对公司面临的主要风险进行辨识和评估，制定了风险控制原则。在风险管理委员会总体方针指导下，各部门根据各自业务特点，对业务活动中存在的风险点进行了揭示和梳理，有针对性地建立了详细的风险控制流程，并在实际业务中加以控制。

## 3、内部控制制度实施情况检查

公司稽核监察部门在进行风险评估的基础上，对公司各业务活动中内部控制措施的实施情况进行定期和不定期的监察稽核，重点是业务活动中风险暴露程度较高的环节，以确保公司经营合法合规、以及内部控制制度的有效遵循。

在确保现有内部控制制度实施情况的基础上，公司会根据新业务开展和市场变化情况，对内部控制制度进行及时的更新和调整，以适应公司经营活动的变化。公司稽核监察部门在

对内部控制制度的执行情况进行监察稽核的基础上,也会重点对内部控制制度的有效性进行评估,并提出相应改进建议。

#### 4、内部控制制度实施情况的报告

公司建立了有效的内部控制制度实施报告流程,各部门对于内部控制制度实施过程中出现的失效情况须及时向公司高级管理层和稽核监察部门报告,使公司高级管理层和稽核监察部门及时了解内部控制出现的问题并作出妥善处理。

稽核监察部门在对内部控制实施情况的监察中,对发现的问题均立即向公司高级管理层报告,并提出相应的建议,对于重大问题,则通过督察长及时向公司董事长和中国证监会报告。同时稽核监察部门定期出具独立的监察稽核报告,直接报公司董事长和中国证监会。

#### （三）基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实、准确,并承诺基金管理人将根据市场变化和业务发展不断完善内部控制制度,切实维护基金份额持有人的合法权益。

## 第四节 基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行

同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 486 只。

### （二）基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

## 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五节 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### （一）直销机构

| 序号 | 机构名称           | 机构信息                                                                                 |                   |
|----|----------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司直销柜台 | 地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层                                                        |                   |
|    |                | 客户服务专线:400-888-8688, 021-31089000                                                    |                   |
|    |                | 传真:021-31081861                                                                      | 网址:www.gtfund.com |
| 2  | 国泰基金电子交易平台     | 电子交易网站:www.gtfund.com 登录网上交易页面<br>智能手机APP平台:iphone交易客户端、Android交易客户端<br>“国泰基金”微信交易平台 |                   |

|  |  |                 |         |
|--|--|-----------------|---------|
|  |  | 电话：021-31081738 | 联系人：李静姝 |
|--|--|-----------------|---------|

（二）其他销售机构

（1）销售银行及券商

| 序号 | 机构名称           | 机构信息                           |                     |
|----|----------------|--------------------------------|---------------------|
| 1  | 中国工商银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） |                     |
|    |                | 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） |                     |
|    |                | 法定代表人：                         | 电话：95588            |
|    |                | 网址：www.icbc.com.cn             |                     |
| 2  | 中国农业银行股份有限公司   | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号         |                     |
|    |                | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号         |                     |
|    |                | 法定代表人：周慕冰                      | 客户服务电话：95599        |
|    |                | 联系人：客户服务中心                     | 传真：010-85109219     |
|    |                | 网址：www.95599.cn                |                     |
| 3  | 中国银行股份有限公司     | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号          |                     |
|    |                | 法定代表人：陈四清                      | 联系人：客户服务中心          |
|    |                | 客服电话：95566                     | 网址：www.boc.cn       |
| 4  | 中国建设银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号           |                     |
|    |                | 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼     |                     |
|    |                | 法定代表人：田国立                      | 客服电话：95533          |
|    |                | 网址：www.ccb.com                 |                     |
| 5  | 交通银行股份有限公司     | 注册地址：上海市银城中路 188 号             |                     |
|    |                | 法定代表人：彭纯                       | 客服电话：95559          |
|    |                | 联系人：王菁                         | 电话：021-58781234     |
|    |                | 网址：www.bankcomm.com            |                     |
| 6  | 招商银行股份有限公司     | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦      |                     |
|    |                | 法定代表人：李建红                      | 联系人：邓炯鹏             |
|    |                | 电话：0755-83198888               | 传真：0755-83195109    |
|    |                | 客户服务热线：95555                   | 网址：www.cmbchina.com |
| 7  | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：上海市中山东一路 12 号             |                     |
|    |                | 办公地址：上海市中山东一路 12 号             |                     |

|    |                    |                               |                            |
|----|--------------------|-------------------------------|----------------------------|
|    |                    | 法定代表人：高国富                     | 电话：021-61618888            |
|    |                    | 联系人：高天、虞谷云                    | 客户服务热线：95528               |
| 8  | 华夏银行股份有<br>限公司     | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号        |                            |
|    |                    | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号        |                            |
|    |                    | 法定代表人：吴建                      | 客户服务热线：95577               |
|    |                    | 网址：www.hxb.com.cn             |                            |
| 9  | 中信银行股份有<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：<br>www.bank.ecitic.com |
| 10 | 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         |
| 11 | 北京银行股份有<br>限公司     | 注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层       |                            |
|    |                    | 法定代表人：闫冰竹                     | 联系人：谢小华                    |
|    |                    | 电话：010-66223587               | 传真：010-66226045            |
|    |                    | 客服电话：010-95526                |                            |
|    |                    | 网址：www.bankofbeijing.com.cn   |                            |
| 12 | 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               |                            |
| 13 | 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            |
| 14 | 杭州银行股份有<br>限公司     | 注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦        |                            |
|    |                    | 法定代表人：吴太普                     | 联系人：严峻                     |
|    |                    | 电话：0571-85163127              | 传真：0571-85179591           |

|    |                |                                    |                       |
|----|----------------|------------------------------------|-----------------------|
|    |                | 客服电话：400-888-8508                  | 网址：www.hzbank.com.cn  |
| 15 | 渤海银行股份有限公司     | 注册地址：天津市河东区海河东路 218 号              |                       |
|    |                | 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                 |                       |
| 16 | 青岛银行股份有限公司     | 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                   |                       |
| 17 | 洛阳银行股份有限公司     | 注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口              |                       |
|    |                | 法定代表人：王建甫                          | 联系人：胡艳丽               |
|    |                | 电话：0379-65921977                   | 传真：0379-65920155      |
|    |                | 客服电话：0379-96699                    |                       |
|    |                | 网址：www.bankofluoyang.com.cn        |                       |
| 18 | 深圳农村商业银行股份有限公司 | 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 |
| 19 | 大连银行股份有限公司     | 注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼     |                       |
|    |                | 法定代表人：陈占维                          | 联系人：李鹏                |
|    |                | 电话：0411-82308602                   | 传真：0411-82311420      |
|    |                | 客服电话：400-664-0099                  | 网址：www.bankofd1.com   |
| 20 | 中原银行股份有限公司     | 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  |
| 21 |                | 注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦     |                       |

|    |                          |                        |                         |
|----|--------------------------|------------------------|-------------------------|
|    | 平安银行股份有<br>限公司           | 法定代表人：肖遂宁              | 联系人：王昕                  |
|    |                          | 电话：0755-22168032       | 客服电话：95511-3 或<br>95501 |
|    |                          | 网址：www.bank.pingan.com |                         |
| 22 | 哈尔滨银行股份<br>有限公司          | 注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 |                         |
|    |                          | 法定代表人：郭志文              | 联系人：吴昊、冯小航              |
|    |                          | 电话：0451-86779608       | 传真：0451-86779218        |
|    |                          | 客服电话：95537             |                         |
|    |                          | 网址：www.hrbb.com.cn     |                         |
| 23 | 广州农村商业银<br>行股份有限公司       | 注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 |                         |
|    |                          | 法定代表：王继康               | 联系人：卢媛薇、陈捷              |
|    |                          | 客服电话：95313             | 电话：020-28852729         |
|    |                          | 网址：www.grcbank.com     |                         |
| 24 | 东莞农村商业银<br>行股份有限公司       | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 |                         |
|    |                          | 法定代表：何沛良               | 联系人：林培珊、杨亢              |
|    |                          | 客服电话：0769-961122       | 电话：0769-22866254        |
|    |                          | 网址：www.drcbank.com     |                         |
| 25 | 杭州联合农村商<br>业银行股份有限<br>公司 | 注册地址：杭州市建国中路 99 号      |                         |
|    |                          | 法定代表：张晨                | 联系人：仇侃宁                 |
|    |                          | 电话：0571-87923225       | 传真：0571-87923214        |
|    |                          | 客服电话：96592             | 网址：www.urcb.com         |
| 26 | 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：www.bsb.com.cn      |                         |
| 27 | 山东寿光农村商<br>业银行股份有限<br>公司 | 注册地址：山东寿光市银海路 19 号     |                         |
|    |                          | 法定代表：颜廷军               | 联系人：周淑贞                 |
|    |                          | 电话：0536-5293756        | 传真：0536-5293756         |
|    |                          | 客服电话：0536-96633        |                         |

|    |                  |                               |                    |
|----|------------------|-------------------------------|--------------------|
| 28 | 晋商银行股份有限公司       | 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：www.jshbank.com |
| 29 | 宁波银行股份有限公司       | 注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号         |                    |
|    |                  | 法定代表人：陆华裕                     |                    |
|    |                  | 客服电话：95574                    |                    |
|    |                  | 网址：www.nbcb.com.cn            |                    |
| 30 | 浙商银行股份有限公司       | 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号          |                    |
|    |                  | 法定代表人：张达洋                     |                    |
|    |                  | 客服电话：95527                    |                    |
|    |                  | 网址：www.czbank.com             |                    |
| 31 | 张家港农村商业银行股份有限公司  | 注册地址：张家港市人民中路 66 号            |                    |
|    |                  | 法定代表：王自忠                      | 联系人：朱芳             |
|    |                  | 电话：0512-96065                 | 客服电话：0512-96065    |
|    |                  | 传真：051256968259               |                    |
|    |                  | 网址：www.zrcbank.com            |                    |
| 32 | 广发银行股份有限公司       | 注册地址：广东省越秀区东风东路 713 号         |                    |
|    |                  | 法定代表人：王滨                      |                    |
|    |                  | 电话：020-38322888               | 传真：020-87310955    |
|    |                  | 客服电话：400-830-8003             |                    |
|    |                  | 网址：www.cgbchina.com.cn        |                    |
| 33 | 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：www.suzhoubank.com         |                    |
| 34 | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：常州市和平中路 413 号            |                    |
|    |                  | 法定代表：陆向阳                      | 联系人：包静             |
|    |                  | 电话：0519-89995170              | 传真：0519-89995170   |

