

**国泰金鹏蓝筹价值混合型  
证券投资基金更新招募说明书  
(2020 年第四号)**

基金管理人：国泰基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2006 年 8 月 17 日发布的证监基金字[2006]159 号文批准公开发行。本基金的基金合同于 2006 年 9 月 29 日正式生效。

国泰基金管理有限公司（“本基金管理人”或“基金管理人”或“管理人”）保证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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并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。

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

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

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

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、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。

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

本招募说明书已经本基金托管人复核。本次招募说明书更新事由为年度更新，更新内容截止日为 2020 年 10 月 31 日。本招募说明书所载投资组合报告为 2020 年 3 季度报告，净值表现数据截止日为 2020 年 6 月 30 日。

## 目 录

|                             |    |
|-----------------------------|----|
| 第一部分 绪 言 .....              | 3  |
| 第二部分 释 义 .....              | 3  |
| 第三部分 基金管理人 .....            | 6  |
| 第四部分 基金托管人 .....            | 16 |
| 第五部分 相关服务机构 .....           | 18 |
| 第六部分 基金的募集 .....            | 36 |
| 第七部分 基金合同的生效 .....          | 37 |
| 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换 .....    | 38 |
| 第九部分 基金的投资 .....            | 46 |
| 第十部分 基金的业绩 .....            | 57 |
| 第十一部分 基金的财产 .....           | 58 |
| 第十二部分 基金资产的估值 .....         | 59 |
| 第十三部分 基金的收益与分配 .....        | 63 |
| 第十四部分 基金的费用与税收 .....        | 64 |
| 第十五部分 基金的会计与审计 .....        | 65 |
| 第十六部分 基金的信息披露 .....         | 66 |
| 第十七部分 风险揭示 .....            | 69 |
| 第十八部分 基金合同的终止与基金财产的清算 ..... | 73 |
| 第十九部分 基金合同内容摘要 .....        | 75 |
| 第二十部分 基金托管协议的内容摘要 .....     | 84 |
| 第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....    | 92 |
| 第二十二部分 其他应披露的事项 .....       | 92 |
| 第二十三部分 招募说明书的存放和查阅方式 .....  | 94 |
| 第二十四部分 备查文件 .....           | 94 |

## 第一部分 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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《国泰金鹏蓝筹价值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。

## 第二部分 释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

|           |                                        |
|-----------|----------------------------------------|
| 基金或本基金：   | 指国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金；                    |
| 基金合同：     | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》及其任何有效修订和补充；   |
| 招募说明书：    | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；         |
| 发售公告：     | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金份额发售公告》；          |
| 托管协议：     | 指《国泰金鹏蓝筹价值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； |
| 基金产品资料概要： | 指《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；      |
| 中国证监会：    | 指中国证券监督管理委员会；                          |

|              |                                                                                                                                            |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 中国银监会：       | 指中国银行业监督管理委员会；                                                                                                                             |
| 《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； |
| 《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；                                            |
| 《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；                                                                  |
| 《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：           | 指人民币元；                                                                                                                                     |
| 基金合同当事人：     | 指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；                                                                                       |
| 基金管理人：       | 指国泰基金管理有限公司；                                                                                                                               |
| 基金托管人：       | 指中国银行股份有限公司；                                                                                                                               |
| 注册登记业务：      | 指本基金登记、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：      | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为国泰基金管理有限公司或接受国泰基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；                                                                      |
| 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；                                                                                         |
| 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： | 指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；                           |
| 基金份额持有人大会： | 指按照基金合同第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；                                   |
| 基金募集期：     | 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；                |
| 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； |
| 存续期：       | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限；                                                    |
| 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；                                                |
| 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；    |
| 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；               |
| 投资指令：      | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；                             |
| 代销机构：      | 指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；                                   |
| 销售机构：      | 指基金管理人及本基金代销机构；                                                        |
| 基金销售网点：    | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；                                               |
| 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；   |
| 指定网站：      | 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。指定网站应当无偿向投资者提供基金信息披露服务；                |

|          |                                                                                                                                           |
|----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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；                                                                                             |
| 开放日：     | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；                                                                                                                    |
| 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；                                                                                                           |
| 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； |
| 法律法规：    | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；                                                                       |
| 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、证券交易所非正常暂停或停止交易等。                                            |

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

设立日期：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

## 二、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，2016 年 11 月至 2020 年 4 月任公司党委书记，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，24 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，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、深圳国际仲裁院仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2015 年 5 月起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。2020 年 8 月起兼任中国船舶重工集团海洋防务与信息对抗股份有限公司独立董事。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 月工作于中国建设银行辽宁省分行，曾任支行副行长、部门副总经理。2006 年 7 月至 2012 年 8 月工作于中国建银投资有限责任公司，其中，2007 年 4 月至 2008 年 2 月任中国投资咨询有限责任公司财务总监。2012 年 9 月至 2014 年 8 月任建投投资有限责任公司副总经理。2014 年 9 月起先后任公司纪委书记、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 月至 2020 年 7 月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 月至 2020 年 7 月任投资总监（FOF），2020 年 8 月起任投资总监（权益）。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，20 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，22 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。

刘国华，博士研究生，26 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，19 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）本基金的基金经理

##### 1、现任基金经理

胡松，硕士研究生，16 年证券基金从业经历。曾任职于海通证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、国泰基金管理有限公司、平安资产管理有限公司等。2017 年 1 月再次加入国泰基金管理有限公司。2020 年 9 月起任国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月起任养老金及专户投资（事业）部总监，2017 年 7 月起任投资总监（养老金）。

##### 2、历任基金经理

2006 年 9 月至 2007 年 3 月由冯天戈担任基金经理，2007 年 3 月至 2008 年 5 月由黄刚担任基金经理，2008 年 5 月至 2016 年 7 月 4 日由黄焱担任基金经理，2016 年 7 月 5 日至 2020 年 9 月 24 日由饶玉涵担任基金经理，2020 年 9 月 25 日至 2020 年 10 月 15 日由饶玉涵、胡松共同担任基金经理，2020 年 10 月 16 日至今由胡松担任基金经理。

#### （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：

邓时锋：投资总监（权益）

吴向军：投资总监（海外）、国际业务部总监

胡松：投资总监（养老金）、养老金及专户投资（事业）部总监

索峰：投资总监（固收）、绝对收益投资（事业）部负责人

孙蔚：研究部总监

（六）上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

### 三、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。

### 四、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。

## 五、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）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 六、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可操作性。

## 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。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

## 二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

## 三、证券投资基金托管情况

截至 2020 年 9 月 30 日，中国银行已托管 854 只证券投资基金，其中境内基金 808 只，QDII 基金 46 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

