

国泰信用互利分级债券型证券投资基金 更新招募说明书摘要

（2017 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

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1706 号文核准募集，本基金的基金合同于 2011 年 12 月 29 日成立正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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。

信用互利基金份额是本基金基础份额，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。互利 A 与互利 B 通过场内的信用互利基金份额按照 7:3 的基金份额配比分拆而来。按照基金合同的约定，具有与信用互利基金份额不同的风险收益特征。互利 A 风险较低、预期收益较稳定，互利 B 风险较高、预期收益相对较高。由于互利 B 份额内含杠杆机制的设计，互利 B 份额净值的变动幅度将大于信用互利基金份额和互利 A 份额净值的变动幅度，即互利 B 的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。互利 B 份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。互利 A 与互利 B 可通过基金合同约定的配对转换方式合并为场内的信用互利基金份额，或通

过基金合同约定的份额折算方式，折算为场内的信用互利基金份额，从而还原为本基金基础份额的风险收益特征。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2017年6月29日，投资组合报告为2017年2季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30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：陈勇胜

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：021-31089000，4008888688

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 2017 年 6 月 29 日，本基金管理人共管理 93 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金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、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰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、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰现金宝货币市场基金、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿信平衡混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金。

另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

（三）主要人员情况

1. 董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982 年 2 月至 1992 年 10 月在中国建设银行

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1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2月至2015年10月在国泰基金管理有限公司工作，其中1998年2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10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、建投传媒华文公司任监事长、纪委书记。2016年11月起任公司党委书记，2017年3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，现任战略发展部处长。2014年5月起任公司董事。

傅敏，董事，大学本科，会计师。1979年12月至1988年3月，任冶金工业部西南地勘局财会处干部。1988年3月至2005年7月，在中国建设银行工作，历任财会部干部、人力资源部干部、副处长、处长、总经理助理。2005年7月至2011年3月在中国建银投资有限责任公司工作，历任人力资源部副总经理、业务总监。2011年6月至2016年11月，在中投发展有限责任公司工作，历任人力资源部总经理、总裁助理、工会主席、党委委员、副总裁、董事。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部专职董事。2017年3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。

董树梓，董事，大学本科，高级会计师。1983年7月至2002年3月，在山东临沂电业局

工作，历任会计、科长、副总会计师。2002年3月至2003年2月，在山西鲁晋王曲发电公司工作，任党组成员、总会计师。2003年2月至2008年3月，任鲁能集团经营考核与审计部总经理。2008年3月至2011年2月，任英大泰和人寿股份有限公司山东分公司总经理。2011年2月至今，在中国电力财务有限公司工作。历任审计部主任，公司党组成员、总会计师。2017年3月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，21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月至2016年7月7日任公司副总经理，2016年7月8日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。

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。

杨小舟，独立董事，博士研究生，研究员。1981年7月至1985年7月，任南京林业大学（原南京林产工业学院）财务处会计员。1988年9月至1998年3月，在中国财政科学研究院（原财政部财政科学研究所）工作，历任实习研究员、助理研究员、副研究员、研究室主任。1998年3月至2000年3月，任长天国际科技有限公司财务总监。2000年3月至2002年4月，任福建实达集团股份有限公司财务总监。2002年6月至2005年5月，任同方股份有限公司副总裁。2005年12月起在中国财政科学研究院工作，任研究员，研究生部博士生导师。2017年3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。

2. 监事会成员

梁凤玉，监事会主席，硕士研究生，高级会计师。1994年8月至2006年6月，先后于建设银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作，任业务经理、副行长、副总经理等职。2006年7月至2007年3月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007年4月至2008年2月在中国投资咨询公司任财务总监。2008年3月至2012年8月在中国建银投资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012年9月至2014年8月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014年12月起任公司监事会主席。

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

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

邓时锋，监事，硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、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9月起兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任公司职工监事。

