

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书摘要 (2016 年第一号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】364 号文）核准募集，于 2013 年 7 月 12 日至 2013 年 8 月 8 日公开募集，募集结束后本基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 12 日生效。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金的保本期最长为每 3 年一个周期，在每一个保本期内均设置该保本期的目标收益率，在运作期间，如基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日达到或超过预设目标收益率，则国泰目标收益保本混合型证券投资基金当期保本期提前到期。国泰目标收益保本混合型证券投资基金第一个保本期的目标收益率为 15%。自 2014 年 11 月 24 日起至 2014 年 12 月 12 日止国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日超过 15%，即国泰目标收益保本混合型证券投资基金已于 2014 年 12 月 12 日触发第一个保本期提前到期的条件。依据国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同的约定，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的第一个保本期提前到期并进入过渡期。过渡期结束后的下一日起，由于不再符合保本基金存续条件，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书报中国证监会备案，但并不表明中国证监会对本基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能

力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人及基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 1 月 16 日，投资组合报告为 2015 年 4 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

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

成立时间：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：唐建光

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：何晔

联系电话：(021) 31089000, 4008888688

股本结构：

| 股东名称 | 股权比例 |
|--------------|------|
| 中国建银投资有限责任公司 | 60% |
| 意大利忠利集团 | 30% |
| 中国电力财务有限公司 | 10% |

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2016 年 1 月 16 日，本基金管理人共管理 58 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证

券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

（三）主要人员情况

1、董事会成员

唐建光，董事长，大学本科，高级工程师。1982 年 1 月至 1988 年 10 月在煤炭工业部基建司任工程师；1988 年 10 月至 1993 年 7 月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993 年 7 月至 1995 年 9 月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长；1995 年 9 月至 1998 年 10 月在煤炭部基建管理中心工作，先后任综合处处长、中心副主任；1998 年 10 月至 2005 年 1 月在中国建设银行资产保全部任副总经理；2005 年 1 月起在中国建银投资有限责任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010 年 11 月至 2014 年 10 月任国泰基金管理有限公司监事会主席，2014 年 8 月起任公司党委书记，2015 年 8 月起任公司董事长、法定代表人。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006 年 7 月起在中国建银投有限责任公司工作，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，现任战略发展部处长。2014 年 5

月起任公司董事。

陈川，董事，博士研究生，经济师。2001年7月至2005年8月，在中国建设银行总行工作，历任中间业务部、投资银行部、公司业务部业务副经理、业务经理。2005年8月至2007年6月，在中国建银投资有限责任公司工作，历任投资银行部、委托代理业务部业务经理、高级副经理。2007年6月至2008年5月，在中投证券资本市场部担任执行总经理。2008年5月至2012年6月，在中国建银投资有限责任公司工作，历任投资银行部高级经理、投资部高级经理、企业管理部高级经理。2012年6月至2012年9月，任建投科信科技股份有限公司副总经理。2012年9月至2013年4月，任中建投租赁有限责任公司纪委书记、副总经理。2013年4月至2014年1月，任中国建银投资有限责任公司长期股权投资部总经理。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部业务总监。2014年5月起任公司董事。

Santo Borsellino，董事，硕士研究生。1994-1995年在BANK OF ITALY负责经济研究；1995年在UNIVERSITY OF BOLOGNA任金融部助理，1995-1997年在ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP – SOFIPA SpA任金融分析师；1999-2004年在LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL任股票保险研究员；2004-2005年任URWICK CAPITAL LLP合伙人；2005-2006年在CREDIT SUISSE任副总裁；2006-2008年在EURIZONCAPITAL SGR SpA历任研究员/基金经理。2009-2013年任GENERALI INVESTMENTS EUROPE权益部总监。2013年6月起任GENERALI INVESTMENTS EUROPE总经理。2013年11月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员（FCII）及英国特许保险师（Chartered Insurer）。1989年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994年起任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002年起任中意人寿保险有限公司董事。2007年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。2010年6月起任公司董事。

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。1994年3月至2002年2月在中国电力信托投资有限公司工作，历任经理部项目经理，证券部项目经理，北京证券营业部副经理，天津证券营业部副经理、经理。2002年2月起在中国电力财务有限公司工作，先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记，现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。2012年4月起任公司董事。

张峰，董事，硕士研究生，16年证券从业经历。1987年7月至1999年3月就职于国家计划委员会，历任产业经济研究所科员、政研室经济分析处副处长、财金司综合处处长。1999年3月至2001年7月在嘉实基金管理有限公司工作，任研究部副总监、市场部总监。2001年

7月至2002年4月在中保集团资产管理公司，任总经理助理。2002年4月至2015年4月在嘉实基金管理有限公司工作，历任督察长、副总经理兼首席市场官。2015年5月加入国泰基金管理有限公司，2015年8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，兼任全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2013年起兼任金诚信矿业管理股份有限公司（目前已上市）独立董事，2015年5月起兼任北京采安律师事务所兼职律师。2010年6月起任公司独立董事。