## 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或

者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五部分 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

| 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<br>办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号<br>法定代表人：陈四清<br>客服电话：95588<br>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<br>办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号<br>法定代表人：周慕冰<br>客服电话：95599<br>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<br>办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号<br>法定代表人：刘连舸<br>客服电话：95566<br>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<br>办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼<br>法定代表人：田国立<br>客服电话：95533<br>网址：www.ccb.com   |

|    |                |                                                                                                                               |
|----|----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 5  | 交通银行股份有限公司     | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号<br>办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号<br>法定代表人：任德奇<br>客服电话：95559<br>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<br>办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦<br>法定代表人：李建红<br>客服电话：95555<br>网址：www.cmbchina.com                      |
| 7  | 中信银行股份有限公司     | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座<br>办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦<br>法定代表人：孔丹<br>客服电话：95558<br>网址：www.bank.ecitic.com                |
| 8  | 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<br>办公地址：上海市中山东一路 12 号<br>法定代表人：高国富<br>客服电话：95528<br>网址：www.spdb.com.cn                                     |
| 9  | 中国民生银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号<br>办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号<br>法定代表人：洪崎<br>客服电话：95568<br>网址：www.cmbc.com.cn                                |
| 10 | 北京银行股份有限公司     | 注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层<br>办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号<br>法定代表人：闫冰竹<br>客服电话：95526<br>网址：www.bankofbeijing.com.cn                    |
| 11 | 华夏银行股份有限公司     | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号<br>办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号<br>法定代表人：吴建<br>客服电话：95577<br>网址：www.hxb.com.cn                               |
| 12 | 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<br>办公地址：广东省越秀区东风东路 713 号<br>法定代表人：王滨<br>客服电话：95508<br>网址：www.cgbchina.com.cn                            |
| 13 | 平安银行股份有限公司     | 注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦<br>办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦<br>法定代表人：肖遂宁<br>客服电话：95511-3、95501<br>网址：www.bank.pingan.com |

|    |                   |                                                                                                                            |
|----|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 14 | 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<br>办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号<br>法定代表人：陆华裕<br>客服电话：95574<br>网址：www.nbcb.com.cn                            |
| 15 | 上海农村商业银行股份有限公司    | 注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号<br>办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦<br>法定代表人：胡平西<br>客服电话：021-962999<br>网址：www.srcb.com                  |
| 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<br>办公地址：青岛市东海西路 31 号保时捷大厦青岛银行<br>法定代表人：郭少泉<br>客服电话：96588（青岛）、400-669-6588（全国）<br>网址：www.qdccb.com |
| 17 | 浙商银行股份有限公司        | 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号<br>办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号<br>法定代表人：沈仁康<br>客服电话：95527<br>网址：www.czbank.com                               |
| 18 | 杭州银行股份有限公司        | 注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦<br>办公地址：浙江省杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦<br>法定代表人：吴太普<br>客服电话：95398<br>网址：www.hzbank.com.cn                     |
| 19 | 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<br>办公地址：天津市河东区海河东路 218 号<br>法定代表人：李伏安<br>客服电话：95541<br>网址：www.cbhb.com.cn                            |
| 20 | 江苏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<br>办公地址：张家港市人民中路 66 号<br>法定代表人：王自忠<br>客服电话：0512-96065<br>网址：www.zrcbank.com                             |
| 21 | 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<br>办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦<br>法定代表人：李伟<br>客服电话：4001961200<br>网址：www.4001961200.com |
| 22 | 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<br>办公地址：阳市新区开元大道 256 号<br>法定代表人：王建甫<br>客服电话：0379-96699<br>网址：www.bankofluoyang.com.cn                |

|    |                  |                                                                                                                           |
|----|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 23 | 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<br>办公地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼<br>法定代表人：陈占维<br>客服电话：400-664-0099<br>网址：www.bankofd1.com |
| 24 | 哈尔滨银行股份有限公司      | 注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号<br>办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号<br>法定代表人：郭志文<br>客服电话：95537<br>网址：www.hrbb.com.cn                         |
| 25 | 东莞农村商业银行股份有限公司   | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号<br>办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号<br>法定代表人：何沛良<br>客服电话：0769-961122<br>网址：www.drcbank.com                   |
| 26 | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：浙江省常州市和平中路 413 号<br>办公地址：浙江省常州市和平中路 413 号<br>法定代表人：陆向阳<br>客服电话：0519-96005<br>网址：www.jnbank.com.cn                    |
| 27 | 包商银行股份有限公司       | 注册地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号<br>办公地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号<br>法定代表人：李镇西<br>客服电话：96016（北京、内蒙古地区）<br>网址：www.bsb.com.cn                      |
| 28 | 广州农村商业银行股份有限公司   | 注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号<br>办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号<br>法定代表人：王继康<br>客服电话：95313<br>网址：www.grcbank.com                         |
| 29 | 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<br>办公地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号<br>法定代表人：王兰凤<br>客服电话：0512-96067<br>网址：www.suzhoubank.com               |
| 30 | 杭州联合农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：杭州市建国中路 99 号<br>办公地址：杭州市建国中路 99 号<br>法定代表人：张晨<br>客服电话：96592<br>网址：www.urcb.com                                       |
| 31 | 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<br>办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座<br>法定代表人：阎俊生<br>客服电话：95105588<br>网址：www.jshbank.com        |

|    |                    |                                                                                                                                   |
|----|--------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 32 | 山东寿光农村商业银行股份有限公司   | 注册地址：山东寿光市银海路 19 号<br>办公地址：山东寿光市银海路 19 号<br>法定代表人：颜廷军<br>客服电话：0536—96633<br>网址：www.sdnxs.com                                      |
| 33 | 昆仑银行股份有限公司         | 注册地址：新疆克拉玛依市世纪大道 7 号<br>办公地址：新疆克拉玛依市世纪大道 7 号<br>法定代表人：蒋尚军<br>客服电话：4006696569<br>网址：www.klb.cn                                     |
| 34 | 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：浙江省绍兴市柯桥笛扬路 1363 号<br>办公地址：浙江省绍兴市柯桥笛扬路 1363 号<br>法定代表人：俞俊海<br>客服电话：0575-81105323<br>网址：www.borf.cn                           |
| 35 | 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<br>办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505<br>法定代表人：林义相<br>客服电话：010-66045678<br>网址：www.txsec.com           |
| 36 | 江苏金百临投资咨询股份有限公司    | 注册地址：无锡市滨湖区锦溪路 99 号<br>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<br>法定代表人：费晓燕<br>客服电话：0510-9688988<br>网址：www.jsjbl.com                        |
| 37 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司   | 注册地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室<br>办公地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室<br>法定代表人：齐凌峰<br>客服电话：400-158-5050<br>网址：www.9ifund.com |
| 38 | 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<br>办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层<br>法定代表人：洪弘<br>客服电话：400-166-1188<br>网址：8.jrj.com.cn  |
| 39 | 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<br>办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦<br>法定代表人：刘明军<br>客服电话：95017<br>网址：tenganxinxi.com                        |
| 40 | 北京度小满基金销售有限公司      | 注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室<br>办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼<br>法定代表人：葛新<br>客服电话：95055-4<br>网址：www.baiyingfund.com    |