倪葢，监事，硕士研究生。1998年7月至2001年3月，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，现任信息技术部总监、运营管理部总监。2017年2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，现任纪检监察室副主任、审计部总监助理。2017年3月起任公司职工监事。

3. 高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

陈星德，博士，15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。

李辉，大学本科，17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。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，18年证券从业经历。1999年7月至2014年2月就职于中国证监会陕西监管局，历任稽查处副主任科员、主任科员、行政办公室副主任、稽查二处副处长等；2014年2月至2014年12月就职于中国证监会上海专员办，任副处长；2015年1月至2015年2月就职于上海申乐实业控股集团有限公司，任副总经理；2015年2月至2016年3月就职于嘉合基金管理有限公司，2015年7月起任公司督察长；2016年3月加入国泰基金管理有限公司，2016年3月25日起任公司督察长。

4. 本基金的基金经理

（1）现任基金经理

吴晨，硕士研究生，CFA，FRM，15年证券从业经历。2001年6月加入国泰基金管理有限公司，历任股票交易员、债券交易员；2004年9月至2005年10月，英国城市大学卡斯商学院金融系学习；2005年10月至2008年3月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理；2008年4月至2009年3月在长信基金管理有限公司从事债券研究；2009年4月至2010年3月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010年4月起担任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理；2010年9月至2011年11月担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理；2011年12月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理；2012年9月至2013年11月兼任国泰6个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理；2013年10月起兼任国泰双利债券证券投资基金的基金经理；2016年1月起兼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，2016年12月起兼任国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2017年3月起兼任国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2014年3月至2015年5月任绝对收益投资（事业）部总监助理，2015年5月至2016年1月任绝对收益投资（事业）部副总监，2016年1月起任绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作）。

（2）历任基金经理

本基金自基金成立以来一直由吴晨担任基金经理，无基金经理变更事宜。

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：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

陈星德：副总经理

吴晨：绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作）

邓时锋：权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：国际业务部副总监（主持工作）

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。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

资产负债稳步增长。2016 年末，本集团资产总额 20.96 万亿元，较上年增加 2.61 万亿元，增幅 14.25%，其中客户贷款总额 11.76 万亿元，较上年增加 1.27 万亿元，增幅 12.13%。负债总额 19.37 万亿元，较上年增加 2.47 万亿元，增幅 14.61%，其中客户存款总额 15.40 万亿元，较上年增加 1.73 万亿元，增幅 12.69%。

核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润 2,323.89 亿元，较上年增长 1.53%。手续费及佣金净收入 1,185.09 亿元，在营业收入中的占比较上年提升 0.83 个百分点。平均资产回报率 1.18%，加权平均净资产收益率 15.44%，净利息收益率 2.20%，成本收入比为 27.49%，资本充足率 14.94%，均居同业领先水平。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016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《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等10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220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，资产托管业务部总经理，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。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，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。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金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 2017 年一季度末，中国建设银行已托管 719 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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1. 场外发售机构

（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 | 中国工商银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） | |
| | | 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） | |
| | | 法定代表人：易会满 | 电话：95588 |
| | | 网址：www.icbc.com.cn | |
| 2 | 中国农业银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 | |
| | | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 | |
| | | 法定代表人：周慕冰 | 客户服务电话：95599 |
| | | 联系人：客户服务中心 | 传真：010-85109219 |
| | | 网址：www.95599.cn | |