|    |              |                                      |                              |
|----|--------------|--------------------------------------|------------------------------|
|    |              | 客服电话：(0519)96005                     |                              |
|    |              | 网址：www.jnbank.com.cn.                |                              |
| 35 | 国泰君安证券股份有限公司 | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号          |                              |
|    |              | 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼    |                              |
|    |              | 法定代表人：杨德红                            |                              |
|    |              | 客服电话：95521                           | 网址：www.gtja.com              |
| 36 | 中信建投证券股份有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼             |                              |
|    |              | 法定代表人：王常青                            | 联系人：许梦园                      |
|    |              | 电话：010-85156398                      | 传真：无                         |
|    |              | 客服电话：95587<br>4008-888-108           | 网址：www.csc108.com            |
| 37 | 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         |
| 38 | 招商证券股份有限公司   | 注册地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼     |                              |
|    |              | 法定代表人：霍达                             | 联系人：黄婵君                      |
|    |              | 电话：0755-82960167                     | 传真：0755-83734343             |
|    |              | 网址：www.newone.com.cn                 |                              |
|    |              | 客服电话：400-888-8111/95565              |                              |
| 39 | 中国银河证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层           |                              |
|    |              | 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座       |                              |
|    |              | 法定代表人：陈共炎                            |                              |
|    |              | 客服电话：4008-888-888 或 95551            | 网址：<br>www.chinastock.com.cn |
| 40 | 海通证券股份有限公司   | 注册地址：上海市广东路 689 号                    |                              |
|    |              | 法定代表人：王开国                            | 联系人：李笑鸣                      |
|    |              | 电话：021-23219000                      | 传真：021-63602722              |
|    |              | 客服电话：95553                           |                              |

|    |            |                                           |                           |
|----|------------|-------------------------------------------|---------------------------|
|    |            | 网址: www.htsec.com                         |                           |
| 41 | 申万宏源证券有限公司 | 注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层                |                           |
|    |            | 法定代表人: 李梅                                 | 联系人: 陈飙                   |
|    |            | 电话: 021- 33388254                         | 客服电话: 95523<br>4008895523 |
|    |            | 网址: www.swhysc.com                        |                           |
| 42 | 兴业证券股份有限公司 | 注册地址: 福建省福州市湖东路 268 号                     |                           |
|    |            | 办公地址: 上海市浦东新区长柳路 36 号                     |                           |
|    |            | 法定代表人: 杨华辉                                |                           |
|    |            | 客服电话: 95562                               | 网址: www.xyzq.com.cn       |
| 43 | 万联证券股份有限公司 | 注册地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层   |                           |
|    |            | 法定代表人: 罗钦城                                | 联系人: 甘蕾                   |
|    |            | 电话: 020-38286026                          | 传真: 020-38286588          |
|    |            | 客服电话: 95322                               | 网址: www.wlzq.cn           |
| 44 | 民生证券股份有限公司 | 注册地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层 |                           |
|    |            | 法定代表人: 冯鹤年                                | 联系人: 赵明                   |
|    |            | 电话: 010-85127622                          | 传真: 010-85127917          |
|    |            | 客服电话: 95376                               | 网址: www.msyzq.com         |
| 45 | 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       |
| 46 | 东方证券股份有限公司 | 注册地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层        |                           |
|    |            | 法定代表人: 潘鑫军                                | 联系人: 吴宇                   |
|    |            | 电话: 021-63325888                          | 传真: 021-63326173          |
|    |            | 客服电话: 95503                               | 网址: www.dfzq.com.cn       |
| 47 | 上海证券有限责任公司 | 注册地址: 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼                |                           |
|    |            | 法定代表人: 李俊杰                                | 联系人: 邵珍珍                  |
|    |            | 电话: 021-53686888                          | 传真: 021-53686100-7008     |
|    |            | 客服电话: 4008918918                          | 网址: www.shzq.com          |

|    |                |                                          |                      |
|----|----------------|------------------------------------------|----------------------|
| 48 | 国盛证券有限责任公司     | 注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼 |                      |
|    |                | 办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼 |                      |
|    |                | 法定代表人：徐丽峰                                | 联系人：占文驰              |
|    |                | 电话：0791-86283372                         | 传真：0791-86281305     |
|    |                | 网址：www.gsyzq.com                         |                      |
| 49 | 光大证券股份有限公司     | 注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号                    |                      |
|    |                | 法定代表人：周健男                                | 联系人：刘晨、李芳芳           |
|    |                | 电话：021-22169999                          | 传真：021-22169134      |
|    |                | 客服电话：95525                               |                      |
|    |                | 网址：www.ebscn.com                         |                      |
| 50 | 广发证券股份有限公司     | 注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室         |                      |
|    |                | 办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦                |                      |
|    |                | 法定代表人：孙树明                                |                      |
|    |                | 客服电话：95575                               | 网址：www.gf.com.cn     |
| 51 | 中信证券股份有限公司     | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座       |                      |
|    |                | 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦               |                      |
|    |                | 法定代表人：张佑君                                |                      |
|    |                | 客服电话：95548                               | 网址：www.cs.ecitic.com |
| 52 | 渤海证券股份有限公司     | 注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室        |                      |
|    |                | 办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号                      |                      |
|    |                | 法定代表人：王春峰                                | 联系人：蔡霆               |
|    |                | 电话：022-28451991                          | 传真：022-28451892      |
|    |                | 客服电话：400-651-5988                        | 网址：www.ewww.com.cn   |
| 53 | 中信证券（山东）有限责任公司 | 注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001           |                      |
|    |                | 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层           |                      |
|    |                | 法定代表人：姜晓林                                |                      |
|    |                | 客服电话：95548                               | 网址：sd.citics.com     |

|    |                |                                                 |                    |
|----|----------------|-------------------------------------------------|--------------------|
| 54 | 华泰证券股份有<br>限公司 | 注册地址：南京市江东中路 228 号                              |                    |
|    |                | 办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、上海市东方路 18 号保利广场 E 座 |                    |
|    |                | 法定代表人：周易                                        | 联系人：张宇明            |
|    |                | 电话：021-68498507                                 | 网址：www.htzq.com.cn |
|    |                | 客服电话：95597                                      |                    |
| 55 | 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：李新华                                       | 联系人：奚博宇            |
|    |                | 电话：027-65799999                                 | 传真：027-85481900    |
|    |                | 客服电话：95579                                      | 网址：www.95579.com   |
| 56 | 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                              |                    |
|    |                | 办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号                              |                    |
|    |                | 法定代表人：何春梅                                       |                    |
|    |                | 客服电话：95563                                      | 网址：www.ghzq.com.cn |
| 57 | 中原证券股份有<br>限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号                          |                    |
|    |                | 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号                          |                    |
|    |                | 法定代表人：菅明军                                       |                    |
|    |                | 客服电话：95377                                      | 网址：www.ccnew.com   |
| 58 | 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                                        |                    |
|    |                | 客服电话：95538                                      | 网址：www.zts.com.cn  |
| 59 | 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      |                    |
|    |                | 办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元      |                    |
|    |                | 法定代表人：王连志                                       |                    |
|    |                | 客服电话：400-800-1001                               |                    |
|    |                | 网址：www.essence.com.cn                           |                    |
| 60 | 恒泰证券股份有<br>限公司 | 注册地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座                   |                    |