|    |                |                                                                                                                                          |
|----|----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 41 | 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<br>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋<br>法定代表人：汪静波<br>客服电话：400-821-5399<br>网址：www.noah-fund.com                    |
| 42 | 深圳众禄基金销售股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801<br>办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801<br>法定代表人：薛峰<br>客服电话：4006-788-887<br>网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com    |
| 43 | 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<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦<br>法定代表人：其实<br>客服电话：4001818188<br>网址：www.1234567.com.cn                        |
| 44 | 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<br>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<br>法定代表人：杨文斌<br>客服电话：400-700-9665<br>网址：www.ehowbuy.com |
| 45 | 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<br>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<br>法定代表人：祖国明<br>客服电话：4000-766-123<br>网址：www.fund123.cn |
| 46 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层<br>法定代表人：张跃伟<br>客服电话：400-820-2899<br>网址：www.erichfund.com                 |
| 47 | 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<br>办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼<br>法定代表人：凌顺平<br>客服电话：4008-773-772<br>网址：www.5ifund.com                            |
| 48 | 北京展恒基金销售股份有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号<br>办公地址：北京市朝阳区安苑路 11 号邮电新闻大厦 6 层<br>法定代表人：闫振杰<br>客服电话：4008188000<br>网址：www.myfund.com                             |
| 49 | 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<br>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<br>法定代表人：李兴春<br>客服电话：95733<br>网址：www.leadfund.com.cn                 |



|    |                  |                                                                                                                                                       |
|----|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 50 | 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<br>办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层<br>法定代表人：赵学军<br>客服电话：400-021-8850<br>网址：www.harvestwm.cn |
| 51 | 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<br>办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室<br>法定代表人：梁蓉<br>客服电话：400-6262-818<br>网址：www.5irich.com                            |
| 52 | 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<br>办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809<br>法定代表人：戎兵<br>客服电话：400-6099-200<br>网址：www.yixinfund.com                     |
| 53 | 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<br>办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号（苏宁总部）<br>法定代表人：王锋<br>客服电话：95177<br>网址：www.snjijin.com                                                  |
| 54 | 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<br>办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室<br>法定代表人：叶精一<br>客服电话：400-066-8586<br>网址：www.igesafe.com                        |
| 55 | 浦领基金销售有限公司       | 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室<br>办公地址：北京市朝阳区望京中航资本大厦 10 层<br>法定代表人：聂婉君<br>客服电话：400-012-5899<br>网址：www.zscffund.com                          |
| 56 | 北京增财基金销售有限公司     | 注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号<br>办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号<br>法定代表人：罗细安<br>客服电话：010-67000988<br>网址：www.zcvc.com.cn                |
| 57 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层<br>法定代表人：沈丹义<br>客服电话：4001019301<br>网址：www.tonghuafund.com                          |

|    |                    |                                                                                                                                                         |
|----|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 58 | 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<br>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<br>法定代表人：周斌<br>客服电话：4008980618<br>网址：www.chtwm.com                    |
| 59 | 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<br>办公地址：北京市西直门外大街 1 号院 2 号楼 19 层 19C13<br>法定代表人：王伟刚<br>客服电话：400-619-9059<br>网址：www.hcjijin.com                          |
| 60 | 一路财富（北京）基金销售股份有限公司 | 注册地址：北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14<br>办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层<br>法定代表人：吴雪秀<br>客服电话：400-001-1566<br>网址：www.yilucaifu.com                            |
| 61 | 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<br>办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号<br>法定代表人：于龙<br>客服电话：4006-802-123<br>网址：www.zhixin-inv.com                                |
| 62 | 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<br>办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座<br>法定代表人：赵芯蕊<br>客服电话：010-62675369<br>网址：www.xincai.com |
| 63 | 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<br>办公地址：中国（上海）浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼<br>法定代表人：王廷富<br>客服电话：400-799-1888<br>网址：www.520fund.com.cn                    |
| 64 | 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<br>办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层<br>法定代表人：尹彬彬<br>客服电话：400-166-6788<br>网址：www.66liantai.com                       |
| 65 | 上海汇付基金销售有限公司       | 注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元<br>办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天软件园 C5 幢<br>法定代表人：金佶<br>客服电话：021-34013999<br>网址：www.hotjijin.com                         |

|    |                  |                                                                                                                                                   |
|----|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 66 | 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<br>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<br>法定代表人：季长军<br>客服电话：400-188-5687<br>网址：www.buyforyou.com.cn  |
| 67 | 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<br>办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦<br>法定代表人：陈继武<br>客服电话：4006-433-389<br>网址：www.vstonewealth.com                           |
| 68 | 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<br>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<br>法定代表人：郑毓栋<br>客服电话：400-618-0707<br>网址：www.hongdianfund.com          |
| 69 | 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<br>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<br>法定代表人：祝中村<br>客服电话：0755-83999907<br>网址：www.fujifund.cn |
| 70 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号<br>法定代表人：王之光<br>客服电话：4008219031<br>网址：www.lufunds.com                             |
| 71 | 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<br>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<br>法定代表人：肖雯<br>客服电话：020-89629066<br>网址：www.yingmi.cn             |
| 72 | 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<br>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<br>法定代表人：王旋<br>客服电话：4000-555-671<br>网址：www.hgccpb.com    |
| 73 | 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<br>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<br>法定代表人：钱昊旻<br>客服电话：4008909998<br>网址：www.jnlc.com                         |

|    |                      |                                                                                                                                                                             |
|----|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 74 | 京东肯特瑞基金销售有限公司        | 注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157<br>办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层<br>法定代表人：王苏宁<br>客服电话：95118<br>网址：kenterui.jd.com                                      |
| 75 | 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<br>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<br>法定代表人：钟斐斐<br>客服电话：4001599288<br>网址：danjuanapp.com                                     |
| 76 | 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<br>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<br>法定代表人：李修辞<br>客服电话：010-59013895<br>网址：www.wanjiawealth.com                             |
| 77 | 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<br>办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层<br>法定代表人：毛淮平<br>客服电话：400-817-5666<br>网址：www.amcfortune.com                                          |
| 78 | 中信期货有限公司             | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层<br>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<br>法定代表人：张皓<br>客服电话：400-990-8826<br>网址：www.citicsf.com |
| 79 | 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<br>办公地址：上海市静安区新闻路 669 号 博华大厦 21 楼<br>法定代表人：贺青<br>客服电话：95521<br>网址：www.gtja.com                                                                  |
| 80 | 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<br>办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层<br>法定代表人：王常青<br>客服电话：95587、4008-888-108<br>网址：www.csc108.com                                                    |
| 81 | 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 号国信证券大厦十六层至二十六层<br>办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层<br>法定代表人：何如<br>客服电话：95536                                                                      |

|    |              |                                                                                                                                                                                                  |
|----|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |              | 网址: <a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>                                                                                                                                     |
| 82 | 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<br>办公地址: 深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦<br>法定代表人: 霍达<br>客服电话: 400-888-8111、95565<br>网址: <a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>                            |
| 83 | 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<br>办公地址: 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦<br>法定代表人: 孙树明<br>客服电话: 95575<br>网址: <a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>                                             |
| 84 | 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<br>办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦<br>法定代表人: 张佑君<br>客服电话: 95548<br>网址: <a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a>                                  |
| 85 | 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<br>办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座<br>法定代表人: 陈共炎<br>客服电话: 4008-888-888、95551<br>网址: <a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a>                 |
| 86 | 海通证券股份有限公司   | 注册地址: 上海市广东路 689 号<br>办公地址: 上海市广东路 689 号<br>法定代表人: 王开国<br>客服电话: 95553<br>网址: <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>                                                                    |
| 87 | 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<br>办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层<br>法定代表人: 杨玉成<br>客服电话: 95523、4008895523<br>网址: <a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>                                       |
| 88 | 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<br>办公地址: 上海市浦东新区长柳路 36 号<br>法定代表人: 杨华辉<br>客服电话: 95562<br>网址: <a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a>                                                          |
| 89 | 长江证券股份有限公司   | 注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦<br>办公地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦<br>法定代表人: 李新华<br>客服电话: 95579<br>网址: <a href="http://www.95579.com">www.95579.com</a>                                                          |
| 90 | 安信证券股份有限公司   | 注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元<br>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<br>法定代表人: 黄炎勋<br>客服电话: 400-800-1001<br>网址: <a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a> |