| | | | |
|----|----------------|---------------------------|------------------------|
| 3 | 中国银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号 | |
| | | 法定代表人：田国立 | 联系人：客户服务中心 |
| | | 客服电话：95566 | 网址：www.boc.cn |
| 4 | 中国建设银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街25号 | |
| | | 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 | |
| | | 法定代表人：王洪章 | 客服电话：95533 |
| | | 网址：www.ccb.com | |
| 5 | 交通银行股份有限公司 | 注册地址：上海市银城中路188号 | |
| | | 法定代表人：牛锡明 | 客服电话：95559 |
| | | 联系人：张宏革 | 电话：021-58781234 |
| | | 网址：www.bankcomm.com | |
| 6 | 招商银行股份有限公司 | 注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦 | |
| | | 法定代表人：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 |
| 7 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：上海市中山东一路12号 | |
| | | 办公地址：上海市中山东一路12号 | |
| | | 法定代表人：吉晓辉 | 电话：021-61618888 |
| | | 联系人：高天、虞谷云 | 客户服务热线：95528 |
| 8 | 华夏银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街22号 | |
| | | 办公地址：北京市东城区建国门内大街22号 | |
| | | 法定代表人：吴建 | 客户服务热线：95577 |
| | | 网址：www.hxb.com.cn | |
| 9 | 中信银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 | |
| | | 法定代表人：孔丹 | 联系人：丰靖 |
| | | 电话：010-65550827 | 传真：010-65550827 |
| | | 客服电话：95558 | 网址：www.bank.ecitic.com |
| 10 | 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 | |
| | | 法定代表人：洪崎 | 联系人：王志刚、穆婷 |
| | | 电话：010-58560666 | 传真：010-83914283 |

| | | | |
|----|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| | | 客服电话：95568 | 网址：www.cmbc.com.cn |
| 11 | 北京银行股份有 限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 | |
| | | 法定代表人：闫冰竹 | 联系人：谢小华 |
| | | 电话：010-66223587 | 传真：010-66226045 |
| | | 客服电话：010-95526 | |
| | | 网址：www.bankofbeijing.com.cn | |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 洛阳银行股份有 限公司 | 注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口 | |
| | | 法定代表人：王建甫 | 联系人：胡艳丽 |
| | | 电话：0379-65921977 | 传真：0379-65920155 |
| | | 客服电话：0379-96699 | |
| | | 网址：www.bankofluoyang.com.cn | |
| 15 | 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 | |
| | | 法定代表人：肖遂宁 | 联系人：王昕 |
| | | 电话：0755-22168032 | 客服电话：95511-3 或 95501 |
| | | 网址：www.bank.pingan.com | |
| 16 | 东莞农村商业银 行股份有限公司 | 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 | |
| | | 法定代表：何沛良 | 联系人：林培珊、杨亢 |
| | | 客服电话：0769-961122 | 电话：0769-22866254 |
| | | 网址：www.drcbank.com | |
| 17 | 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 | |
| | | 法定代表人：杨德红 | 联系人：芮敏祺 |
| | | 电话：021-38676161 | 传真：021-38670161 |

| | | | |
|----|------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | 客服电话：95521 | 网址：www.gtja.com |
| 18 | 中信建投证券 股份有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 | |
| | | 法定代表人：王常青 | 联系人：许梦园 |
| | | 电话：010-85156398 | 传真：010-65182261 |
| | | 客服电话：95587 4008-888-108 | 网址：www.csc108.com |
| 19 | 国信证券股份有 限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼 | |
| | | 法定代表人：何如 | 联系人：周杨 |
| | | 电话：0755-82130833 | 传真：0755-82133952 |
| | | 客服电话：95536 | 网址：www.guosen.com.cn |
| 20 | 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：黄婵君 |
| | | 电话：0755-82960167 | 传真：0755-83734343 |
| | | 网址：www.newone.com.cn | |
| | | 客服电话：400-888-8111/95565 | |
| 21 | 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：邓颜 |
| | | 电话：010-66568292 | 传真：010-66568990 |
| | | 客服电话：400-8888-888 | |
| | | 网址：www.chinastock.com.cn | |
| 22 | 海通证券股份有 限公司 | 注册地址：上海市广东路689号 | |
| | | 法定代表人：王开国 | 联系人：李笑鸣 |
| | | 电话：021-23219000 | 传真：021-63602722 |
| | | 客服电话：95553 | |
| | | 网址：www.htsec.com | |
| 23 | 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：95523 4008895523 |
| | | 网址：www.swhysc.com | |
| 24 | 兴业证券股份有 | 注册地址：福建省福州市湖东路268号证券大厦 | |