|    |              |                                                                                                                 |                      |
|----|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|
|    |              | 办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑恒泰证券办公楼                                                                                  |                      |
|    |              | 法定代表人：庞介民                                                                                                       |                      |
|    |              | 客服电话：4001966188                                                                                                 | 网址：www.cnht.com.cn   |
| 61 | 东莞证券股份有限公司   | 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼                                                                                    |                      |
|    |              | 法定代表人：陈照星                                                                                                       | 联系人：李荣               |
|    |              | 电话：0769-22115712                                                                                                | 传真：0769-22115712     |
|    |              | 客服电话：95328                                                                                                      | 网址：www.dgzq.com.cn   |
| 62 | 中国中投证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元 |                      |
|    |              | 办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层                                                                      |                      |
|    |              | 法定代表人：高涛                                                                                                        |                      |
|    |              | 客服电话：95532                                                                                                      | 网址：www.china-invs.cn |
| 63 | 长城国瑞证券有限公司   | 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼                                                                                           |                      |
|    |              | 办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼                                                                                  |                      |
|    |              | 法定代表人：王勇                                                                                                        |                      |
|    |              | 客服电话：400-0099-886                                                                                               | 网址：www.gwgsc.com     |
| 64 | 华宝证券有限责任公司   | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层                                                                               |                      |
|    |              | 法定代表人：陈林                                                                                                        | 联系人：刘闻川              |
|    |              | 电话：021-68778081                                                                                                 | 传真 021-68778117      |
|    |              | 客服电话：400-820-9898                                                                                               | 网址：www.cnhbstock.com |
| 65 | 英大证券有限责任公司   | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层                                                                                      |                      |
|    |              | 法定代表人：赵文安                                                                                                       | 联系人：王睿               |
|    |              | 电话：0755-83007069                                                                                                | 传真：0755-83007167     |
|    |              | 客服电话：400-869-8698                                                                                               | 网址：www.ydsc.com.cn   |
| 66 | 中国国际金融股份有限公司 | 注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 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                 |                      |
| 67 | 华福证券有限责任公司   | 注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层       |                      |
|    |              | 法定代表人: 黄金琳                          | 联系人: 张腾              |
|    |              | 电话: 0591-87278701                   | 传真: 0591-87841150    |
|    |              | 客服电话: 95547                         | 网址: www.hfzq.com.cn  |
| 68 | 天相投资顾问有限公司   | 注册地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701    |                      |
|    |              | 办公地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505     |                      |
|    |              | 法定代表人: 林义相                          |                      |
|    |              | 客服电话: 010-66045678                  | 网址: www.txsec.com    |
| 69 | 信达证券股份有限公司   | 注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼         |                      |
|    |              | 法定代表人: 张志刚                          | 联系人: 唐静              |
|    |              | 电话: 95321                           | 传真: 无                |
|    |              | 客服电话: 95321                         | 网址: www.cindasc.com  |
| 70 | 中国民族证券有限责任公司 | 注册地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼        |                      |
|    |              | 办公地址: 北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼   |                      |
|    |              | 法定代表人: 姜志军                          |                      |
|    |              | 客服电话: 400-889-5618                  | 网址: www.e5618.com    |
| 71 | 华龙证券股份有限公司   | 注册地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼   |                      |
|    |              | 办公地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼         |                      |
|    |              | 法定代表人: 陈牧原                          |                      |
|    |              | 客服电话: 95368                         | 网址: www.hlzq.com     |
| 72 | 国元证券股份有限公司   | 注册地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座    |                      |
|    |              | 法定代表人: 凤良志                          | 联系人: 祝丽萍             |
|    |              | 电话: 0551-2257012                    | 传真: 0551-2272100     |
|    |              | 客服电话: 95578                         | 网址: www.gyzq.com.cn  |
| 73 | 西部证券股份有限公司   | 注册地址: 陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室 |                      |
|    |              | 法定代表人: 徐朝晖                          | 联系人: 梁承华             |
|    |              | 电话: 029-87211522                    | 传真: 029-87211478     |
|    |              | 客服电话: 95582                         | 网址: www.westsecu.com |

|    |                |                                                 |                       |
|----|----------------|-------------------------------------------------|-----------------------|
| 74 | 平安证券股份有<br>限公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层           |                       |
|    |                | 法定代表人：何之江                                       | 联系人：王阳                |
|    |                | 电话：021-38637436                                 | 传真：021-33830395       |
|    |                | 客服电话：95511-8                                    | 网址：stock.pingan.com   |
| 75 | 德邦证券股份有<br>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：武晓春                                       | 联系人：朱磊                |
|    |                | 电话：021-68761616                                 | 传真：021-68767880       |
|    |                | 客服电话：4008888128                                 | 网址：www.tebon.com.cn   |
| 76 | 中航证券有限公<br>司   | 注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层   |                       |
|    |                | 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号 中航资本大厦 35 层               |                       |
|    |                | 法定代表人：王 晓峰                                      |                       |
|    |                | 客服电话：95335                                      | 网址：www.avicsec.com    |
| 77 | 东海证券股份有<br>限公司 | 注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层                    |                       |
|    |                | 办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦                    |                       |
|    |                | 法定代表人：赵俊                                        |                       |
|    |                | 客服电话：95531；400-888-8588                         | 网址：www.longone.com.cn |
| 78 | 方正证券股份有<br>限公司 | 注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717 |                       |
|    |                | 办公地址：北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼                |                       |
|    |                | 法定代表人：施华                                        |                       |
|    |                | 客服电话：95571                                      | 网址：www.foundersc.com  |
| 79 | 山西证券股份有<br>限公司 | 注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼                     |                       |
|    |                | 法定代表人：侯巍                                        | 联系人：郭熠                |
|    |                | 电话：0351-8686659                                 | 传真：0351-8686619       |
|    |                | 客服电话：400-666-1618、95573                         |                       |
|    |                | 网址：www.i618.com.cn                              |                       |
| 80 | 湘财证券股份有<br>限公司 | 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼        |                       |

|    |                  |                                          |                      |
|----|------------------|------------------------------------------|----------------------|
|    |                  | 办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 |                      |
|    |                  | 法定代表人：孙永祥                                |                      |
|    |                  | 客服电话：95351                               | 网址：www.xcsc.com      |
| 81 | 华融证券股份有<br>限公司   | 注册地址：北京市西城区金融大街 8 号                      |                      |
|    |                  | 办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号                   |                      |
|    |                  | 法定代表人：祝献忠                                |                      |
|    |                  | 客服电话：95390                               | 网址：www.hrsec.com.cn  |
| 82 | 国融证券股份有<br>限公司   | 注册地址：呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼                |                      |
|    |                  | 法定代表人：孔佑杰                                | 联系人：陈韦杉              |
|    |                  | 电话：010-66413306                          | 传真：010-66412537      |
|    |                  | 客服电话：95385                               | 网址：www.grzq.com      |
| 83 | 江海证券有限公<br>司     | 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号                 |                      |
|    |                  | 法定代表人：赵洪波                                | 联系人：姜志伟              |
|    |                  | 电话：0451-87765732                         | 传真：0451-82337279     |
|    |                  | 客服电话：400-666-2288                        | 网址：www.jhzq.com.cn   |
| 84 | 广州证券有限责<br>任公司   | 注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼  |                      |
|    |                  | 法定代表人：刘东                                 | 联系人：林洁茹              |
|    |                  | 电话：020-88836655                          | 传真：020-88836654      |
|    |                  | 客服电话：95396                               | 网址：www.gzs.com.cn    |
| 85 | 浙商证券股份有<br>限公司   | 注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号                  |                      |
|    |                  | 法定代表人：吴承根                                | 联系人：高扬               |
|    |                  | 电话：0571-87902974                         | 传真：0571-87901913     |
|    |                  | 客服电话：95345                               | 网址：www.stocke.com.cn |
| 86 | 中银国际证券股<br>份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层          |                      |
|    |                  | 办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层          |                      |
|    |                  | 法定代表人：宁敏                                 |                      |
|    |                  | 客服电话：4006208888                          | 网址：www.bocichina.com |
| 87 | 新时代证券股份<br>有限公司  | 注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501    |                      |
|    |                  | 办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501    |                      |

|    |                |                                                          |                    |
|----|----------------|----------------------------------------------------------|--------------------|
|    |                | 法定代表人：叶顺德                                                |                    |
|    |                | 客服电话：95399                                               | 网址：www.xsdzq.cn    |
| 88 | 西南证券股份有<br>限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号                                       |                    |
|    |                | 法定代表人：廖庆轩                                                | 联系人：周青             |
|    |                | 电话：023-67616310                                          | 传真：023-63786212    |
|    |                | 网址：www.swsc.com.cn                                       |                    |
| 89 | 国都证券股份有<br>限公司 | 注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层                     |                    |
|    |                | 办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层                     |                    |
|    |                | 客服电话：4008188118                                          | 网址：www.guodu.com   |
| 90 | 开源证券有限责<br>任公司 | 注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层                           |                    |
|    |                | 法定代表人：李刚                                                 | 联系人：王姣             |
|    |                | 电话：029-68633210                                          | 客服电话：400-860-8866  |
|    |                | 网址：www.kysec.cn                                          |                    |
| 91 | 华安证券股份有<br>限公司 | 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号                              |                    |
|    |                | 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号                              |                    |
|    |                | 法定代表人：章宏韬                                                |                    |
|    |                | 客服电话：95318                                               | 网址：www.hazq.com    |
| 92 | 华鑫证券有限责<br>任公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元              |                    |
|    |                | 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号                                      |                    |
|    |                | 法定代表人：俞洋                                                 |                    |
|    |                | 客服电话：95323                                               | 网址：www.cfsc.com.cn |
| 93 | 国金证券股份有<br>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 |
| 94 | 中信期货有限公司       | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层 |                    |

|    |              |                                                               |                     |
|----|--------------|---------------------------------------------------------------|---------------------|
|    |              | 办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层      |                     |
|    |              | 法定代表人：张皓                                                      |                     |
|    |              | 客服电话：400-990-8826                                             | 网址：www.citicsf.com  |
| 95 | 申万宏源西部证券有限公司 | 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室              |                     |
|    |              | 法定代表人：李琦                                                      | 联系人：王怀春             |
|    |              | 电话：0991-2307105                                               | 传真：0991-2301927     |
|    |              | 客服电话：4008000562                                               | 网址：www.hysec.com    |
| 96 | 华西证券股份有限公司   | 注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                                |                     |
|    |              | 办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                                |                     |
|    |              | 法定代表人：杨炯洋                                                     |                     |
|    |              | 客户服务电话：95584                                                  | 网址：www.hx168.com.cn |
| 97 | 九州证券股份有限公司   | 注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号                                    |                     |
|    |              | 办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼                               |                     |
|    |              | 法定代表人：魏先锋                                                     |                     |
|    |              | 客服电话：95305                                                    | 网址：www.jzsec.com    |
| 98 | 财通证券股份有限公司   | 注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 |                     |
|    |              | 法定代表人：沈继宁                                                     | 联系人：陶志华             |
|    |              | 电话：95336                                                      | 传真：0571-87828088    |
|    |              | 客服电话：95536                                                    | 网址：www.ctsec.com    |