|    |            |                                                                                                                                     |
|----|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 91 | 西南证券股份有限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号<br>办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号<br>法定代表人：廖庆轩<br>客服电话：95355、400-809-6096<br>网址：www.swsc.com.cn                              |
| 92 | 湘财证券股份有限公司 | 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼<br>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<br>法定代表人：孙永祥<br>客服电话：95351<br>网址：www.xcsc.com  |
| 93 | 万联证券股份有限公司 | 注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层<br>办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层<br>法定代表人：罗钦城<br>客服电话：95322<br>网址：www.wlzq.cn    |
| 94 | 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<br>办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层<br>法定代表人：冯鹤年<br>客服电话：95376<br>网址：www.msyzq.com |
| 95 | 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<br>办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座<br>法定代表人：凤良志<br>客服电话：95578<br>网址：www.gyzq.com.cn                 |
| 96 | 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<br>办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号<br>法定代表人：王春峰<br>客服电话：400-651-5988<br>网址：www.ewww.com.cn                    |
| 97 | 华泰证券股份有限公司 | 注册地址：南京市江东中路 228 号<br>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<br>法定代表人：周易<br>客服电话：95597<br>网址：www.htzq.com.cn               |
| 98 | 山西证券股份有限公司 | 注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼<br>办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼<br>法定代表人：侯巍<br>客服电话：400-666-1618、95573<br>网址：www.i618.com.cn             |

|     |                |                                                                                                                                       |
|-----|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 99  | 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<br>办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层<br>法定代表人：姜晓林<br>客服电话：95548<br>网址：sd.citics.com                       |
| 100 | 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<br>办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号<br>法定代表人：范力<br>客服电话：95330<br>网址：www.dwzq.com.cn                                              |
| 101 | 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<br>办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼<br>法定代表人：张志刚<br>客服电话：95321<br>网址：www.cindasc.com                             |
| 102 | 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<br>办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层<br>法定代表人：潘鑫军<br>客服电话：95503<br>网址：www.dfzq.com.cn               |
| 103 | 方正证券股份有限公司     | 注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717<br>办公地址：北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼<br>法定代表人：施华<br>客服电话：95571<br>网址：www.foundersc.com |
| 104 | 光大证券股份有限公司     | 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号<br>办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号<br>法定代表人：周健男<br>客服电话：95525<br>网址：www.ebscn.com                                         |
| 105 | 中信证券华南股份有限公司   | 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 层、20 层<br>办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层<br>法定代表人：胡伏云<br>客服电话：95396<br>网址：www.gzs.com.cn    |
| 106 | 东北证券股份有限公司     | 注册地址：长春市生态大街 6666 号<br>办公地址：长春市生态大街 6666 号<br>法定代表人：李福春<br>客服电话：95360<br>网址：www.nesc.cn                                               |
| 107 | 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<br>办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼<br>法定代表人：李俊杰<br>客服电话：4008918918<br>网址：www.shzq.com                             |

|     |             |                                                                                                                                                  |
|-----|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 108 | 新时代证券股份有限公司 | 注册地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501<br>办公地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501<br>法定代表人:叶顺德<br>客服电话:95399<br>网址:www.xsdzq.cn                     |
| 109 | 浙商证券股份有限公司  | 注册地址:浙江省杭州市江干区五星路 201 号<br>办公地址:浙江省杭州市江干区五星路 201 号<br>法定代表人:吴承根<br>客服电话:95345<br>网址:www.stocke.com.cn                                            |
| 110 | 平安证券股份有限公司  | 注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层<br>办公地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层<br>法定代表人:何之江<br>客服电话:95511-8<br>网址:stock.pingan.com |
| 111 | 华安证券股份有限公司  | 注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号<br>办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号<br>法定代表人:章宏韬<br>客服电话:95318<br>网址:www.hazq.com                                         |
| 112 | 国海证券股份有限公司  | 注册地址:广西桂林市辅星路 13 号<br>办公地址:广西南宁市滨湖路 46 号<br>法定代表人:何春梅<br>客服电话:95563<br>网址:www.ghzq.com.cn                                                        |
| 113 | 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<br>办公地址:东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼<br>法定代表人:陈照星<br>客服电话:95328<br>网址:www.dgzq.com.cn                                    |
| 114 | 中原证券股份有限公司  | 注册地址:郑州市郑东新区商务外环路 10 号<br>办公地址:郑州市郑东新区商务外环路 10 号<br>法定代表人:菅明军<br>客服电话:95377<br>网址:www.ccnew.com                                                  |
| 115 | 国都证券股份有限公司  | 注册地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层<br>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<br>法定代表人:翁振杰<br>客服电话:400-818-8118<br>网址:www.guodu.com               |



|     |              |                                                                                                                                                         |
|-----|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 116 | 东海证券股份有限公司   | 注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层<br>办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦<br>法定代表人：钱俊文<br>客服电话：95531、400-8888-588<br>网址：www.longone.com.cn                           |
| 117 | 中银国际证券股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层<br>办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层<br>法定代表人：宁敏<br>客服电话：4006208888<br>网址：www.bocichina.com                               |
| 118 | 恒泰证券股份有限公司   | 注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼<br>办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼<br>法定代表人：庞介民<br>客服电话：956088<br>网址：www.cnht.com.cn                            |
| 119 | 国盛证券有限责任公司   | 注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号<br>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<br>法定代表人：徐丽峰<br>客服电话：956080<br>网址：www.gsyzq.com                                    |
| 120 | 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<br>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<br>法定代表人：杨炯洋<br>客服电话：95584<br>网址：www.hxl68.com.cn                                      |
| 121 | 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<br>办公地址：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<br>法定代表人：李琦<br>客服电话：4008000562<br>网址：www.hysec.com |
| 122 | 中泰证券股份有限公司   | 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号<br>办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号<br>法定代表人：李玮<br>客服电话：95538<br>网址：www.zts.com.cn                                                         |
| 123 | 世纪证券有限责任公司   | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼<br>办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层<br>法定代表人：李强<br>客服电话：4008323000<br>网址：www.csc.com.cn                                  |