| | | | |
|----|----------------|--|--------------------|
| | 限公司 | 法定代表人：兰荣 | 联系人：谢高得 |
| | | 电话：021-38565785 | 传真：021-38565783 |
| | | 客服电话：400-888-8123 | 网址：www.xyzq.com.cn |
| 25 | 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：甘蕾 |
| | | 电话：020-38286026 | 传真：020-38286588 |
| | | 客服电话：400-888-8133 | 网址：www.wlzq.com.cn |
| 26 | 民生证券股份有 限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层 | |
| | | 法定代表人：余政 | 联系人：赵明 |
| | | 电话：010-85127622 | 传真：010-85127917 |
| | | 客服电话：400-619-8888 | 网址：www.msza.com |
| 27 | 东吴证券股份有 限公司 | 注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号 | |
| | | 法定代表人：范力 | 联系人：陆晓 |
| | | 电话：0512-62938521 | 传真：0512-65588021 |
| | | 全国客服电话：95330 | 网址：www.dwzq.com.cn |
| 28 | 东方证券股份有 限公司 | 注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层 | |
| | | 法定代表人：潘鑫军 | 联系人：吴宇 |
| | | 电话：021-63325888 | 传真：021-63326173 |
| | | 客服电话：95503 | 网址：www.dfzq.com.cn |
| 29 | 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 |
| 30 | 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 | |
| 31 | 光大证券股份有 | 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号 | |

| | | | |
|----|--------------------|---|---------------------|
| | 限公司 | 法定代表人：薛峰 | 联系人：刘晨、李芳芳 |
| | | 电话：021-22169999 | 传真：021-22169134 |
| | | 客服电话：95525、10108998、400-888-8788 | |
| | | 网址：www.ebscn.com | |
| 32 | 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 |
| 33 | 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：张佑君 | 联系人：侯艳红 |
| | | 电话：010-60838888 | 传真：010-60836029 |
| | | 网址：www.cs.ecitic.com | |
| 34 | 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 |
| 35 | 中信证券（山东） 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：赵艳青 |
| | | 电话：0532-85023924 | 传真：0532-85022605 |
| | | 客服电话：95548 | 网址：www.citicssd.com |
| 36 | 华泰证券股份有 限公司 | 注册地址：南京市江东中路 228 号 | |
| | | 办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼 | |
| | | 法定代表人：周易 | 联系人：庞晓芸 |
| | | 电话：0755-82492193 | 网址：www.htzq.com.cn |

| | | | |
|----|----------------|--|--------------------|
| | | 客服电话：95597 | |
| 37 | 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：崔少华 | 联系人：奚博宇 |
| | | 电话：027-65799999 | 传真：027-85481900 |
| | | 客服电话：95579 | 网址：www.95579.com |
| 38 | 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 | |
| | | 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 层 | |
| | | 法定代表人：菅明军 | 联系人：程月艳、耿铭 |
| | | 电话：0371-65585670 | 传真：0371-65585665 |
| | | 客服电话：400-813-9666/0371-967218 | |
| | | 网址：www.ccnew.com | |
| 39 | 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 | |
| | | 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.zts.com.cn |
| 40 | 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：王连志 | 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 | |
| 41 | 恒泰证券股份有 限公司 | 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号 | |
| | | 法定代表人：庞介民 | 联系人：王旭华 |
| | | 电话：0471-4972343 | 传真：0471-4961259 |
| | | 客服电话：0471-4961259 | 网址：www.cnht.com.cn |
| 42 | 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 |