刘秉升，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记；1982年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长；1985年起任吉林省抚松县委常委、常务副县长；1989年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记；1995年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记；1998年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007年任海南省银行业协会会长。2010年11月起任公司独立董事。

韩少华，独立董事，大学专科，高级会计师。1964年起在中国建设银行河南省工作，历任河南省分行副处长、处长；南阳市分行行长、党组书记；分行总会计师。2003年至2008年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010年11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年起在工商银行河北省工作，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。

2、监事会成员

梁凤玉，监事会主席，硕士研究生，高级会计师。1994年8月至2006年6月，先后建设银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作，任业务经理、副行长、副总经理等职。2006年7月至2007年3月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007年4月至2008年2月在中国投资咨询公司任财务总监。2008年3月至2012年8月在中国建银投

资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012 年 9 月至 2014 年 8 月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014 年 12 月起任公司监事会主席。

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

刘顺君, 监事, 硕士研究生, 高级经济师。1986 年 7 月至 2000 年 3 月在中国人民解放军军事经济学院工作, 历任教员、副主任。2000 年 4 月至 2003 年 1 月在长江证券有限责任公司工作, 历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003 年 1 月至 2005 年 5 月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005 年 6 月起在中国电力财务有限公司工作, 先后任金融租赁公司筹建处综合部主任, 营业管理部主任助理, 华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席, 福建业务部副主任、主任, 现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012 年 4 月起任公司监事。

李辉, 监事, 大学本科。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。现任公司总经理助理、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人。2013 年 11 月起任公司职工监事。

束琴, 监事, 大专学历。1980 年 3 月至 1992 年 3 月分别任职于人民银行安康地区分行和工商银行安康地区分行, 1993 年 3 月至 2008 年 8 月任职于陕西省住房资金管理中心。2008 年 8 月加入国泰基金管理有限公司, 先后担任行政管理部主管、总监助理。现任公司行政部副总监。2013 年 11 月起任公司职工监事。

邓时锋, 监事, 硕士研究生。曾任职于天同证券。2001 年 9 月加盟国泰基金管理有限公司, 历任行业研究员、社保 111 组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理, 2008 年 4 月起任国泰金鼎价值精选证券投资基金的基金经理, 2009 年 5 月起兼任国泰区位优势混合型证券投资基金（原国泰区位优势股票型证券投资基金）的基金经理, 2013 年 9 月至 2015 年 3 月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）的基金经理。2015 年 8

月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

唐建光，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

张峰，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，22 年证券基金从业经历。1993 年 4 月至 1998 年 4 月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998 年 4 月至 2007 年 11 月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。2007 年 12 月加入国泰基金管理有限公司，2008 年 12 月起担任公司副总经理，2015 年 8 月 31 日起代任公司督察长。

周向勇，硕士研究生，19 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 月起任公司副总经理。

陈星德，博士，13 年证券基金从业经历。曾就职于江苏省人大常委会、中国证券监督管理委员会、瑞士银行环球资产管理香港公司和国投瑞银基金管理有限公司。2009 年 1 月至 2015 年 11 月就职于上投摩根基金管理有限公司，历任督察长、副总经理。2015 年 12 月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

4、本基金的基金经理

（1）现任基金经理

邱晓华，硕士研究生，15 年证券基金从业经历。曾任职于新华通讯社、北京首都国际投资管理有限公司、银河证券。2007 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。2011 年 4 月至 2014 年 6 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011 年 6 月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2013 年 8 月至 2015 年 1 月 15 日兼任国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 5 月起兼任国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 11 月至 2015 年 12 月兼任国泰大宗商品配置证券投资基金 (LOF) 的基金经理；2015 年 1 月 16 日起兼任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（原国泰目标收益保本混合型证券投资基金）的基金经理；2015 年 4 月起兼任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月起任国泰新目标收益保本混合型

证券投资基金和国泰鑫保本混合型证券投资基金的基金经理。

（2）历任基金经理

本基金自转型之日（2015 年 1 月 16 日）起至 2015 年 7 月 16 日由邱晓华、姜南林共同担任基金经理；自 2015 年 7 月 17 日至今由邱晓华担任本基金的基金经理。

5、本基金投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

张峰：总经理、董事

委员：

周向勇：副总经理

黄焱：总经理助理兼投资总监兼权益投资（事业）部总经理

吴晨：绝对收益投资（事业）部副总监

张则斌：权益投资总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码939），于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码601939）。

2015年6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%。净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个、综合柜员占比达到84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中

继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工210余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年末，中国建设银行已托管556只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中

国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------------|--|-------------------|
| 1 | 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 | 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 智能手机 APP 平台：iphone 交易客户端、Android 交易客户端 “国泰基金”微信交易平台 | |
| | | 电话：021-31081738 | 联系人：李静姝 |