|     |              |                                                                                                                                                                                                   |
|-----|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 124 | 中航证券有限公司     | 注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层<br>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<br>法定代表人：王晓峰<br>客服电话：95335<br>网址：www.avicsec.com                                                                |
| 125 | 德邦证券股份有限公司   | 注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼<br>办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 19 楼<br>法定代表人：武晓春<br>客服电话：4008888128<br>网址：www.tebon.com.cn                                                                                |
| 126 | 西部证券股份有限公司   | 注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室<br>办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室<br>法定代表人：徐朝晖<br>客服电话：95582<br>网址：www.westsecu.com                                                                      |
| 127 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼<br>法定代表人：黄金琳<br>客服电话：95547<br>网址：www.hfzq.com.cn                                                                              |
| 128 | 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<br>办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼<br>法定代表人：陈牧原<br>客服电话：95368<br>网址：www.hlzq.com                                                                                      |
| 129 | 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<br>办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层<br>法定代表人：李剑阁<br>客服电话：010-65051166<br>网址：www.cicc.com.cn                                                                        |
| 130 | 华鑫证券有限责任公司   | 注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号<br>法定代表人：俞洋<br>客服电话：95323<br>网址：www.cfsc.com.cn                                                                           |
| 131 | 中国中金财富证券有限公司 | 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<br>01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元<br>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<br>法定代表人：高涛<br>客服电话：95532<br>网址：www.ciccwm.com |

|     |              |                                                                                                                                 |
|-----|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 132 | 东方财富证券股份有限公司 | 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦<br>法定代表人：徐伟琴<br>客服电话：95357<br>网址：www.18.cn                           |
| 133 | 国融证券股份有限公司   | 注册地址：呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼<br>办公地址：呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼<br>法定代表人：孔佑杰<br>客服电话：95385<br>网址：www.grzq.com                            |
| 134 | 江海证券有限公司     | 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号<br>办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号<br>法定代表人：赵洪波<br>客服电话：956007<br>网址：www.jhzq.com.cn                          |
| 135 | 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<br>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<br>法定代表人：魏先锋<br>客服电话：95305<br>网址：www.jzsec.com                    |
| 136 | 国金证券股份有限公司   | 注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号<br>办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号<br>法定代表人：冉云<br>客服电话：4006600109<br>网址：www.gjzq.com.cn                             |
| 137 | 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<br>办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层<br>法定代表人：陈林<br>客服电话：400-820-9898<br>网址：www.cnhbstock.com |
| 138 | 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<br>办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼<br>法定代表人：王勇<br>客服电话：400-0099-886<br>网址：www.gwgsc.com                    |
| 139 | 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<br>办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十一层<br>法定代表人：吴骏<br>客服电话：400-869-8698<br>网址：www.ydsc.com.cn                    |
| 140 | 华融证券股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融大街 8 号<br>办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号<br>法定代表人：祝献忠<br>客服电话：95390<br>网址：www.hrsec.com.cn                                 |

|     |              |                                                                                                                             |
|-----|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 141 | 开源证券股份有限公司   | 注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层<br>办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层<br>法定代表人：李刚<br>客服电话：95325<br>网址：www.kysec.cn               |
| 142 | 中国人寿保险股份有限公司 | 注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号<br>办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号<br>法定代表人：王滨<br>客服电话：95519<br>网址：www.e-chinalife.com                        |
| 143 | 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<br>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<br>法定代表人：窦荣兴<br>客服电话：95186<br>网址：www.zybank.com.cn |
| 144 | 上海基煜基金销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元<br>办公地址：上海市浦东新区太平金融大厦 1503 室<br>法定代表人：王翔<br>客服电话：021-65370077<br>网址：www.fofund.com.cn     |

基金管理人可根据有关法律法规规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站上公示。

## 二、注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室

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

法定代表人：陈勇胜

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 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：韩炯

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

## 第六部分 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[2006]159 号文批准，于 2006 年 8 月 28 日起向全社会公开募集。截止 2006 年 9 月 27 日，基金募集工作已顺利结束。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 1,248,741,994.07 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 232,118.68 元人民币。上述资金已于 2006 年 9 月 29 日全额划入本基金在基金托管人中国银行开立的国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管专户。

### 二、基金类型

混合型

### 三、基金运作方式

契约型、开放式

### 四、基金的存续期间

不定期

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

### 二、基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### 三、基金合同的生效

本基金经中国证监会证监基金字[2006]159 号文件批准设立，于 2006 年 8 月 28 日起向全社会公开募集。截止 2006 年 9 月 27 日，基金募集工作已顺利结束。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 1,248,741,994.07 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 232,118.68 元人民币。上述资金已于 2006 年 9 月 29 日全额划入本基金在基金托管人中国银行开立的国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 24138 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，募集期间募集及利息结转的基金份额共计 1,248,974,112.75 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。本次基金募集期间所发生的律师费和会计师费等费用从基金募集费用中列支，不另从基金资产支付；与本基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金招募说明书》、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》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 2006 年 9 月 29 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。

### 四、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金基金合同生效后的存续期间，连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会，说明出现上述情况的原因及解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 第八部分 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或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、申购、赎回与转换的开放日及时间

#### （一）开放日

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。

国泰电子交易平台提供 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、赎回与转换的时间进行调整，但此项调整不应给投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。

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

#### （二）申购、赎回与转换的开始日及业务办理时间

本基金已于 2006 年 11 月 13 日起开始办理日常申购交易业务，2006 年 11 月 27 日起开始办理日常赎回交易业务，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。基金管理人最迟应于转换开始前 3 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

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。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其它特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

### 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收市后计算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当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

（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。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但最迟应在新的原则实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介予以公告。

#### 四、申购、赎回与转换的数额限定

##### （一）申购金额的限制

投资人申购本基金的单笔申购最低金额为 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。

若其他基金销售机构对上述限制有不同规定，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，当某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额不足 1 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

若其他基金销售机构对上述调整有不同规定，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。

##### （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。基金转换在本基金管理人直销渠道的最低申请份额为 100 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）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。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，必须提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介刊登公告。

## 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

申购采用全额交款方式，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、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，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

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额÷（1+申购费率）

（注：对于一定金额以上的申购适用绝对数额的申购费金额，净申购金额=申购金额-申购费用）

申购费用=申购金额－净申购金额

申购份额=净申购金额÷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

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×基金赎回费率

赎回净额=赎回金额－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：

基金份额净值=基金资产净值总额÷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

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     |
|------------------|----------|
| 50 万元以下          | 1.5%     |
| 50 万元（含）—200 万元  | 1.0%     |
| 200 万元（含）—500 万元 | 0.6%     |
| 500 万元（含）以上      | 1000 元/笔 |

举例说明：

某投资者以 60 万元申购本基金，申购费率为 1.0%，假设申购当日基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=600,000÷(1+1.0%)=594,059.41 元

申购费用=600,000-594,059.41=5,940.59 元

申购份额=594,059.41÷1.100=540,054.01 份

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 1.100 元，则其可得到的申购份额为 540,054.01 份。

## （二）赎回费

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，不低于 25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。其中，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     | 1.50% |
| 7日（含）—1年 | 0.50% |
| 1年（含）—2年 | 0.20% |
| 2年（含）以上  | 0     |

（注：1 年按 365 日计算）

举例说明：

某基金份额持有人赎回持有 7 日（含）以上但不超过 1 年的 1000 份基金份额，赎回对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回净额为：

赎回金额=1000×1.100=1100 元

赎回费用=1100×0.5%=5.50 元

赎回净额=1100-5.50=1094.50 元

即基金份额持有人赎回持有 7 日（含）以上但不超过 1 年的 1000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回净额为 1094.50 元。