| | | | |
|----|------------------|--|----------------------|
| 43 | 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：高涛 | 联系人：张鹏 |
| | | 电话：0755-82023442 | 传真：0755-82026539 |
| | | 网址：www.china-invs.cn | |
| | | 客服电话：400-600-8008、95532 | |
| 44 | 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 |
| 45 | 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 |
| 46 | 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 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 | |
| 47 | 华福证券有限责 任公司 | 注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层 | |
| | | 法定代表人：黄金琳 | 联系人：张腾 |
| | | 电话：0591-87278701 | 传真：0591-87841150 |
| | | 客服电话：0591-96326 | 网址：www.hfzq.com.cn |
| 48 | 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 |
| 49 | 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 |
| 50 | 中国民族证券有 限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层 | |
| | | 法定代表人：赵大建 | 联系人：李微 |
| | | 电话：010-59355941 | 传真：010-66553791 |
| | | 客服电话：400-889-5618 | 网址：www.e5618.com |
| 51 | 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 | |
| 52 | 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 |
| 53 | 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 |
| 54 | 平安证券股份有 限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层 | |
| | | 法定代表人：谢永林 | 联系人：周一涵 |
| | | 电话：021-38637436 | 传真：021-33830395 |
| | | 客服电话：95511-8 | 网址：stock.pingan.com |
| 55 | 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 | |
| | | 法定代表人：姚文平 | 联系人：朱磊 |
| | | 电话：021-68761616 | 传真：021-68767880 |
| | | 客服电话：4008888128 | 网址：www.tebon.com.cn |
| 56 | 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：王宜四 | 联系人：史江蕊 |
| | | 电话：010-64818301 | 传真：010-64818443 |

| | | | |
|----|----------------|---|----------------------|
| | | 客服电话：400-88-95335 | 网址：www.avicsec.com |
| 57 | 方正证券股份有 限公司 | 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层 | |
| | | 法定代表人：雷杰 | 联系人：郭瑞军 |
| | | 电话：0731-85832503 | 传真：0731-85832214 |
| | | 客服电话：95571 | 网址：www.foundersc.com |
| 58 | 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 | |
| 59 | 湘财证券有限责 任公司 | 注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼 | |
| | | 法定代表人：林俊波 | 联系人：钟康莺 |
| | | 电话：021-68634518 | 传真：021-68865680 |
| | | 客服电话：400-888-1551 | 网址：www.xcsc.com |
| 60 | 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 |
| 61 | 日信证券有限责 任公司 | 注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号 | |
| | | 法定代表人：孔佑杰 | 联系人：陈韦杉 |
| | | 电话：010-66413306 | 传真：010-66412537 |
| | | 客服电话：010-88086830 | 网址：www.rxzq.com.cn |
| 62 | 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 |
| 63 | 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 |
| 64 | 浙商证券股份有 限公司 | 注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7 | |
| | | 法定代表人：吴承根 | 联系人：毛亚莉 |
| | | 电话：021-64318893 | 传真：021-64713795 |
| | | 客服电话：967777 | 网址：www.stocke.com.cn |
| 65 | 中银国际证券有 限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 | |
| | | 法定代表人：许刚 | 联系人：王炜哲 |
| | | 电话：021-20328309 | 传真：021-50372474 |
| | | 客服电话：4006208888 | 网址：www.bocichina.com |
| 66 | 新时代证券有限 责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街1号A座8层 | |
| | | 法定代表人：马金声 | 联系人：孙恺 |
| | | 电话：010-83561149 | 传真：010-83561094 |
| | | 客服电话：4006989898 | 网址：www.xsdzq.cn |
| 67 | 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 | |
| | | 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 |
| 68 | 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 |
| 69 | 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：王道 |
| | | 电话：021-64339000 | |
| | | 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918 | |
| | | 网址：www.cfsc.com.cn | |
| 70 | 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 | |
| | | 办公地址：四川省成都市东城根上街95号 | |