## (2) 第三方销售机构

| 序号 | 机构名称         | 机构信息                                      |                      |
|----|--------------|-------------------------------------------|----------------------|
| 1  | 诺亚正行基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室           |                      |
|    |              | 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋                  |                      |
|    |              | 法定代表人：汪静波                                 | 联系人：李娟               |
|    |              | 电话：021-38602377                           | 传真：021-38509777      |
|    |              | 客服电话：400-821-5399                         | 网址：www.noah-fund.com |
| 2  | 上海好买基金销售有限公司 | 注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号       |                      |
|    |              | 办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室 |                      |

|   |                |                                            |                      |
|---|----------------|--------------------------------------------|----------------------|
|   |                | 法定代表人：杨文斌                                  | 联系人：薛年               |
|   |                | 电话：021-20613999                            | 传真：021-68596916      |
|   |                | 客服电话：400-700-9665                          | 网址：www.ehowbuy.com   |
| 3 | 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 |                      |
|   |                | 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F        |                      |
|   |                | 法定代表人：祖国明                                  | 联系人：韩爱彬              |
|   |                | 客服电话：4000-766-123                          | 网址：www.fund123.cn    |
| 4 | 深圳众禄基金销售有限公司   | 注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801             |                      |
|   |                | 办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801             |                      |
|   |                | 法定代表人：薛峰                                   | 联系人：童彩平              |
|   |                | 电话：0755-33227950                           | 传真：0755-82080798     |
|   |                | 客服电话：4006-788-887                          |                      |
|   |                | 网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com           |                      |
| 5 | 上海长量基金销售有限公司   | 注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室            |                      |
|   |                | 办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层                |                      |
|   |                | 法定代表人：张跃伟                                  | 联系人：邱燕芳              |
|   |                | 电话：021-20691935                            | 传真：021-20691861      |
|   |                | 客服电话：400-820-2899                          | 网址：www.erichfund.com |
| 6 | 北京展恒基金销售有限公司   | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号                     |                      |
|   |                | 法定代表人：闫振杰                                  | 联系人：李晓芳              |
|   |                | 电话：010-59601366                            | 传真：010-62020355      |
|   |                | 客服电话：4008188000                            |                      |
|   |                | 网址：www.myfund.com                          |                      |
| 7 | 浙江同花顺基金销售有限公司  | 注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室                     |                      |
|   |                | 办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼               |                      |
|   |                | 法定代表人：凌顺平                                  | 联系人：董一锋              |
|   |                | 电话：0571-88911818                           | 传真：0571-86800423     |
|   |                | 客服电话：4008-773-772                          | 网址：www.5ifund.com    |
| 8 |                | 注册地址：无锡市滨湖区锦溪路 99 号                        |                      |

|    |                  |                                          |                       |
|----|------------------|------------------------------------------|-----------------------|
|    | 江苏金百临投资咨询股份有限公司  | 办公地址：无锡市滨湖区锦溪路棟泽路科教软件园三期 9 号楼            |                       |
|    |                  | 法定代表：费晓燕                                 | 联系人：卢娜                |
|    |                  | 电话：0510-82758877                         | 传真：0510-88555858      |
|    |                  | 客服电话：0510-9688988                        | 网址：www.jsjbl.com      |
| 9  | 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 |
| 10 | 众升财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室    |                       |
|    |                  | 办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08          |                       |
|    |                  | 法定代表：聂婉君                                 | 联系人：李艳                |
|    |                  | 电话：010-59497361                          | 传真：010-64788016       |
|    |                  | 客服电话：400-876-9988                        | 网址：www.zscffund.com   |
| 11 | 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                               |                       |
| 12 | 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            |                       |
|    |                  | 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     |
| 13 | 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                        |                      |
| 14 | 嘉实财富管理有限公司         | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元 |                      |
|    |                    | 办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层 (100022)        |                      |
|    |                    | 法定代表人：赵学军                                       | 联系人：李雯               |
|    |                    | 电话：010-60842306                                 | 客服电话：400-021-8850    |
|    |                    | 传真：021-20280110、010-85712195                    |                      |
|    |                    | 网址：www.harvestwm.cn                             |                      |
| 15 | 宜信普泽（北京）基金销售有限公司   | 注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809              |                      |
|    |                    | 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809              |                      |
|    |                    | 法定代表人：戎兵                                        | 联系人：魏晨               |
|    |                    | 电话：010-52858244                                 | 传真：010-5964 4496     |
|    |                    | 客服电话：400-6099-200                               | 网址：www.yixinfund.com |
| 16 | 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                            |                      |
| 17 | 北京增财基金销售有限公司       | 办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号                   |                      |
|    |                    | 客户服务热线：400-001-8811                             |                      |
|    |                    | 公司网站：www.zcvc.com.cn                            |                      |
| 18 | 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 |
|    |                    | 注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元                   |                      |

|    |                      |                                      |                  |
|----|----------------------|--------------------------------------|------------------|
| 19 | 汇付基金销售有限公司           | 办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天软件园C5幢           |                  |
|    |                      | 法定代表人：金佶                             | 联系人：甄宝林          |
|    |                      | 客服电话：021-34013999                    |                  |
|    |                      | 手机客户端：天天盈基金                          |                  |
| 20 | 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                   |                  |
| 21 | 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             |                  |
| 22 | 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                  |                  |
| 23 | 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                        |                   |
| 24 | 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                        |                   |
| 25 | 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                                |                   |
| 26 | 上海凯石财富基金销售有限公司   | 注册地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室                |                   |
|    |                  | 法定代表: 陈继武                                       | 联系人: 李晓明          |
|    |                  | 电话: 021-63333319                                | 传真: 021-63333390  |
|    |                  | 客服电话: 4006-433-389                              |                   |
|    |                  | 网址: www.lingxianfund.com                        |                   |
| 27 | 深圳富济基金销售有限公司     | 注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元     |                   |
|    |                  | 办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元     |                   |
|    |                  | 法定代表: 刘鹏宇                                       | 联系人: 刘勇           |
|    |                  | 电话: 0755-83999907-8814                          | 传真: 0755-83999926 |
|    |                  | 客服电话: 0755-83999907                             |                   |
|    |                  | 网址: www.fujifund.cn                             |                   |
| 28 | 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                                        |                        |
| 29 | 北京新浪仓石基金销售有限公司       | 注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 |                        |
|    |                      | 办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 |                        |
|    |                      | 法定代表人：李昭琛                                               | 联系人：付文红                |
|    |                      | 电话：010-62676405                                         | 传真：010-82607151        |
|    |                      | 客服电话：010-62675369                                       |                        |
|    |                      | 网址：www.xincai.com                                       |                        |
| 30 | 上海万得基金销售有限公司         | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座                     |                        |
|    |                      | 法定代表人：黄伟                                                | 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                                   |                        |
| 31 | 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                                      |                        |
| 32 | 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                                      |                        |
| 33 | 万家财富基金销售有限公司（天津）有限公司 | 注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室           |                        |
|    |                      | 办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋大厦 A 座 5 层                       |                        |
|    |                      | 法定代表人：李修辞                                               | 联系人：王芳芳                |

|    |                |                                              |                 |
|----|----------------|----------------------------------------------|-----------------|
|    |                | 电话：010-59013842                              |                 |
|    |                | 网址：www.wanjiawealth.com                      |                 |
| 34 | 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                            |                 |
| 35 | 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                           |                 |
| 36 | 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                               |                 |
| 37 | 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                      |                 |
| 38 | 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                           |                  |
| 39 | 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：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                      |                  |
| 40 | 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：沈丹义                                   | 联系人：庄洁茹          |
|    |                  | 电话：021-60818056                            | 客服电话：4001019301  |
|    |                  | 网址：www.tonghuafund.com                     |                  |
| 41 | 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：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                      |                  |
| 42 | 和耕传承基金销售有限公司     | 注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 |                  |
|    |                  | 办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 |                  |
|    |                  | 法定代表：王旋                                    | 联系人：胡静华          |
|    |                  | 电话：0371-85518395                           | 传真：0371-85518397 |
|    |                  | 客服电话：4000-555-671                          |                  |
|    |                  | 网址：www.hgccpb.com                          |                  |
| 43 | 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     |
| 44 | 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        |
| 45 | 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

| 序号 | 机构名称       | 机构信息                              |                 |
|----|------------|-----------------------------------|-----------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司 | 注册地址：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                         | 传真：021-31081800 |
|    |            | 联系人：辛怡                            |                 |
|    |            | 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

## 第六节 基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字[2007]118 号文核准募集发售。

### 二、基金类型

混合型证券投资基金

### 三、基金运作方式

契约型、开放式

### 四、基金的存续期间

不定期

### 五、基金份额的认购

本基金于 2007 年 4 月 26 日至 2007 年 5 月 15 日公开募集。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的净销售总额为 8,881,951,489.99 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 2,845,524.32 元人民币。上述资金已于 2007 年 5 月 17 日全

额划入本基金在基金托管人中国农业银行开立的国泰金牛创新成长股票型证券投资基金托管专户。

## 第七节 基金合同的生效

本基金于2007年4月26日至2007年5月15日公开募集。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的净销售总额为8,881,951,489.99元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计2,845,524.32元人民币。根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、本基金招募说明书、基金合同的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2007年5月18日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

## 第八节 基金份额的申购、赎回与转换

### 一、申购、赎回与转换的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所、通过国泰基金电子交易平台（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购、赎回与转换。基金管理人可根据情况变更增减代销机构，并在管理人网站公示。

### 二、申购、赎回与转换的开放日及时间

本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理，基金管理人开始办理各基金间的转换的具体业务办理时间在基金转换开始公告中列明。基金管理人应在申购、赎回与转换开放日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。

申购、赎回与转换的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回与转换时除外）。

本基金在基金合同规定的开放日办理申购、赎回和转换。具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下次办理基金份额申购、赎回、转换时间所在开放日的价格。

国泰基金电子交易平台提供7\*24小时服务，接受个人投资者申购、赎回与转换的申请，但交易日下午15:00以后接受的交易申请顺延至下一交易日处理。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回、转换时间进行调整，并在实施日 2 日前在至少一种证监会指定的媒介上公告。

### 三、申购、赎回与转换的原则

（一）“未知价”原则，即申购、赎回与转换价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算；

（二）“金额申购、份额赎回和份额转出”原则，即申购以金额申请，赎回和转换以份额申请，投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态；