## （三）转换费

1、基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，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）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、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，基金管理人应在调整实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

（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、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；

（六）当基金管理人认为某笔申购申请会影响到其他基金份额持有人的利益时，可以拒绝该笔申购申请；

（七）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；

（八）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述第（一）、（二）、（三）、（四）、（五）、（六）、（八）项暂停申购情形基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。发生上述第（七）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。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

## 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）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （五）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；
- （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，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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和转换业务的办理并及时公告。

## 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（指基金赎回份额与转出份额之和减去基金申购份额与转入份额之和后的余额）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

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接受全额赎回或部分延期赎回。

1、接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

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、接受全额赎回”或“2、部分延期赎回”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，但不得超过二十个工作日，并应当在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。

（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，在中国证监会指定媒介，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，在中国证监会指定媒介，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，在中国证监会指定媒介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，二个月内办理；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、基金的冻结与质押

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。

根据相关法律法规的规定或有关监管机构的认可，基金管理人可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金将坚持并深化价值投资理念。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增值，力争获取更高的超额市场收益。

## 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（含存托凭证）、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、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产（含存托凭证）的投资比例占基金资产的 35%-95%，债券以及包括权证和资产支持证券在内的其他证券资产占基金资产的 0-60%，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）大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济环境、证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围组合投资止损点，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

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采取核心-卫星投资策略(Core-Satellite strategy)，核心投资主要以富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股为标的，构建核心股票投资组合，以期获得市场的平均收益（benchmark performance），这部分投资至少占基金股票资产的 80%；同时，把握行业周期轮动、市场时机等机会，通过自下而上、精选个股、积极主动的卫星投资策略，力争获得更高的超额市场收益(outperformance)。

### 1、核心股票资产投资策略

本基金的核心股票投资策略主要以富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数所包括的成分股以及备选成分股为选股池，采取增强型的指数跟踪技术。即以抽样复制的形式，在核心股票选股池中选取一定数量的个股进行投资，使核心股票的投资表现和富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数的表现在一定范围内联动，即核心股票收益率基本跟踪富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数的收益率。

### 2、卫星股票资产投资策略

本基金的卫星股票投资策略将充分发挥基金经理人在主动投资上具有的优势，着眼于企业的未来盈利水平，选取预期成长性强，并能将成长转换成实实在在收益的个股，与核心股票组合形成互补，卫星股票组合对于整个基金的股票组合来说能起到增加超额收益、降低组合风险的作用。本基金通过成长因子来筛选成长性股票，成长因子主要包括以下指标：

- （1）总资产增长率
- （2）主营业务增长率
- （3）净利润增长率
- （4）资产回报增长率

以上四个指标按一定的权数加权平均，形成一个复合型的成长因子，能够更为全面地判断企业的成长性。

## （三）存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## （四）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 级或者相当于 AA 级的信用评级及以上；
- 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、核心股票组合的选择

- (1) 以富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股为初始集合；

(2) 以企业的财务报表为基础预测成份股个股未来现金流；

(3) 以企业的平均资金成本(WACC)为折现因子将成份股个股的未来现金流折现(DCF)；将个股的净现值(NPV)和市值比较，按行业分类，选取价值被低估的个股。

## 2、卫星股票组合的选择

(1) 以核心股票选股范围(富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数所包含的成分股以及备选成分股)以外的股票为初始集合；

(2) 选取成长因子，计算个股的成长性；

(3) 按行业对个股的成长值进行数据标准化；

(4) 按标准化的成长值对个股排序，选取成长值排名靠前的个股。

## (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、基金合同和基准指数等的相关规定；
- 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 and 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。可采取适当的技术和方法，降低交易成本、控制投资风险。

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，密切跟踪标的指数。

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。

交易对手库由公司债券交易员发起更新，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，债券交易员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，债券交易员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

业绩比较基准=60%×富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数+40%×中证全债指数

本基金的股票业绩比较基准为富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数（原新华富时蓝筹价值 100 指数），债券业绩比较基准为中证全债指数。

注：本基金原业绩比较基准为“60%×新华富时蓝筹价值 100 指数+40%×新华雷曼中国债券指数”。2008 年 11 月 7 日，新华富时指数有限公司于宣布其母公司新华财经有限公司与雷曼兄弟公司合作推出的新华雷曼中国债券指数即日起更名为新华巴克莱资本中国债券指数。指数的计算和管理并无任何改变。本基金业绩比较基准变更为“60%×新华富时蓝筹价值 100 指数+40%×新华巴克莱资本中国债券指数（原新华雷曼中国债券指数）”。

因富时集团成为新华富时指数有限公司的全资股东，根据其相关公告，新华富时指数系列于 2010 年 12 月 16 日起正式更名为富时中国指数系列。其中，新华富时蓝筹价值 100 指

数更名为富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数。因此，本基金业绩比较基准中的指数相应更名，更名后业绩比较基准为“60%×富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数+40%×新华巴克莱资本中国债券指数”。

根据富时集团将终止提供新华巴克莱中国全债指数系列的相关服务的通知，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定变更本基金的业绩比较基准，同时修改基金合同的相关内容。自 2013 年 2 月 1 日起，本基金业绩比较基准变更为“60%×富时中国 A 股蓝筹价值 100 指数+40%×中证全债指数”。

如果业绩比较基准中的指数被停止编制或发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更而导致指数不宜继续作为本基金的业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的业绩比较基准，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更基准指数，无须经基金份额持有人大会决议通过，在与基金托管人协商一致并履行合适程序后，于正式实施变更前 2 日内在中国证监会指定的媒介上予以公告。

## 八、风险收益特征

本基金属于中等风险的证券投资基金品种，基金在获取市场平均收益的同时，力争获得更高的超额收益。

## 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、持有一家上市公司的股票（含存托凭证），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（含存托凭证）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、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过本基金资产净值的 20%；

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本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、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

15、法律法规和基金合同规定的其他限制。

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或备案。

## 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。除上述第 12、13 项另有约定外，因证券市场波动、上市公司改革或合并、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、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 十二、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 9 月 30 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              | 493,297,155.35 | 85.91        |
|    | 其中：股票             | 493,297,155.35 | 85.91        |
| 2  | 固定收益投资            | 4,987,008.00   | 0.87         |
|    | 其中：债券             | 4,987,008.00   | 0.87         |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 71,841,485.73  | 12.51        |
| 7  | 其他各项资产            | 4,065,352.06   | 0.71         |
| 8  | 合计                | 574,191,001.14 | 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      | —       | —            |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业              | 410,498,902.01 | 73.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -     |
| E | 建筑业              | 13,029.12      | 0.00  |
| F | 批发和零售业           | 8,651,296.03   | 1.55  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 18,653.36      | 0.00  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 28,610,031.58  | 5.11  |
| J | 金融业              | 39,985,660.91  | 7.14  |
| 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       | 5,462,275.00   | 0.98  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 57,307.34      | 0.01  |
| 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               | 493,297,155.35 | 88.14 |