2、其它销售机构

（1）销售银行及券商

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------------|----------------------------|-----------------|
| 1 | 中国农业银行股 份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 | |
| | | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 | |
| | | 法定代表人：刘士余 | 客户服务电话：95599 |
| | | 联系人：客户服务中心 | 传真：010-85109219 |
| | | 网址：www.95599.cn | |
| 2 | 中国银行股 份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 | |
| | | 法定代表人：田国立 | 联系人：客户服务中心 |
| | | 客服电话：95566 | 网址：www.boc.cn |
| 3 | 中国建设银行股 份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号 | |
| | | 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 | |
| | | 法定代表人：王洪章 | 客服电话：95533 |
| | | 网址：www.ccb.com | |
| 4 | 交通银行股份有 限公司 | 注册地址：上海市银城中路 188 号 | |
| | | 法定代表人：牛锡明 | 客服电话：95559 |

| | | | |
|----|----------------|---------------------------------|-----------------------|
| | | 联系人：张宏革 | 电话：021-58781234 |
| | | 网址：www.bankcomm.com | |
| 5 | 招商银行股份有限公司 | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| | | 法定代表人：傅育宁 | 联系人：邓炯鹏 |
| | | 电话：0755-83198888 | 传真：0755-83195109 |
| | | 客户服务热线：95555 | 网址：www.cmbchina.com |
| 6 | 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 | |
| | | 法定代表人：胡平西 | 联系人：吴海平 |
| | | 电话：021-38576977 | 传真：021-50105124 |
| | | 客服电话：021-962999 | 网址：www.srcb.com |
| 7 | 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 | |
| | | 法定代表人：吴太普 | 联系人：严峻 |
| | | 电话：0571-85163127 | 传真：0571-85179591 |
| | | 客服电话：400-888-8508 | 网址：www.hzbank.com.cn |
| 8 | 渤海银行股份有限公司 | 注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号 | |
| | | 法定代表人：刘宝凤 | 联系人：王宏 |
| | | 电话：022-58316666 | 传真：022-58316259 |
| | | 客服电话：400-888-8811 | 网址：www.cbhb.com.cn |
| 9 | 深圳农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 | |
| | | 法定代表人：李伟 | 联系人：王璇 宋永成 |
| | | 电话：0755-25188269 | 传真：0755-25188785 |
| | | 客服电话：4001961200 | 网址：www.4001961200.com |
| 10 | 大连银行股份有限公司 | 注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼 | |
| | | 法定代表人：陈占维 | 联系人：李鹏 |
| | | 电话：0411-82308602 | 传真：0411-82311420 |
| | | 客服电话：400-664-0099 | 网址：www.bankofd1.com |
| 11 | 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 | |
| | | 法定代表人：郭志文 | 联系人：武艳凤 |
| | | 电话：0451-86779018 | 传真：0451-86779218 |
| | | 客服电话：95537、400-60-95537 | |

| | | | |
|----|----------------|--|--|
| | | 网址: http://www.hrbcb.com.cn | |
| 12 | 东莞农村商业银行股份有限公司 | 注册地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 | |
| | | 法定代表人: 何沛良 | 联系人: 何茂才 |
| | | 电话: 0769-22866255 | 电话: 0769-22866255 |
| | | 客服电话: 0769-961122 | 网址: www.drcbank.com |
| 13 | 国泰君安证券股份有限公司 | 注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号 | |
| | | 法定代表人: 万建华 | 联系人: 芮敏祺 |
| | | 电话: 021-38676161 | 传真: 021-38670161 |
| | | 客服电话: 400-888-8666 | 网址: www.gtja.com |
| 14 | 中信建投证券股份有限公司 | 注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 | |
| | | 法定代表人: 王常青 | 联系人: 魏明 |
| | | 电话: 010-85130588 | 传真: 010-65182261 |
| | | 客服电话: 400-888-8108 | 网址: www.csc108.com |
| 15 | 国信证券股份有限公司 | 注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼 | |
| | | 法定代表人: 何如 | 联系人: 齐晓燕 |
| | | 电话: 0755-82130833 | 传真: 0755-82133952 |
| | | 客服电话: 95536 | 网址: www.guosen.com.cn |
| 16 | 招商证券股份有限公司 | 注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层 | |
| | | 法定代表人: 宫少林 | 联系人: 林生迎 |
| | | 电话: 0755-82943666 | 传真: 0755-82943636 |
| | | 网址: www.newone.com.cn | |
| | | 客服电话: 400-888-8111/95565 | |
| 17 | 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 号国际企业大厦 C 座 | |
| | | 法定代表人: 陈有安 | 联系人: 田薇 |
| | | 电话: 010-66568430 | 传真: 010-66568990 |
| | | 客服电话: 400-8888-888 | |
| | | 网址: www.chinastock.com.cn | |
| 18 | 海通证券股份有限公司 | 注册地址: 上海市淮海中路 98 号 | |
| | | 法定代表人: 王开国 | 联系人: 李笑鸣 |
| | | 电话: 021-23219000 | 传真: 021-23219100 |