（三）基金份额持有人在赎回或转出基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在先的基金份额先赎回或转出，申购确认日期在后的基金份额后赎回或转出，以确定所适用的赎回费率；

（四）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（五）基金转换只能在同一销售机构办理，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售。

（六）目前，基金管理人旗下的开放式基金均采用前端收费模式，故投资者转入的基金份额将被自动记入前端收费模式下，且持有人对转入基金的持有期限自转入之日起计算。

（七）基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施 2 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。

### 四、申购、赎回与转换的数额限定

#### （一）申购金额的限制

每个账户单笔申购的最低金额为 1.00 元（含申购费），即投资人首次申购和追加申购的单笔最低金额均为 1.00 元。投资人通过本基金管理人直销渠道每个账户单笔申购的最低金额为 10.00 元（含申购费），即投资人通过本基金管理人直销渠道首次申购和追加申购的单笔最低金额均为 10.00 元。若其他基金销售机构有不同规定，投资者在相关销售机构办理涉及上述规则的业务时，需同时遵循该销售机构的相关规定。

#### （二）赎回份额的限制

基金份额持有人在销售机构办理赎回时，每次赎回申请不得低于 1 份基金份额，若余额部分低于 1 份时，余额部分基金份额在赎回时必须一同赎回。基金份额持有人在本基金管理人直销渠道办理赎回时，每次赎回申请不得低于 100 份基金份额，若余额部分低于 100 份时，余额部分基金份额在赎回时必须一同赎回。

#### （三）转换份额的限制

基金转换的最低申请份额为 1 份基金单位。如投资者在单个销售网点持有单只基金的份额不足 1 份时，需一次性全额转出。投资人在本基金管理人直销渠道进行基金转换的最低申请份额为 100 份基金单位。如投资者在本基金管理人直销渠道持有单只基金的份额不足 100 份时，需一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

（四）接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

（五）基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整，必须在调整生效前 2 个工作日在中国证监会指定媒介上刊登公告。

## 五、申购、赎回与转换的程序

### （一）申购、赎回与转换的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回与转换的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回、转换申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

### （二）申购、赎回与转换申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购、赎回与转换的成交情况。

### （三）申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

## 六、申购、赎回的数额与价格

### （一）申购份额、余额及赎回金额的处理方式

1、申购份额的处理方式：本基金采用外扣法计算申购费用及申购份额，申购的有效份额以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回净额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### （二）申购份额的计算

申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} \div (1 + \text{申购费率})$$

（注：对于 1000 万（含）以上的申购适用绝对数额的申购费金额， $\text{申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$ ）

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} \div \text{申购当日基金份额净值}$$

申购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位。

#### （三）赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{基金赎回费率}$$

$$\text{赎回净额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金额以四舍五入的方法保留小数点后两位。

#### （四）基金份额净值的计算公式

基金份额净值的计算公式为：

$$\text{基金份额净值} = \text{基金资产净值总额} \div \text{发行在外的基金份额总数}$$

基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 七、基金的申购费、赎回费与转换费

#### （一）申购费用

本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于净申购金额乘以所适用的申购费率。若投资者在一天之内有多笔申购，则按每次净申购金额对应费率分别收取申购费。申购费用由基金申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的申购费率如下：

| 申购金额（含申购费） | 申购费率 |
|------------|------|
|------------|------|

|                   |          |
|-------------------|----------|
| 100 万元以下          | 1.5%     |
| 100 万元（含）—500 万元  | 1.2%     |
| 500 万元（含）—1000 万元 | 0.8%     |
| 1000 万元（含）以上      | 1000 元/笔 |

举例说明如下：

某投资者以 60 万元申购本基金，申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.10 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购净额} = 600,000 \div (1 + 1.5\%) = 591,133 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 600,000 - 591,133 = 8867 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 591,133 \div 1.10 = 537,393.64$$

即投资者以 60 万元申购本基金，如果申购当日基金份额净值为 1.10 元，则其可得到的申购份额为 537,393.64 份。

## （二）赎回费用

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在投资者赎回本基金份额时收取，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付销售、注册登记等机构的相关手续费。对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.50% 的赎回费并全额计入基金财产。

本基金的赎回费率如下：

| 持有时间       | 赎回费率  |
|------------|-------|
| 7 日以下      | 1.5%  |
| 7 日（含）—1 年 | 0.5%  |
| 1 年（含）—2 年 | 0.25% |
| 2 年（含）以上   | 0     |

（注：1 年按 365 日计算）

举例说明如下：

某基金份额持有人赎回持有超过 7 日但不超过 1 年的 1000 份基金份额，赎回对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.10 元，则其可得到的赎回净额为：

$$\text{赎回金额} = 1000 \times 1.10 = 1100 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 1100 \times 0.5\% = 5.50 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 1100 - 5.50 = 1094.50 \text{ 元}$$

即基金份额持有人赎回持有超过 7 日但不超过 1 年的 1000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.10 元，则其可得到的赎回净额为 1094.50 元。

## （三）转换费用

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

（1）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

（2）转入基金申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

2、计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

（四）基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人最迟应在调整实施前 3 个工作日中国证监会指定的媒介上刊登公告。

（五）针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

（六）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 八、暂停申购的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （一）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- （二）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （三）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （四）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- （五）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （六）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- （七）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形；

（八）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或某几笔申购。

发生上述（一）、（二）、（三）、（四）、（六）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将全额退还投资者。发生上述第（五）项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。

## 九、暂停赎回和转换或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回和转换申请：

- （一）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- （二）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （三）基金发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回和转出申请的情况；
- （四）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；
- （五）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （六）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例部分支付给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时在出现上述第（三）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回和转换，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的媒介上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回和转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并按照规定在至少一家指定媒介上公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### （一）巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。

## （二）巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1、全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确做出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 50%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 50%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过 50%的部分，可以根据前段“1、全额赎回”或“2、部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

3、当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

4、暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒介公告。

5、发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

## 十一、重新开放申购、赎回与转换的公告

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

（一）如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告，并公告最新的基金份额净值。

（二）如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，暂停结束基金重新开放申购、赎回与转换时，基金管理人将提前 1 个工作日，在至少一种中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告，并在重新开放申购、赎回与转换日公告最新的基金份额净值。

（三）如果发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少重复刊登暂停公告 1 次；当连续暂停时间超过 2 个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购、赎回与转换时，基金管理人应提前 3 个工作日，在至少一种中国证监会指定媒介上连续刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告，并在重新开放申购、赎回与转换日公告最新的基金份额净值。

## 十二、定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下，本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务。通过定期定额投资计划，基金投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购本基金基金份额。该定期申购计划不受最低申购份额限制，具体实施方法以基金管理人公布的业务规则为准。

## 十三、转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。

进行份额转托管时，投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在转出方办理基金份额转出手续，在转入方办理基金份额转入手续。对于有效的转托管申请，转出的基金份额将在投资者办理转托管转入手续后转入其指定的交易账户。具体办理方法参照业务规则的有关规定以及代销机构的相关开放式基金业务规则。

## 十四、基金的非交易过户

（一）非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行等三种情形。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是符合本基金合同规定的投资者。其中：

- 1、“继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。
- 2、“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。
- 3、“强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

（二）办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料，其中，因继承、捐赠原因导致的非交易过户向基金销售网点申请办理，因强制执行原因导致的非交易过户直接向基金注册登记机构统一申请办理。

（三）符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，2 个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## 十五、基金的冻结

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

# 第九节 基金的投资

## 一、投资目标

本基金为成长型混合基金，主要投资于通过各类创新预期能带来公司未来高速增长的创新型上市公司股票，在有效的风险控制前提下，追求基金资产的长期增值。这里的创新包括技术创新、制度创新、市场创新和管理创新等范畴。

## 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、现金、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债、可转换债券、央行票据、资产支持证券等。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券资产投资比例占基金资产的 0-35%；权证投资比例占基金资产净值的 0-3%；资产支持类证券投资比例占基金资产净值的 0-10%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

## 三、投资理念

价格终将反映价值。

## 四、投资策略

（一）大类资产配置

本基金的大类资产配置主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足各类基金风险-回报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同，预测短期性回报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

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

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

## （二）股票资产投资策略

本基金的股票资产投资将在国家发展规划所指引的产业领域内，采取自下而上的选股方法。利用“成长因子”筛选出成长型上市公司股票池；在此基础上利用公司自主开发的“创新型上市公司评价体系”，对符合创新特征的上市公司进行深入的分析 and 比较，筛选出通过创新能够在未来带来高速成长的上市公司，形成创新成长型上市公司股票池；最后通过相对价值评估，形成优化的股票投资组合。

### 1、成长型股票筛选

本基金采用“成长因子评估体系”对上市公司进行成长性评价，分析和预测企业未来的成长性。成长因子主要包括以下 4 个指标：

- （1）销售收入增长率
- （2）净利润增长率
- （3）总资产增长率
- （4）净资产收益率增长率

为反映企业的“可持续成长性”，主要以最近三年平均增长率为评价依据。按上述指标对上市公司分别进行排名，对排名值进行简单平均后，形成一个复合型的成长因子，并依其结果对上市公司进行再排名，最终得到上市公司的成长性排名。本基金选择排名在前的 600 个上市公司作为成长型股票池。

## 2、创新型股票筛选

在成长型股票池的范围内，本基金根据“创新型上市公司评价体系”对上市公司进行创新型的甄别。评价创新型上市公司的标准主要包括技术创新、制度创新、市场创新和管理创新等范畴。

现代经济发展理论认为：技术创新、制度创新、市场创新和管理创新共同构成企业创新的四大支柱，它们之间相互联系、相互影响，形成十分复杂的企业创新系统。其中，技术创新是企业创新的核心，是企业实现科学技术成果向现实生产力转化的根本途径，也是形成企业核心竞争力的关键和源泉。制度创新是企业创新的保障，它通过改变产权结构支撑起企业的整体框架，为创新提供有效的激励机制。市场创新是企业创新的出发点和最终归宿，它通过开拓新市场或创造市场新组合将创新成果转化为商业价值和企业实力，向企业提供创新压力和动力，并决定和影响企业创新活动的规模、内容及发展方向。管理创新是企业创新的平台，它通过创造新的资源整合范式，为创新奠定坚实的基础，提高并增强企业创新成功的可能性，降低创新风险。