## （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  | 600521 | 华海药业 | 1,119,769 | 35,910,991.83 | 6.42         |
| 2  | 600309 | 万华化学 | 443,800   | 30,755,340.00 | 5.50         |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 735,800   | 28,328,300.00 | 5.06         |
| 4  | 600031 | 三一重工 | 1,127,002 | 28,051,079.78 | 5.01         |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 186,400   | 26,757,720.00 | 4.78         |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 115,000   | 25,415,000.00 | 4.54         |
| 7  | 000895 | 双汇发展 | 475,900   | 25,189,387.00 | 4.50         |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 280,600   | 21,398,556.00 | 3.82         |



|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 9  | 601012 | 隆基股份 | 250,800   | 18,812,508.00 | 3.36 |
| 10 | 601128 | 常熟银行 | 2,379,911 | 18,587,104.91 | 3.32 |

（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      | 4,987,008.00 | 0.89         |
| 2  | 央行票据      | —            | —            |
| 3  | 金融债券      | —            | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —            | —            |
| 4  | 企业债券      | —            | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —            | —            |
| 6  | 中期票据      | —            | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —            | —            |
| 8  | 同业存单      | —            | —            |
| 9  | 其他        | —            | —            |
| 10 | 合计        | 4,987,008.00 | 0.89         |

（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  | 019627 | 20 国债 01 | 49,920 | 4,987,008.00 | 0.89         |

（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

本基金本报告期内未投资股指期货。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

（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“华海药业、常熟银行”违规外）

没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

华海药业因未及时披露公司重大事件，受到上交所警示。

常熟银行及下属分支机构因未依法履行职责、违规经营等原因，多次受到地方银保监会、央行派出机构的罚款、警告等公开处罚。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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   | 124,661.03   |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,774,541.20 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 90,523.49    |
| 5  | 应收申购款   | 75,626.34    |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 4,065,352.06 |

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2020 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

|                                      |         |       |         |       |         |        |
|--------------------------------------|---------|-------|---------|-------|---------|--------|
| 2006 年 9 月 29 日至<br>2006 年 12 月 31 日 | 34.59%  | 1.13% | 56.28%  | 1.53% | -21.69% | -0.40% |
| 2007 年度                              | 105.22% | 1.88% | 70.10%  | 1.39% | 35.12%  | 0.49%  |
| 2008 年度                              | -52.69% | 2.45% | -44.64% | 1.82% | -8.05%  | 0.63%  |
| 2009 年度                              | 87.25%  | 1.56% | 47.78%  | 1.23% | 39.47%  | 0.33%  |
| 2010 年度                              | -3.03%  | 1.37% | -11.06% | 0.92% | 8.03%   | 0.45%  |
| 2011 年度                              | -21.98% | 1.16% | -10.37% | 0.74% | -11.61% | 0.42%  |
| 2012 年度                              | 3.20%   | 1.19% | 7.84%   | 0.72% | -4.64%  | 0.47%  |
| 2013 年度                              | 8.94%   | 1.28% | -8.13%  | 0.89% | 17.07%  | 0.39%  |
| 2014 年度                              | 43.87%  | 1.14% | 39.14%  | 0.79% | 4.73%   | 0.35%  |
| 2015 年度                              | 18.62%  | 2.32% | 4.30%   | 1.49% | 14.32%  | 0.83%  |
| 2016 年度                              | -4.85%  | 1.27% | -3.71%  | 0.74% | -1.14%  | 0.53%  |
| 2017 年度                              | 24.63%  | 0.82% | 18.19%  | 0.41% | 6.44%   | 0.41%  |
| 2018 年度                              | -30.37% | 1.26% | -10.08% | 0.82% | -20.29% | 0.44%  |
| 2019 年度                              | 43.50%  | 1.24% | 24.69%  | 0.75% | 18.81%  | 0.49%  |
| 2020 年上半年                            | 20.37%  | 1.56% | -1.17%  | 0.86% | 21.54%  | 0.70%  |
| 2006 年 9 月 29 日至<br>2020 年 6 月 30 日  | 406.59% | 1.53% | 166.99% | 1.05% | 239.60% | 0.48%  |

注：本基金的基金合同生效日为 2006 年 9 月 29 日。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和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）清算备付金及其应计利息；
- （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）其他投资及其估值调整；
- （九）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

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

## 四、基金财产的保管和处分

（一）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

（二）基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

（三）基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

（四）基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

（五）基金管理人、基金托管人可以按基金合同的规定，收取管理费、托管费及其他费用。

（六）除法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

# 第十二部分 基金资产的估值

## 一、估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

## 二、估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

## 三、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

## 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，基金管理公司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

### 1、股票估值方法

#### （1）上市流通股票的估值

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

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；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。

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的情况下，按成本估值。

#### （3）有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

### 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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。

(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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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) 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的情况下，按成本估值。

(4) 在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。

(5) 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。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值：

#### (1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

#### (2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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。未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### 4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-4 项规定的方法对基金财产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人具有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可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的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 六、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《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签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。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、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、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；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

## 八、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。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并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

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。

## 九、估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

## 十、特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第五款有关估值方法规定的第（五）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。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

注：根据中国证监会证监会计字[2006]23 号《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》和 2007 年 9 月 29 日《国泰基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告》更新了以上基金资产估值部分的内容。

## 第十三部分 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、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基金收益。

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。

### 二、基金收益分配原则

（一）基金收益分配采用现金方式，投资者可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

（二）每一基金份额享有同等分配权；

（三）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

（四）基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

（五）如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

（六）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少 1 次，至多 6 次；

（七）全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%，基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

（八）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。



#### 四、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 五、收益分配中发生的费用

（一）收益分配采用红利再投资方式时免收再投资的费用。

（二）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日的基金份额净值转为基金份额。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- （一）基金管理人的管理费；
- （二）基金托管人的托管费；
- （三）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）；
- （四）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （五）基金份额持有人大会费用；
- （六）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- （七）基金的资金汇划费用；
- （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。

### 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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

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

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

- （二）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（三）本部分第一条（一）款至（八）款费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### 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。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

（一）基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

（二）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

（三）会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。

（四）本基金独立建账、独立核算。

（五）本基金会计责任人为基金管理人。

（六）基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期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）基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

（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同意，并报中国证监会备案；

（三）基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意。基金管理人应在更换会计师事务所后按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

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。

### 一、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，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、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各自公司网站上。

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。

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媒介上。

### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

### （四）基金净值信息公告

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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，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）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

1、基金年度报告：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。

2、基金中期报告：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。

3、基金季度报告：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。

基金合同生效不足两个月的，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。

#### （六）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两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、基金开始办理申购、赎回；
- 18、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、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、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、基金份额上市交易；

22、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；

23、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基金合同和中国证监会规定的其它事项。

#### （七）公开澄清

在基金合同期限内，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。

#### （八）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并制作清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## 二、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公司住所，供社会公众查阅、复制。

# 第十七部分 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：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

## 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。具体请参见相关公告。

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。

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（含存托凭证）的投资比例占基金资产的 35%-95%，债券以及包括权证和资产支持证券在内的其他证券资产占基金资产的 0-60%。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

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接受全额赎回或部分延期赎回。

1、接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当

日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

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、接受全额赎回”或“2、部分延期赎回”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，但不得超过二十个工作日，并应当在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