| | | | |
|----|------------|--|----------------------|
| | | 客服电话：400-888-8001（全国），021-95553 | |
| | | 网址：www.htsec.com | |
| 19 | 申万宏源证券有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 | |
| | | 法定代表人：李梅 | 联系人：黄莹 |
| | | 电话：021-33388211 | 客服电话：4008895523 |
| | | 网址：www.swhysc.com | |
| 20 | 万联证券有限责任公司 | 注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层 | |
| | | 法定代表人：张建军 | 联系人：罗创斌 |
| | | 电话：020-38286651 | 传真：020-22373718-1013 |
| | | 客服电话：400-888-8133 | 网址：www.wlzq.com.cn |
| 21 | 东吴证券股份有限公司 | 注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层 | |
| | | 法定代表人：吴永敏 | 联系人：方晓丹 |
| | | 电话：0512-65581136 | 传真：0512-65588021 |
| | | 客服电话：0512-33396288 | 网址：www.dwzq.com.cn |
| 22 | 上海证券有限责任公司 | 注册地址：上海市西藏中路336号 | |
| | | 法定代表人：郁忠民 | 联系人：张瑾 |
| | | 电话：021-53519888 | 传真：021-53519888 |
| | | 客服电话：021-962518 | 网址：www.962518.com |
| 23 | 国盛证券有限责任公司 | 注册地址：江西省南昌市永叔路15号 | |
| | | 办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼 | |
| | | 法定代表人：曾小普 | 联系人：徐美云 |
| | | 电话：0791-6285337 | 传真：0791-6288690 |
| | | 网址：www.gsstock.com | |
| 24 | 光大证券股份有限公司 | 注册地址：上海市静安区新闻路1508号 | |
| | | 法定代表人：薛峰 | 联系人：刘晨 |
| | | 电话：021-22169999 | 传真：021-22169134 |
| | | 客服电话：95525、10108998、400-888-8788 | |
| | | 网址：www.ebscn.com | |
| 25 | 广发证券股份有限公司 | 注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房） | |

| | | | |
|----|------------------|---|--------------------|
| | | 办公地址：广东省广州天河区北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼 | |
| | | 法定代表人：孙树明 | 联系人：黄岚 |
| | | 电话：020-87555888 | 传真：020-87555305 |
| | | 客服电话：95575 | 网址：www.gf.com.cn |
| 26 | 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 | |
| | | 法定代表人：王东明 | 联系人：陈忠 |
| | | 电话：010-84588888 | 传真：010-84865560 |
| | | 网址：www.cs.ecitic.com | |
| 27 | 渤海证券股份有 限公司 | 注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 | |
| | | 办公地址：天津市河西区宾水道 8 号 | |
| | | 法定代表人：杜庆平 | 联系人：王兆权 |
| | | 电话：022-28451861 | 传真：022-28451892 |
| | | 客服电话：400-651-5988 | 网址：www.bhzq.com |
| 28 | 中信万通证券有 限责任公司 | 注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室 | |
| | | 办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061） | |
| | | 法定代表人：杨宝林 | 联系人：吴忠超 |
| | | 电话：0532-85022326 | 传真：0532-85022605 |
| | | 客服电话：0532-96577 | 网址：www.zxwt.com.cn |
| 29 | 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 | |
| | | 法定代表人：胡运钊 | 联系人：李良 |
| | | 电话：027-65799999 | 传真：027-85481900 |
| | | 客服电话：95579 | 网址：www.95579.com |
| 30 | 国海证券股份有 限公司 | 注册地址：广西桂林市辅星路 13 号 | |
| | | 法定代表人：张雅锋 | 联系人：牛孟宇 |
| | | 电话：0755-83709350 | 传真：0755-83704850 |
| | | 客服电话：95563 | 网址：www.ghzq.com.cn |
| 31 | 中泰证券有限公 司 | 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | |
| | | 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | |

| | | | |
|----|------------------|---|----------------------|
| | | 法定代表人：李玮 | 联系人：吴阳 |
| | | 电话：0531-68889155 | 传真：0531-68889185 |
| | | 客服电话：95538 | 网址：www.qlzq.com.cn |
| 32 | 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 | |
| | | 法定代表人：牛冠兴 | 联系人：陈剑虹 |
| | | 联系电话：0755-82825551 | 传真：0755-82558355 |
| | | 客服电话：400-800-1001 | |
| | | 网址：www.essence.com.cn | |
| 33 | 东莞证券有限责 任公司 | 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 | |
| | | 法定代表人：游锦辉 | 联系人：梁健伟 |
| | | 电话：0769-22119341 | 传真：0769-22116999 |
| | | 客服电话：0769-961130 | 网址：www.dgzq.com.cn |
| 34 | 中国中投证券有 限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元 | |
| | | 法定代表人：龙增来 | 联系人：刘毅 |
| | | 电话：0755-82023442 | 传真：0755-82026539 |
| | | 网址：www.china-invs.cn | |
| | | 客服电话：400-600-8008、95532 | |
| 35 | 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 | |
| | | 法定代表人：王勇 | 联系人：赵钦 |
| | | 电话：0592-5161642 | 传真：0592-5161140 |
| | | 客服电话：0592-5163588 | 网址：www.xmzq.cn |
| 36 | 华宝证券有限责 任公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层 | |
| | | 法定代表人：陈林 | 联系人：刘闻川 |
| | | 电话：021-68778081 | 传真 021-68778117 |
| | | 客服电话：400-820-9898 | 网址：www.cnhbstock.com |
| 37 | 中国国际金融有 限公司 | 注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 | |
| | | 法定代表人：李剑阁 | 联系人：罗文雯 |
| | | 电话：010-65051166 | 传真：010-65051156 |