在坚持科学性、可比性、可操作性、系统性、绝对指标分析和相对指标分析相结合等 5 项原则的基础上，基金管理人根据系统论的思想，创建了“创新型上市公司评价体系”。

在评价体系的指标选择中，企业技术创新能力为总指标，亦为一级指标。一级指标下设四个二级指标，分别为企业技术创新指标、制度创新指标、市场创新指标和管理创新指标。二级指标下设六个三级指标。三级指标下设十四个四级指标。

在评价体系的评价方法上，主要运用 AHP 法确定权重，利用模糊数学方法进行综合评价。

本基金利用创新型上市公司评价体系，选择排名在前的 300 个以内上市公司作为创新成长型股票池。

## 3、相对价值评估

在创新成长型股票池范围内，本基金利用相对价值评估，形成可投资的股票组合。相对价值评估主要运用国际化视野，将国内上市公司的有关估值与国际公司相应指标进行比较。具体采用的方法包括股息贴现模型、自由现金流贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA 等方法。

### （三）债券资产投资策略

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

1、以对长期利率预期为基础确定期限结构。在预期利率下降时，增加组合久期，提高债券价格上升产生的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，降低债券价格下降产生的损

失。如果预期市场收益率曲线作强烈的整体向上平移，降低债券组合的整体持仓比例，同时降低组合久期，来使组合损失降到最低。

2、以收益率曲线分析为基础确定收益率曲线配置。根据收益率曲线可能发生变动的种类，如平坦化、陡峭化、正向蝴蝶型、反向蝴蝶型等，通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法，在短、中、长期债券间确定比例，以期从短、中、长期债券的相对价格差中取得收益。

3、以相对利差分析为基础确定类属配置。通过对各类属债券历史利差的数量化分析，寻找市场投资机会。比如在预期国债与金融债利差缩小时，卖出国债，买入金融债。

4、以流动性分析和收益率分析为基础确定市场配置。交易所国债市场发行总量较小，大额交易流动性较差、小额交易流动性较好，而银行间国债市场发行总量较大，大额交易成本低，某些时段流动性较好。故根据不同时段对流动性的不同需求，在两个市场间配置债券资产。

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

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

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

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

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

5、由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；

6、市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；

7、单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

## 五、选券标准

### （一）债券资产选择标准

- 1、个券信用等级在 AA 级或其同等级别以上；
- 2、相同剩余期限中到期收益率较高的；
- 3、有较好流动性（日成交量大、买卖价差小）；
- 4、通过二叉树模型估算所含期权被市场低估的可转债；
- 5、可转债具有不可撤销的连带责任担保或者资产抵押。

### （二）股票资产选择标准

- 1、利用“成长因子”筛选出具有成长潜力的上市公司；
- 2、根据“创新型上市公司评价体系”，对创新型企业进行甄别；

3、通过相对价值分析，对价格低估的企业进行重点投资。

这部分股票投资至少占本基金股票资产的 80%。

（三）权证选择标准：

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

1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率 and 无风险收益率等要素，估计权证合理价值；

2、计算权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，为权证的具体操作提供依据。

## 六、投资决策过程

（一）投资依据

1、有关法律、法规、基金合同等的相关规定；

2、经济运行态势和证券市场走势。

（二）投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关基准指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

（三）投资程序

1、金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，结合公司内外研究报告，对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算与归因分析，依此提出研究分析报告。

2、投资决策委员会依据金融工程部、研究开发部等部门提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

3、基金经理以基金合同、投资决策委员会决议、金融工程部和研究开发部研究报告等为依据建立基金的投资组合。

4、交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。

5、金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

6、基金经理结合个券的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和监察稽核部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果，对投资组合进行监控和调整。

7、本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

#### （四）关于交易过程的说明

本基金管理人所管理的各基金将独立、平等地使用公司统一的中央交易平台。交易管理部公平、及时地处理所有投资产品的交易指令，并保护不同产品之间的交易秘密。基金经理小组必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定，经由交易管理部统一下达交易指令。

基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库。交易对手库由银行间市场成员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级较高的交易对手组成，并报投资决策委员会批准后实施。

交易对手库由公司固定收益部发起更新，交易对手库的更新包括定期更新和临时更新，定期更新为每半年一次，固定收益部应于每半年初整理更新交易对手库清单，并报投资决策委员会审批后交固定收益投资经理和交易管理部实施。当银行间成员资质发生重大变化时，固定收益部应及时发起临时调整。上述调整应及时通知基金托管人。

基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督。

## 七、业绩比较基准

业绩基准=80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

沪深 300 指数成份股选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。沪深 300 指数中的指数股的发布和调整均由交易所完成，具有较强的公正性与权威性。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数，反映我国债券市场整体变动状况，具有较强的市场代表性。

随着法律法规和市场环境发生变化，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。

## 八、风险收益特征

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

## 九、投资禁止行为与限制

### （一）禁止用本基金财产从事以下行为

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

### （二）基金投资组合比例限制

- 1、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- 3、本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- 4、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 5、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 5%；
- 6、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 7、基金管理人管理的全部基金持有的同一权证不得超过该权证的 10%；
- 8、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- 9、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过本基金资产净值的 10%；
- 10、基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- 11、本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

12、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

13、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

14、法律法规和基金合同规定的其他限制。

（三）若将来法律法规或中国证监会的相关规定对上述投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更或取消，则本基金可相应地对该项规定进行修改或取消，无须召开基金份额持有人大会。但应根据有关规定报中国证监会审查批准或备案。如果法律法规对本基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

## 十、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述投资组合比例限制的第 12、13 项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

## 十一、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- （一）不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- （二）有利于基金资产的安全与增值；
- （三）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。
- （四）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

## 十二、基金的融资

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。

## 十三、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2019 年 3 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,162,307,438.14 | 83.40        |
|    | 其中：股票             | 1,162,307,438.14 | 83.40        |
| 2  | 固定收益投资            | 61,245,497.20    | 4.39         |
|    | 其中：债券             | 61,245,497.20    | 4.39         |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 40,000,260.00    | 2.87         |
|    | 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      | 127,807,762.48   | 9.17         |
| 7  | 其他各项资产            | 2,295,760.80     | 0.16         |
| 8  | 合计                | 1,393,656,718.62 | 100.00       |

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | 51,660,000.00  | 3.73         |
| C  | 制造业              | 927,046,626.00 | 66.89        |
| 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  | 19,959,037.84  | 1.44         |
| J  | 金融业              | 121,161,774.30 | 8.74         |
| 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 | 42,480,000.00    | 3.06  |
| 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            | 1,162,307,438.14 | 83.86 |

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000739 | 普洛药业 | 8,000,000 | 88,960,000.00 | 6.42         |
| 2  | 603520 | 司太立  | 2,745,520 | 81,404,668.00 | 5.87         |
| 3  | 002332 | 仙琚制药 | 9,000,000 | 76,680,000.00 | 5.53         |
| 4  | 000910 | 大亚圣象 | 5,096,300 | 76,648,352.00 | 5.53         |
| 5  | 300702 | 天宇股份 | 2,198,215 | 73,750,113.25 | 5.32         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 900,000   | 69,390,000.00 | 5.01         |
| 7  | 600529 | 山东药玻 | 2,479,599 | 63,229,774.50 | 4.56         |
| 8  | 300476 | 胜宏科技 | 4,200,000 | 58,002,000.00 | 4.18         |
| 9  | 600028 | 中国石化 | 9,000,000 | 51,660,000.00 | 3.73         |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 2,083,835 | 51,637,431.30 | 3.73         |

## （四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 55,022,500.00 | 3.97         |
|    | 其中：政策性金融债 | 55,022,500.00 | 3.97         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 6  | 中期票据      | -             | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 6,222,997.20  | 0.45 |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 61,245,497.20 | 4.42 |

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 180305 | 18 进出 05 | 300,000 | 30,018,000.00 | 2.17         |
| 2  | 190201 | 19 国开 01 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.44         |
| 3  | 113020 | 桐昆转债     | 50,680  | 6,222,997.20  | 0.45         |
| 4  | 160215 | 16 国开 15 | 50,000  | 5,004,500.00  | 0.36         |

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### （十一）投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“司太立”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。

中国证券监督管理委员会浙江监管局于 2018 年 6 月 9 号在日常监管中发现司太立存在以下问题：2017 年 12 月 10 日至 2018 年 3 月 15 日，存在将 8500 万元闲置募集资金及期间利息存放于公司一般户的情形，迟至 2018 年 3 月 21 日才公告。公司的上述行为违反了《上市公司证券发行管理办法》第十条和《上市公司信息披露管理办法》第二条的规定。施肖华，吴超群时任司太立财务总监和董事会秘书，对上述违规事项应承担主要责任。根据以上情况，按照《上市公司证券发行管理办法》第六十四条和《上市公司信息披露管理办法》第五十八条，第五十九条的规定，决定对司太立时任董事会秘书吴超群分别采取出具警示函的监督管理措施，记入证券期货市场诚信档案。

本基金管理人此前投资司太立股票时，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，本基金管理人就司太立违规受处罚事件进行了及时分析和研究，认为司太立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   | 389,901.04   |
| 2  | 应收证券清算款 | 131,694.08   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 1,204,536.78 |
| 5  | 应收申购款   | 569,628.90   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 2,295,760.80 |