本基金作为混合型的基金，在投资理念上以价值投资为出发点，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大类资产配置，降低系统性风险。

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。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

### 六、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布的《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准，将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

## 第十八部分 基金合同的终止与基金财产的清算

### 一、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）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

（四）本基金基金合同生效后的存续期间，连续六十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人有权根据法律法规及本基金合同规定的程序，选择终止本基金，并报中国证监会备案。法律法规另有规定的，按其规定办理；

（五）法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

## 二、基金财产的清算

### （一）基金财产清算小组

自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

### （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、期货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、基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2、基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3、基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4、对基金财产进行评估和变现；
- 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。

## 三、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。

#### 四、基金财产清算剩余资产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- （一）支付清算费用；
- （二）交纳所欠税款；
- （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。

#### 五、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 六、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。

## 第十九部分 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，办理基金备案手续；
- （2）自本基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- （5）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- （6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择、更换适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(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并确定有关费率；

(16) 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；

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人履行如下义务

(1) 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。

(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) 办理基金备案手续；

(4) 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；

(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) 按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基金收益

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

- (12) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 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；
- (14) 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以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 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；
- (17) 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；
- (18) 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；
- (19) 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；
- (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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利义务

### 1、托管人享有如下权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定，自基金合同生效之日起，安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 按规定取得基金份额持有人名册；
- (7) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 2、托管人履行如下义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 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；
- (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

- (8) 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；
- (9) 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应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 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；
- (16) 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；
- (17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### （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) 依法转让或者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、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) 遵守法律法规及基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

- (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其他基金份额持有人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

（一）本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。

（二）除基金合同另有约定外，有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会程序；
- 8、本基金与其它基金合并；
- 9、法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、在法律法规和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、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、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；
- 6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式：

- 1、除法律法规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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，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，并至少提前三十日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

#### （五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在中国证监会指定的信息披露媒介公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、权益登记日；

6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

#### （六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本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益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2、召集人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代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；
- 4、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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；
- 5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

#### （七）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上（含 10%）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。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人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进行解释和说明。

2) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）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，未获得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，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

（5）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。

##### 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

#### （八）表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### （1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

##### （2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当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，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

#### （九）计票

##### 1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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推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（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）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推举三名基金份额持有人担任监票人。

（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）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

## （十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五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。

2、关于基金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等事项的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行。

3、生效的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、基金托管人均有法律约束力。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定。

4、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后两日内，由基金份额持有人大会召集人在中国证监会指定的信息披露媒介公告。

## 三、基金合同的变更与终止

### （一）基金合同的变更

1、除基金合同另有约定外，以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略；
- （7）变更基金份额持有人大会程序；
- （8）本基金与其它基金合并；
- （9）法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，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，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利时，可以留置基金资产或者对基金资产的权利归属人提出请求。

### 四、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### 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 1 式 6 份，除上报有关监管机构 1 式 2 份外，基金管理人、基金托管人各持有 2 份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资者查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

鉴于《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管协议》签署于中国银行股份有限公司成立之前，以下内容以原签署的文本为准。

### 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：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；居民储蓄业务；外汇存款；外汇汇款；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

## 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的业务监督、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，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督；

（2）对基金投融资比例进行监督；

（3）对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

(4) 基金管理人应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交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。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；

(5) 基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按约定进行监督。

(6) 基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

(7) 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

2、基金托管人应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。

3、基金托管人在上述第(1)、(2)项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及基金合同的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应当拒绝执行，并立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

4、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

5、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，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，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

## （二）基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金

合同》、本托管协议及其他有关规定时，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对基金管理人发出回函并改正。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

### 三、基金资产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或除法律法规、基金合同及本协议另有规定外，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金合同生效前募集资金的验证和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

#### （三）基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- 3、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其他任何银行账户；亦不得使用基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币结算银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。



#### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### （五）基金证券账户和资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本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另一方同意擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内邮寄一份正本的原件给基金托管人保管。除本协议另有规定外，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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

### 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财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、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在当日盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在当日盖章后以传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人，由基金管理人对外公布。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。

3、当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误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。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的相应责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、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。但基金管理人和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。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

### （二）基金会计核算

#### 1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在本基金基金合同生效后,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、登记和保管基金的全套账册,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,应以基金管理人的处理方法为准。

## 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符,双方应及时查明原因并纠正。

## 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

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,应于每月终了后 5 个工作日内完成;《基金合同》生效后,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,更新招募说明书并登载在指定网站上。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招募说明书和基金产品资料概要。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。基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日,将报表盖章后提供给基金托管人复核;基金托管人在收到后应立即进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在季度报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在中期报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 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。基金管理人应在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认,双方各自留存一份。如果基金管理人于基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致,基金

管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。基金合同

## 五、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册
- 4、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

对于每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每月结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

### （三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的合理费用给予补偿。

## 六、适用法律与争议解决

### （一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

### （三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。基金合同

## 七、托管协议的修改和终止

### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议，应当报中国证监会核准。

### （二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金或基金合同终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十一部分 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。

## 第二十二部分 其他应披露的事项

| 公告名称                                                     | 披露媒介                          | 日期         |
|----------------------------------------------------------|-------------------------------|------------|
| 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  |
| 国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告                                     | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/6/1   |
| 国泰基金管理有限公司关于设立深圳市分公司的公告                                  | 《中国证券报》                       | 2019/6/19  |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告                     | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/6/22  |
| 国泰基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司销售旗下部分基金并开通定期定额投资计划、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》 | 2019/7/19  |
| 国泰基金管理有限公司关于调整直销电子交易平台中国农业银行股份有限公司支付渠道申购（含定投）费率优惠折扣的公告   | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/7/30  |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通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》 | 2019/8/19  |
| 国泰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金账户分红方式规则的公告                         | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/8/24  |
| 国泰基金管理有限公司关于东北证券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计划、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》 | 2019/11/25 |
| 国泰基金管理有限公司关于提醒个人投资者及时完善、更新身份信息、资料以免影响业务办理的公告             | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/11/28 |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司“2020 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》 | 2019/12/27 |
| 关于国泰基金管理有限公司修订旗下 120 只基金基金合同及托管协议的公告                     | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》 | 2019/12/31 |
| 国泰基金旗下基金在 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告           | 《中国证券报》                       | 2020/1/29  |
| 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》                       | 2020/2/15  |
| 国泰基金管理有限公司关于西藏东方财富证券股份有限公司新增销售旗下部分基金并开通转换业务的公告           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》 | 2020/3/5   |
| 国泰基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示                           | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》 | 2020/3/17  |

|                                         |         |            |
|-----------------------------------------|---------|------------|
| 国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法份子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告 | 公司官网    | 2020/4/4   |
| 国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法份子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告 | 公司官网    | 2020/5/20  |
| 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金经理变更公告               | 《上海证券报》 | 2020/9/26  |
| 国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告           | 《中国证券报》 | 2020/10/14 |
| 国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金经理变更公告               | 《上海证券报》 | 2020/10/17 |

## 第二十三部分 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。

## 第二十四部分 备查文件

- 一、中国证监会批准国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金托管协议》
- 四、关于申请募集国泰金鹏蓝筹价值混合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

二〇二〇年十一月十九日