| | | | |
|----|------------|---|----------------------|
| | | 网址: www.cicc.com.cn | |
| 38 | 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 | |
| | | 法定代表人: 林义相 | 联系人: 林爽 |
| | | 电话: 010-66045608 | 传真: 010-66045527 |
| | | 客服电话: 010-66045678 | 网址: www.txsec.com |
| 39 | 信达证券股份有限公司 | 注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 | |
| | | 法定代表人: 高冠江 | 联系人: 唐静 |
| | | 电话: 010-88656100 | 传真: 010-88656290 |
| | | 客服电话: 400-800-8899 | 网址: www.cindasc.com |
| 40 | 华龙证券有限责任公司 | 注册地址: 甘肃省兰州市静宁路 308 号 | |
| | | 法定代表人: 李晓安 | 联系人: 李昕田 |
| | | 电话: 0931-8888088 | 传真: 0931-4890515 |
| | | 客服电话: 0931-4890100、4890619、4890618 | |
| | | 网址: www.hlzqgs.com | |
| 41 | 国元证券股份有限公司 | 注册地址: 安徽省合肥市寿春路 179 号 | |
| | | 法定代表人: 凤良志 | 联系人: 祝丽萍 |
| | | 电话: 0551-2257012 | 传真: 0551-2272100 |
| | | 客服电话: 95578 | 网址: www.gyzq.com.cn |
| 42 | 西部证券股份有限公司 | 注册地址: 陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼 | |
| | | 法定代表人: 刘建武 | 联系人: 冯萍 |
| | | 电话: 029-87406488 | 传真: 029-87406387 |
| | | 客服电话: 95582 | 网址: www.westsecu.com |
| 43 | 平安证券有限责任公司 | 注册地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 | |
| | | 法定代表人: 杨宇翔 | 联系人: 郑舒丽 |
| | | 电话: 0755-22626391 | 传真: 0755-82400862 |
| | | 客服电话: 95511-8 | 网址: www.pingan.com |
| 44 | 中航证券有限公司 | 注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 | |
| | | 法定代表人: 杜航 | 联系人: 戴蕾 |
| | | 电话: 0791-86768681 | 传真: 0791-86770178 |
| | | 客服电话: 400-8866-567 | 网址: www.avicsec.com |

| | | | |
|----|----------------|---|-----------------------|
| 45 | 东海证券股份有 限公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层 | |
| | | 法定代表人：刘化军 | 联系人：李涛 |
| | | 电话：0519-88157761 | 传真：0519-88157761 |
| | | 客服电话：400-888-8588 | 网址：www.longone.com.cn |
| 46 | 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 | |
| | | 法定代表人：侯巍 | 联系人：郭熠 |
| | | 电话：0351-8686659 | 传真：0351-8686619 |
| | | 客服电话：400-666-1618、95573 | |
| | | 网址：www.i618.com.cn | |
| 47 | 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 | |
| | | 法定代表人：宋德清 | 联系人：黄恒 |
| | | 电话：010-58568235 | 传真：010-58568062 |
| | | 客服电话：010-58568118 | 网址：www.hrsec.com.cn |
| 48 | 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 | |
| | | 法定代表人：孙名扬 | 联系人：张宇宏 |
| | | 电话：0451-82336863 | 传真：0451-82287211 |
| | | 客服电话：400-666-2288 | 网址：www.jhzq.com.cn |
| 49 | 广州证券有限责 任公司 | 注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 | |
| | | 法定代表人：刘东 | 联系人：林洁茹 |
| | | 电话：020-88836655 | 传真：020-88836654 |
| | | 客服电话：020-961303 | 网址：www.gzs.com.cn |
| 50 | 西南证券股份有 限公司 | 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号 | |
| | | 法定代表人：余维佳 | 联系人：张煜 |
| | | 电话：023-63786141 | 传真：023-63786212 |
| | | 网址：http://www.swsc.com.cn | |
| 51 | 国都证券有限责 任公司 | 注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 | |
| | | 法定代表人：常喆 | 联系人：黄静 |
| | | 电话：010-84183333 | 传真：010-84183311-3389 |
| | | 客服电话：4008188118 | 网址：www.guodu.com |