#### 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。

## 第十节 基金的业绩

本基金业绩截止日为 2018 年 12 月 31 日，并经基金托管人复核。

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

| 阶段                                   | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|--------------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 2007 年 5 月 18 日至<br>2007 年 12 月 31 日 | 36.36%  | 1.59%     | 32.65%     | 1.81%         | 3.71%   | -0.22% |
| 2008 年度                              | -54.17% | 2.64%     | -56.18%    | 2.43%         | 2.01%   | 0.21%  |
| 2009 年度                              | 93.28%  | 1.62%     | 73.60%     | 1.64%         | 19.68%  | -0.02% |
| 2010 年度                              | 0.34%   | 1.40%     | -9.12%     | 1.26%         | 9.46%   | 0.14%  |
| 2011 年度                              | -14.70% | 1.14%     | -19.67%    | 1.04%         | 4.97%   | 0.10%  |
| 2012 年度                              | 9.93%   | 1.16%     | 7.04%      | 1.02%         | 2.89%   | 0.14%  |
| 2013 年度                              | 31.88%  | 1.35%     | -5.30%     | 1.11%         | 37.18%  | 0.24%  |
| 2014 年度                              | 14.24%  | 1.25%     | 41.16%     | 0.97%         | -26.92% | 0.28%  |
| 2015 年度                              | 44.80%  | 2.41%     | 6.98%      | 1.99%         | 37.82%  | 0.42%  |
| 2016 年度                              | -3.53%  | 1.39%     | -8.16%     | 1.12%         | 4.63%   | 0.27%  |
| 2017 年度                              | 12.12%  | 0.68%     | 17.32%     | 0.51%         | -5.20%  | 0.17%  |
| 2018 年度                              | -25.29% | 1.33%     | -19.66%    | 1.07%         | -5.63%  | 0.26%  |
| 2007 年 5 月 18 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 100.34% | 1.59%     | -2.38%     | 1.42%         | 102.72% | 0.17%  |

## 第十一节 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

（一）银行存款及其应计利息；

- （二）清算备付金及其应收利息；
- （三）根据有关规定缴纳的保证金；
- （四）应收证券交易清算款；
- （五）应收申购款；
- （六）股票投资及其估值调整；
- （七）债券投资及其估值调整和应计利息；
- （八）权证投资及其估值调整；
- （九）其它投资及其估值调整；
- （十）其他资产等。

## 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

## 三、基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“国泰金牛创新成长混合型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“国泰金牛创新成长混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

## 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售代理人的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金销售代理人以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

# 第十二节 基金资产的估值

## 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

## 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日。

## 三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产。

## 四、估值的基本原则

（一）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并应通过定期校验，确保估值技术的有效性。

（三）有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人应根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

## 五、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

### （一）股票估值方法：

1、上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

### 2、未上市股票的估值：

（1）首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

(4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1—2 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1—2 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

4、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## （二）债券估值方法：

1、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

2、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

3、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4、发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

5、在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值；

7、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1—6 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1—6 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

8、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### （三）权证估值方法：

1、基金持有的权证（包括配股权证），从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

2、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（四）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（五）如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

（六）根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 六、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 七、基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当基金估值出现影响基金份额净值的错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应其承担的责任，有权向差错方追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### （一）差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的行为造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### （二）差错处理原则

1、差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

2、差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

3、因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

4、差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

5、差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人差错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人差错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

6、如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现差错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

7、按法律法规规定的其它原则处理差错。

### （三）差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- 1、查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- 2、根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- 3、根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- 4、根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- 5、基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

## 八、暂停估值的情形

- （一）与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （二）因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；
- （三）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；
- （四）中国证监会认定的其他情形。

## 九、特殊情形的处理

（一）基金管理人按本条第五款估值方法规定的第（一）项中的第 3 小项条款、第（二）项中的第 5 小项条款、第（三）项中的第 3 小项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

（二）由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

# 第十三节 基金的收益与分配

## 一、基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

## 二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## 三、基金收益分配原则

（一）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 50%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（二）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或按除权日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（三）基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

（四）基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

（五）基金收益分配后基金份额净值不能低于发售面值；

（六）每一基金份额享有同等分配权；

（七）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 六、基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资者的现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照国泰基金管理有限公司开放式基金有关业务规定执行。

# 第十四节 基金的费用与税收

## 一、基金的费用种类

（一）基金管理人的管理费；

- （二）基金托管人的托管费；
  - （三）基金合同生效后的基金信息披露费用；
  - （四）基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
  - （五）基金份额持有人大会费用；
  - （六）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、席位费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
  - （七）银行汇划费用；
  - （八）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
- 本基金合同终止基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### （一）基金管理人的管理费

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

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### （二）基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 3—8 项费用由基金托管人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，从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

#### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十五节 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- （一）基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- （二）基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- （三）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- （四）会计制度执行国家有关会计制度；
- （五）本基金独立建账、独立核算；
- （六）基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- （七）基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- （一）本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- （二）会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- （三）基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六节 基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 一、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

1、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息

发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

2、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中应说明基金募集情况。

## （四）基金净值信息

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其它事项。

#### （八）澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （十）中国证监会规定的其它信息。

## 二、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法律法规规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新

的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

### 三、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

### 四、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七节 风险揭示

### 一、市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益的不确定性。市场风险主要包括：

（一）政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（二）经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（三）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

（四）上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投

资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

（五）信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

（六）购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（七）债券收益率曲线风险。债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

（八）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率

（九）波动性风险。波动性风险主要存在于可转债的投资中，具体表现为可转债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债还有信用风险与转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

## 二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

## 三、流动性风险

### （一）本基金的申购、赎回安排

本基金为普通开放式基金，投资人可在本基金的开放日办理基金份额的申购和赎回业务。为切实保护存量基金份额持有人的合法权益，遵循基金份额持有人利益优先原则，本基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

1、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

2、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请、赎回申请或延缓支付赎回款项。

提示投资人注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险，合理安排投资计划。

## （二）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险

1、本基金股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券资产投资比例占基金资产的 0-35%。因此，股票市场/债券市场的流动性风险是本基金主要面临的流动性风险。本基金所投资的股票市场/债券市场具有发展成熟、容量较大、交易活跃、流动性充裕的特征，能够满足本基金开放式运作的流动性要求。同时，本基金采用分散投资，针对个股/个券设置投资比例上限，保障了资产组合的流动性。在极端市场行情下，存在基金管理人可能无法以合理价格及时变现或调整基金投资组合的风险。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制流动性风险。

2、资产支持证券只能通过特定的渠道进行转让交易，存在市场交易不活跃导致的流动性风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

## （三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1、全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确做出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 50%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 50%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过 50%的部分，可以根据前段“1、全额赎回”或“2、部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

3、当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

4、暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒介公告。

5、发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

#### （四）备用的流动性风险管理工具的实施情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。备用的流动性风险管理工具的实施情形包括：

- 1、发生基金合同规定的暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；
- 2、基金发生巨额赎回；
- 3、基金发生巨额赎回，且单个基金份额持有人超过基金总份额 50%以上的赎回申请的情形；
- 4、基金份额持续持有期限小于 7 日；
- 5、发生基金合同规定的暂停估值的情形；
- 6、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，切实保护持有人的合法权益。

采取备用流动性风险管理工具，可能对投资人造成无法赎回、赎回延期办理、赎回款项延期支付、赎回时承担冲击成本产生资金损失等影响。

## 四、其他风险

除以上主要风险以外，基金还可能遇到以下风险：

（一）因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发性事件或不可抗原因出现故障，由此给基金投资带来风险；

（二）因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈等行为产生的违规风险；

（三）人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响；

（四）因为业务竞争压力可能产生的风险；

（五）因其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等会导致基金资产损失，影响基金收益水平。

## 五、本基金的特定风险

（一）本基金作为混合型基金，在投资策略上以成长型投资为出发点，通过数量化、定性化的评估流程构造投资组合。在具体投资管理中，可能会由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。鉴于我国股市目前仍处于发展阶段，具有波动性较大的特征，因而本基金管理人在必要时将通过适当的大类资产配置，降低系统性风险。

### （二）科创板股票投资风险

本基金可投资国内上市的科创板股票，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，包括但不限于如下特殊风险：

#### 1、退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板上市公司股票退市风险更大。

#### 2、市场风险

科创板股票集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数公司为初创型公司，公司未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，科创板股票市场风险加大。

科创板股票竞价交易设置较宽的价格涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后前5个交易日不设价格涨跌幅限制，其后涨跌幅比例为20%，可能产生股票价格大幅波动的风险。

#### 3、流动性风险

科创板整体投资门槛较高，科创板的投资者可能以机构投资者为主，科创板股票流动性可能弱于其他市场板块，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### 4、集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量股票，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

## 5、系统性风险

科创板上市公司均为市场认可度较高的科技创新公司，在公司经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

## 6、政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板上市公司带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板企业也会带来政策影响。

# 第十八节 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

## 一、基金合同的变更

（一）除非法律法规和基金合同另有规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准或备案。

（二）依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（三）除依本基金合同和/或依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更须基金份额持有人大会决议通过和/或须报中国证监会核准以外的情形，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同进行变更后公布，并报中国证监会备案。

## 二、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- （一）基金份额持有人大会决定终止的；
- （二）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （三）基金合同约定的其他情形；
- （四）中国证监会允许的其他情况。

## 三、基金财产的清算

（一）基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（二）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（三）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（四）基金财产清算程序：

- 1、基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2、对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3、对基金财产进行估值和变现；
- 4、对基金财产进行分配；
- 5、制作清算报告；
- 6、聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7、将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8、对基金财产进行分配。

#### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的清偿、分配

基金财产按照下列顺序清偿和分配：

- （一）支付清算费用；
- （二）缴纳所欠税款；
- （三）清偿基金债务；
- （四）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（一）、（二）、（三）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 六、基金财产清算的公告

基金财产清算报告在基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十九节 基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利义务

#### （一）基金管理人的权利义务

##### 1、基金管理人享有如下权利

- （1）依法募集基金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费以及基金管理费等其他法律法规规定的费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- （9）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （10）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （11）在符合有关法律规法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除托管费率和调高管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）法律法规和基金合同规定的其他权利。

##### 2、基金管理人履行如下义务

- （1）办理基金备案手续；
- （2）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- （3）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- （4）依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按基金合同规定向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿，但除法律法规另有规定外，不连带承担基金托管人的责任；

(22) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(23) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还基金认购人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利义务

### 1、基金托管人享有如下权利：

(1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金资产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，应报告中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金的债券及资金的清算；

(7) 提议召开基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 2、托管人履行如下义务

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的资产托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 监督基金管理人按法律法规和合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人的利益向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，不连带承担基金管理人的责任；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### （三）基金份额持有人的权利义务

#### 1、基金份额持有人享有如下权利：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人履行如下义务：

(1) 遵守基金合同；

(2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；

(5) 返还在基金交易过程中自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 变更基金投资目标、范围或策略；

(8) 变更基金份额持有人大会程序；

(9) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就涉及本基金的同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 在基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、如在上述第 4 条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

- 6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交截止时间和收取方式。

#### （四）基金份额持有人出席会议方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

如上述条件未能满足，则召集人应当将会议至少推迟 15 个工作日后重新召集，并公告重新开会的时间和地点，再次开会日期的提前通知期限为 10 天，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。重新以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会的，仍应满足上述条件。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

如上述条件未能满足，则召集人应当将会议至少推迟 15 个工作日后重新召集，并公告重新开会的时间和地点，再次开会日期的提前通知期限为 10 天，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。重新以通讯方式再次召集基金份额持有人大会的，仍应满足上述条件。

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有

基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其它事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。

##### 2、议事程序

##### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介上公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## 三、基金合同的变更与终止

### （一）基金合同的变更

1、除法律法规和基金合同另有规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准或备案。

2、依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、除依本基金合同和/或依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更须基金份额持有人大会决议通过和/或须报中国证监会核准以外的情形，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同进行变更后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、中国证监会允许的其他情况。

### （三）基金财产清算的事项

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

6、清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 7、基金清算剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 8、清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

#### 9、清算的账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 四、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

本基金合同受中国法律管辖。

## 五、基金合同存放及投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

## 第二十章 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人（或简称“管理人”）

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

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1 亿元人民币

经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

#### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字【1998】23 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

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】23 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人业务的监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资禁止行为进行监督。

基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人及时相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

8、对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等文件。

9、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### （二）基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

1、根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部财产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金财产实行分账管理等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### 三、基金资产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

1、基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人应遵守《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益安全保管基金财产。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效的持有并保管基金财产。

2、基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

3、基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

4、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金托管人应按照规定开立基金财产的资金账户和证券账户。本基金财产与基金托管人的其他财产及其他基金的财产实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。基金托管人应安全、完整地保管基金财产，未经基金管理人的正当指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

5、对于基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日没有到达基金托管人处的基金申购款项，基金托管人应及时通知基金管理人，由基金管理人采取措施进行催收，由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿，托管人应当予以配合。

6、对于因为基金投资产生的应收资产，由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行处理，由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿，基金托管人应当予以配合。

## （二）基金募集期满时募集资金的验证

基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有基金托管资格的商业银行的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期届满，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签名有效。基金管理人应将募集的属于基金财产的全部资金存入基金托管人以基金名义开立的银行账户中。基金托管人在收到资金当日出具基金财产接收报告。若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

## （三）投资者申购资金的归集和赎回资金的派发

基金托管人应及时查收基金份额持有人的申购资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管理人，基金管理人负责处理。因申购资金未及时到账而给基金造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

投资者赎回的资金，基金托管人应根据基金管理人的指令进行划拨。基金托管人未按约定时间划拨，给投资者造成损失的，基金托管人应承担赔偿责任。

## （四）基金银行账户的开设和管理

基金的银行账户的开设和管理由基金托管人根据基金管理人的申请办理。基金管理人予以配合并提供相关资料。基金托管人要确保所托管基金全部存款的安全。

基金托管人根据基金管理人的指令办理资金支付。本基金的预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金的银行账户进行。

本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

#### （五）基金证券账户、证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人在中国证券登记结算公司上海分公司、深圳分公司为基金开立托管人与基金联名的证券账户，用于本基金证券投资的清算和存管，并对证券账户业务发生情况进行如实记录。基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。基金托管人负责基金证券账户的开立和证券账户卡的保管。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立基金证券交易清算备付金账户，用于证券资金清算。

#### （六）债券托管账户的开设和管理

1、《基金合同》生效后，由基金管理人负责以基金的名义向中国人民银行提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算，基金管理人予以配合并提供相关资料。

2、基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间国债市场回购主协议，协议原件由基金管理人保管，基金管理人应将该协议原件的复印件加盖基金管理人公章（骑缝章）后，交基金托管人一份。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券可以存放于基金托管人的保管库，但要与存放于基金托管人处的非本基金的其他实物证券分开保管，也可存入中央国债登记结算公司或中国证券登记结算公司或其他由基金托管人选定的代保管库中。保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

1、与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应将该合同原件的复印件加盖基金管理人公章（骑缝章）后，交基金托管人一份。保管期限按照国家有关规定执行。

2、与基金财产有关的重大合同，根据基金运作管理的需要由基金托管人以基金的名义签署的，由基金管理人以加密传真方式下达签署指令（含有效授权内容），合同原件由基金托管人保管，但基金托管人应将该合同原件的复印件加盖基金托管人公章（骑缝章）后，交基金管理人一份。

3、因基金管理人将自己保管的本基金重大合同在未经基金托管人同意的情况下，用于抵质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金财产损失，由基金管理人负责，基金托管人予以免责。

4、因基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经管理人同意的情况下，用于抵质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金财产损失，由基金托管人负责，基金管理人予以免责。

#### （九）其他账户的开立和管理

1、因业务需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定办理和使用。

2、法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

### 四、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每日对基金资产估值并与基金托管人进行核对。

3、基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。

4、基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值和基金份额累计净值，并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人就基金份额净值和基金份额累计净值予以公布。

5、根据《销售办法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，则按基金会计责任方的建议执行。

#### （二）基金账册的建账和对账

1、基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，以基金管理人的处理方法为准。

2、经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

#### （三）基金财务报表与报告的编制和复核

1、基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制；月度报表的编制，应于每月结束后 5 个工作日内完成。

2、招募说明书在本基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，更新的招募说明书的编制应在基金合同生效后每 6 个月结束之日起 45 日内完成，并将全文登载在基金管理人的网站上，更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

3、基金管理人应在上半年结束之日起 45 日内完成半年度报告的编制，并于上半年结束后 60 日将全文登载在基金管理人的网站上，摘要登载在指定报刊上。

4、基金管理人应在会计年度结束后 60 日内完成年度报告的编制，并于会计年度结束后 90 日内将全文登载在基金管理人的网站上，摘要登载在指定报刊上。

5、基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在收到后立即进行复核，并在收到后 3 个工作日内将复核结果及时书面通知基金管理人。

6、基金管理人在更新的招募说明书或半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

7、基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 20 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

8、基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。若双方无法达成一致，则以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。

9、基金托管人在对基金财务报表及其更新、半年报或年报复核完毕后，需出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

注册登记机构负责编制和保管基金份额持有人名册。《基金合同》生效日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日，每季末的基金份额持有人名册，由注册登记机构负责编制，并在 5 个工作日内以光盘形式交由托管人保存。注册登记机构应保证基金份额持有人名册的真实性、有效性和完整性。

基金托管人不得将所保存的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

基金托管人和基金管理人对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

## 六、适用法律与争议解决

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应先友好协商解决。协商不成，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在北京，仲裁裁决是终局性的。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

## 七、托管协议的修改和终止

（一）本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会核准后生效。

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金托管人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或由其他基金托管人接管基金财产；
- 3、基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；
- 4、发生《基金法》、《基金合同》或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十一节 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### 一、客户服务专线

- 1、理财咨询：人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。
- 2、全天候的 7×24 小时电话自助查询（基金净值、账户信息等）。

### 二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过电话、信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

### 三、短信提示发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的手机短信资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送短信资讯。

### 四、电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送电子资讯。

## 五、联系基金管理人

- 1、网址：www.gtfund.com
- 2、电子邮箱：service@gtfund.com
- 3、客户服务热线：400-888-8688（全国免长途话费），021-31089000
- 4、客户服务传真：021-31081700
- 5、基金管理人办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层  
邮编：200082

六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十二节 其他应披露的事项

| 公告名称                                                                 | 报社                            | 日期         |
|----------------------------------------------------------------------|-------------------------------|------------|
| 国泰基金管理有限公司关于新增江苏银行股份有限公司直销账户的公告                                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        | 2018/11/27 |
| 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                                 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/13 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国信证券股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告                   | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/13 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国中投证券有限责任公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告                 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/24 |
| 国泰基金管理有限公司关于新增北京百度百盈基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定期定额投资及转换业务的公告                | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/25 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额投资计划并参加“2019 倾心回馈”基金定投费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/28 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、基金组合申购及定期定额投资费率优惠活动的公告          | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/28 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/28 |

|                                                |                               |            |
|------------------------------------------------|-------------------------------|------------|
| 国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告                      | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2018/12/29 |
| 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/3/30  |
| 国泰基金管理有限公司关于广发银行股份有限公司新增销售旗下部分基金并开通定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/4/11  |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告               | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/4/18  |
| 国泰基金管理有限公司关于撤销深圳分公司的公告                         | 《中国证券报》                       | 2019/4/26  |

## 第二十三节 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十四节 备查文件

- 一、中国证监会核准国泰金牛创新成长股票型证券投资基金募集的文件
- 二、《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《国泰金牛创新成长混合型证券投资基金托管协议》
- 四、关于申请募集国泰金牛创新成长股票型证券投资基金的法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照

国泰基金管理有限公司

二〇一九年十二月三十一日