| | | | |
|----|------------------|---|--------------------|
| 52 | 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 号财智中心 B1 座 | |
| | | 法定代表人：李工 | 联系人：汪燕 |
| | | 电话：0551-65161675 | 传真：0551-65161600 |
| | | 客服电话：4008096518 | 网址：www.huaan.com |
| 53 | 华鑫证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元 | |
| | | 法定代表人：俞洋 | 联系人：王逍 |
| | | 电话：021-64339000 | 传真：021-54668802 |
| | | 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918 | |
| | | 网址：www.cfsc.com.cn | |
| 54 | 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 | |
| | | 法定代表：张晨 | 联系人：仇侃宁 |
| | | 电话：0571-87923225 | 传真：0571-87923214 |
| | | 客服电话：96592 | 网址：www.urcb.com |
| 55 | 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 | |
| | | 法定代表：颜廷军 | 联系人：周淑贞 |
| | | 电话：0536-5293756 | 传真：0536-5293756 |
| | | 客服电话：0536-96633 | |
| 56 | 晋商银行股份有限公司 | 注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座 | |
| | | 法定代表：上官永清 | |
| | | 客服电话：95105588 | 网址：www.jshbank.com |
| 57 | 浙商银行股份有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号 | |
| | | 法定代表人：张达洋 | |
| | | 客服电话：95527 | |
| | | 网址：http://www.czbank.com | |
| 58 | 张家港农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：张家港市人民中路 66 号 | |
| | | 法定代表：王自忠 | 联系人：朱芳 |
| | | 电话：0512-96065 | 客服电话：0512-96065 |
| | | 传真：051256968259 | |

| | | | |
|----|----------------|---|-------------------|
| | | 网址: http://www.zrcbank.com | |
| 59 | 苏州银行股份有 限公司 | 注册地址: 江苏省苏州工业园区钟园路 728 号 | |
| | | 法定代表人: 王兰凤 | |
| | | 电话: 0512-69868390 | 传真: 0512-69868370 |
| | | 客服电话: 0512-96067 | |
| | | 网址: www.suzhoubank.com | |

(2) 第三方销售机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 | |
|----|------------------------------|---|--|
| 1 | 诺亚正行(上海) 基金销售投资顾问 有限公司 | 注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室 | |
| | | 法定代表人: 汪静波 | 联系人: 方成 |
| | | 电话: 021-38602377 | 传真: 021-38509777 |
| | | 客服电话: 4008215399 | 网址: www.noah-fund.com |
| 2 | 上海好买基金销售 有限公司 | 注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室 | |
| | | 法定代表人: 杨文斌 | 联系人: 薛年 |
| | | 电话: 021-20613999 | 传真: 021-68596916 |
| | | 客服电话: 400-700-9665 | 网址: www.ehowbuy.com |
| 3 | 杭州数米基金销售 有限公司 | 注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号 | |
| | | 法定代表人: 陈柏青 | 联系人: 周嫵旻 |
| | | 电话: 0571-28829790 | 传真: 0571-26698533 |
| | | 客服电话: 4000-766-123 | 网址: www.fund123.cn |
| 4 | 深圳众禄基金销售 有限公司 | 注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 | |
| | | 法定代表人: 薛峰 | 联系人: 童彩平 |
| | | 电话: 0755-33227950 | 传真: 0755-82080798 |
| | | 客服电话: 4006-788-887 | |
| | | 网址: www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com | |
| 5 | 上海长量基金销售 投资顾问有限公司 | 注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 | |
| | | 法定代表人: 张跃伟 | 联系人: 敖玲 |
| | | 电话: 021-58788678-8201 | 传真: 021-58787698 |
| | | 客服电话: 400-089-1289 | 网址: www.erichfund.com |

| | | | |
|----|------------------|---------------------------------------|-----------------------|
| 6 | 北京展恒基金销售有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 | |
| | | 法定代表人：闫振杰 | 联系人：焦琳 |
| | | 电话：010-62020088-8288 | 传真：010-62020088-8802 |
| | | 客服电话：4008886661 | |
| | | 网址：www.myfund.com | |
| 7 | 浙江同花顺基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 | |
| | | 法定代表人：凌顺平 | 联系人：杨翼 |
| | | 电话：0571-88911818-8565 | 传真：0571-86800423 |
| | | 客服电话：4008-773-776 0571-88920897 | 网址：www.5ifund.com |
| | | | |
| 8 | 江苏金百临投资咨询有限公司 | 注册地址：无锡市滨湖区锦溪路 99 号 | |
| | | 法定代表：费晓燕 | 联系人：袁丽萍 |
| | | 电话：0510-82758877 | 传真：0510-88555858 |
| | | 客服电话：0510-9688988 | 网址：www.jsjbl.com |
| 9 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 | |
| | | 法定代表：其实 | 联系人：朱钰 |
| | | 电话：021-54509988-1071 | 传真：021-64383798 |
| | | 客服电话：4001818188 | 网址：www.1234567.com.cn |
| 10 | 万银财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 | |
| | | 法定代表：李招弟 | 联系人：刘媛 |
| | | 电话：010-59393923 | 传真：010-59393074 |
| | | 客服电话：4008080069 | 网址：www.wy-fund.com |
| 11 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 | |
| | | 法定代表：盛大 | 联系人：叶志杰 |
| | | 电话：021-50583533 | 传真：021-50583633 |
| | | 客服电话：400-005-6355 | |
| | | 网址：www.leadfund.com.cn | |
| 12 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室 | |
| | | 法定代表：齐凌峰 | 联系人：阮志凌 |
| | | 电话：010-82151989 | 传真：010-82158830 |

| | | | |
|----|----------------------|---|----------------------|
| | | 客服电话：400-158-5050 | 网址：www.9ifund.com |
| 13 | 浙江金观诚财富管理 有限公司 | 注册地址：杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区801 | |
| | | 法定代表人：陆彬彬 | 联系人：鲁盛 |
| | | 电话：0571-56028617 | 传真：0571-56899710 |
| | | 客服电话：400-068-0058 | |
| | | 网址：www.jincheng-fund.com | |
| 14 | 嘉实财富管理有限 公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元 | |
| | | 法定代表人：赵学军 | 联系人：张倩 |
| | | 电话：021-20289890 | 客服电话：400-021-8850 |
| | | 传真：021-20280110、010-85097308 | |
| | | 网址：www.harvestwm.cn | |
| 15 | 宜信普泽投资顾问 （北京）有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 | |
| | | 法定代表人：沈伟桦 | 联系人：王巨明 |
| | | 电话：010-52858244 | 传真：010-85894285 |
| | | 客服电话：400-6099-500 | 网址：www.yixinfund.com |
| 16 | 一路财富（北京） 信息科技有限公司 | 办公地址：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208 | |
| | | 客户服务热线：400-001-1566 | |
| | | 公司网站： http://www.yilucaifu.com | |
| 17 | 上海联泰资产管理 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 | |
| | | 客户服务热线：4000-466-788 | |
| | | 公司网站： http://www.91fund.com.cn | |
| 18 | 上海汇付金融服务 有限公司 | 办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室 | |
| | | 客服电话：400-820-2819 | |
| | | 公司网站： http://a0918660.atobo.com.cn | |
| 19 | 上海陆金所资产管 理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 | |
| | | 法定代表人：郭坚 | |
| | | 客户服务电话：400-821-9031 | |
| | | 网站： www.lufunds.com | |

| | | | |
|----|-----------------------|---|------------------|
| 20 | 泰诚财富基金销售 (大连) 有限公司 | 注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号 | |
| | | 法定代表人：林卓 | |
| | | 电话：0411-88891212 | 传真：0411-84396536 |
| | | 客服电话：4006411999 | |
| | | 网址： www.taichengcaifu.com | |
| 21 | 北京乐融多源投 资咨询有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层 | |
| | | 法定代表人：董浩 | |
| | | 客户服务电话：400-068-1176 | |
| | | 网址： www.jimufund.com | |
| 22 | 北京微动利投资 管理有限公司 | 注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室 | |
| | | 法定代表人：梁洪军 | |
| | | 客户服务电话：400-819-6665 | |
| | | 网址： http://www.buyforyou.com.cn | |
| 23 | 深圳市新兰德证券 投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# | |
| | | 公司地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层 | |
| | | 客户服务电话：400-166-1188 | |
| | | 网址： http://8.jrj.com.cn/ | |
| 24 | 上海凯石财富基金 销售有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室 | |
| | | 法定代表：陈继武 | 联系人：李晓明 |
| | | 电话：021-63333319 | 传真：021-63333390 |
| | | 客服电话：4000-178-000 | |
| | | 网址： www.lingxianfund.com | |
| 25 | 深圳富济财富管理 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 | |
| | | 法定代表：齐小贺 | 联系人：马力佳 |
| | | 电话：0755-83999907-815 | 传真：0755-83999926 |
| | | 客服电话：0755-83999907 | |
| | | 网址： www.jinqianwo.cn | |

（二）登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

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：唐建光

联系人：何晔

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（五）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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

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：黄靖婷

经办注册会计师：许康玮、黄靖婷

四、基金的名称

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型和运作方式

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

六、投资目标

本基金力图通过灵活的大类资产配置，积极把握个股的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

七、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，包括国内上市交易的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

其中，股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20% 以上，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

八、投资策略

1、资产配置策略

本基金管理人依据 Melva 资产评估体系，通过考量宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关变量指标的变化，评估确定一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

2、股票投资策略

（1）盈利能力股票筛选

本基金的股票资产投资主要以具有投资价值的股票作为投资对象，采取自下而上精选个股策略，利用 ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司，构成具有盈利能力的股票备选池。

（2）价值评估分析

本基金通过价值评估分析，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票池。价值评估分析主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、股息贴现模型等，基金管理人根据不同行业特征和市场特征灵活进行运用，努力为从估值层面持有人发掘价值。

（3）实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过对上市公司的外部合作机构和相关行政管理部门进一步调研，对上述结论进行核实。

（4）投资组合建立和调整

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立和调整投资组合。在投资组合管理过程中，本基金还将注重投资品种的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

3、债券投资策略

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

4、权证投资策略

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

5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保

值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$

采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要基于以下原因：

1、沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。

2、该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。

3、沪深 300 指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关性，且指数历史表现强于市场平均收益水平。

因此，沪深 300 指数是衡量该混合型基金股票投资业绩的理想基准。同时，根据目标资产配置比例，业绩比较基准中加入了中证全债指数并按照该混合型基金的目标资产配置比例来安排。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。

十、风险收益特征

本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

十一、投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2015 年 12 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 53,701,477.98 | 74.23 |
| | 其中：股票 | 53,701,477.98 | 74.23 |
| 2 | 固定收益投资 | 14,668,079.20 | 20.27 |
| | 其中：债券 | 14,668,079.20 | 20.27 |
| | 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 | 3,241,903.99 | 4.48 |
| 7 | 其他资产 | 735,508.46 | 1.02 |
| 8 | 合计 | 72,346,969.63 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 158,843.50 | 0.23 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 35,505,219.28 | 52.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 29,621.70 | 0.04 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 418,800.00 | 0.62 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 6,656,200.00 | 9.79 |
| L | 租赁和商务服务业 | 640,000.00 | 0.94 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,823,800.00 | 4.15 |
| 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 | 3,400,033.50 | 5.00 |
| S | 综合 | 4,068,960.00 | 5.99 |
| | 合计 | 53,701,477.98 | 79.01 |

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000532 | 力合股份 | 147,000 | 4,068,960.00 | 5.99 |
| 2 | 600325 | 华发股份 | 220,000 | 3,586,000.00 | 5.28 |
| 3 | 000671 | 阳光城 | 340,000 | 3,070,200.00 | 4.52 |
| 4 | 002675 | 东诚药业 | 54,000 | 3,024,540.00 | 4.45 |
| 5 | 300097 | 智云股份 | 64,667 | 3,003,782.15 | 4.42 |
| 6 | 002551 | 尚荣医疗 | 86,478 | 2,851,179.66 | 4.20 |
| 7 | 002672 | 东江环保 | 140,000 | 2,823,800.00 | 4.15 |
| 8 | 300457 | 赢合科技 | 40,000 | 2,660,000.00 | 3.91 |
| 9 | 002436 | 兴森科技 | 135,371 | 2,605,891.75 | 3.83 |
| 10 | 000673 | 当代东方 | 69,915 | 2,440,033.50 | 3.59 |

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 14,668,079.20 | 21.58 |
| 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 | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 14,668,079.20 | 21.58 |

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019506 | 15 国债 06 | 144,330 | 14,467,639.20 | 21.29 |
| 2 | 019509 | 15 国债 09 | 2,000 | 200,440.00 | 0.29 |

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| | |
|-------------------|------------|
| 公允价值变动总额合计(元) | - |
| 股指期货投资本期收益(元) | -47,220.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | - |

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

1) 套保时机选择策略

根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析，决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。

2) 期货合约选择和头寸选择策略

在套期保值的现货标的确认之后，根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约；运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸；对套期保值的现货标的 Beta 值进行动态的跟踪，动态的调整套期保值的期货头寸。

3) 展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对期货合约进行展期。理论上，不同交割时间的期货合约价差是一个确定值；现实中，价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差，选择合适的交易时机进行展仓。

4) 保证金管理

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

5) 流动性管理策略

利用股指期货的现货替代功能和其金融衍生品交易成本低廉的特点，可以作为管理现货流动性风险的工具，降低现货市场流动性不足导致的交易成本过高的风险。在基金建仓期或面临大规模赎回时，大规模的股票现货买进或卖出交易会造成市场的剧烈动荡产生较大的冲

击成本，此时基金管理人将考虑运用股指期货来化解冲击成本的风险。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 27,108.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 333,800.92 |
| 5 | 应收申购款 | 374,599.29 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 735,508.46 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

11.5 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。

十二、基金的业绩

本基金业绩截止日为 2015 年 12 月 31 日，并经基金托管人复核。

本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 |
|--------------------------------------|--------|---------------|----------------|-------------------|-------|-------|
| 2015 年 1 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日 | 49.90% | 2.71% | 7.23% | 1.50% | 42.67 | 1.21% |

注：2015 年 1 月 16 日为基金合同生效日

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2015 年 8 月 29 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，新增了招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容；
- 3、更新了“第四部分 基金托管人”中的相关内容；
- 4、更新了“第五部分 相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 5、更新了“第六部分 基金的历史沿革”中的相关内容；
- 6、新增了“第九部分 基金的投资”中基金投资组合报告部分内容，更新至 2015 年 12 月 31 日；
- 7、新增了“第十部分 基金的业绩”，更新至 2015 年 12 月 31 日；

8、更新了“第二十二部分 其他应披露的事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站 www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇一六年二月二十九日