| | | | |
|----|------------------|---|--|
| | | 法定代表人：冉云 | 联系人：贾鹏 |
| | | 电话：028-86690058 | 传真：028-86690126 |
| | | 客户服务电话：4006600109 | 网址：www.gjq.com.cn |
| 71 | 中信期货股份有限公司 | 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13层1301-1305室、14层 | |
| | | 办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 | |
| | | 法定代表人：张皓 | 联系人：洪诚 |
| | | 电话：0755-23953913 | 传真：0755-83217421 |
| | | 网址：www.citicsf.com | |
| 72 | 申万宏源西部证券有限公司 | 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 | |
| | | 法定代表人：李季 | 联系人：王怀春 |
| | | 电话：0991-2307105 | 传真：0991-2301927 |
| | | 客服电话：4008000562 | 网址： www.hysec.com |
| 73 | 华西证券股份有限公司 | 注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 | |
| | | 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 | |
| | | 法定代表人：杨炯洋 | 联系人：谢国梅 |
| | | 联系电话：010-52723273 | 传真：028-86150040 |
| | | 客户服务电话：95584 | 网址：www.hx168.com.cn |
| | | | |
| 74 | 九州证券股份有限公司 | 注册地址：青海省西宁市中区西大街11号工商银行3楼 | |
| | | 法定代表人：曲国辉 | 客服电话：95305 |
| | | 网址：www.jzsec.com | |
| 75 | 宁波银行股份有限公司 | 注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号 | |
| | | 法定代表人：陆华裕 | |
| | | 客服电话：95574 | |
| | | 网址：www.nbcb.com.cn | |
| 76 | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：常州市和平中路413号 | |
| | | 法定代表：陆向阳 | 联系人：包静 |
| | | 电话：0519-89995170 | 传真：0519-89995170 |
| | | 客服电话：(0519)96005 | |

| | |
|--|-----------------------|
| | 网址：www.jnbank.com.cn. |
|--|-----------------------|

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：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 | |
| | | 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋 | |
| | | 法定代表人：汪静波 | 联系人：李娟 |
| | | 电话：021-38602377 | 传真：021-38509777 |
| | | 客服电话：400-821-5399 | 网址：www.noah-fund.com |
| 2 | 上海好买基金销售 有限公司 | 注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 | |
| | | 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室 | |
| | | 法定代表人：杨文斌 | 联系人：薛年 |
| | | 电话：021-20613999 | 传真：021-68596916 |
| | | 客服电话：400-700-9665 | 网址：www.ehowbuy.com |
| 3 | 蚂蚁（杭州）基金 销售有限公司 | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室 | |
| | | 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F | |
| | | 法定代表人：陈柏青 | 联系人：韩爱彬 |
| | | 电话：0571-28829790 | 传真：0571-26698533 |
| | | 客服电话：4000-766-123 | 网址：www.fund123.cn |
| 4 | 深圳众禄金融控股 股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801 | |
| | | 办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801 | |
| | | 法定代表人：薛峰 | 联系人：童彩平 |
| | | 电话：0755-33227950 | 传真：0755-82080798 |
| | | 客服电话：4006-788-887 | |
| | | 网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com | |
| 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 | |
| | | 办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 | |
| | | 法定代表人：张跃伟 | 联系人：何昶 |

| | | | |
|----|------------------|------------------------------------|-----------------------|
| | | 电话：021-58788678-8201 | 传真：021-58787698 |
| | | 客服电话：400-820-2899 | 网址：www.erichfund.com |
| 6 | 北京展恒基金销售有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 | |
| | | 法定代表人：闫振杰 | 联系人：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：杭州市文二西路1号903室 | |
| | | 办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼 | |
| | | 法定代表人：凌顺平 | 联系人：杨翼 |
| | | 电话：0571-88911818-8653 | 传真：0571-86800423 |
| | | 客服电话：4008-773-772 0571-88920897 | 网址：www.5ifund.com |
| 8 | 上海天天基金销售有限公司 | 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 | |
| | | 办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座 | |
| | | 法定代表：其实 | 联系人：朱钰 |
| | | 电话：021-54509977 | 传真：021-64383798 |
| | | 客服电话：4001818188 | 网址：www.1234567.com.cn |
| 9 | 众升财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室 | |
| | | 办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08 | |
| | | 法定代表：李招弟 | 联系人：李艳 |
| | | 电话：010-59497361 | 传真：010-64788016 |
| | | 客服电话：400-876-9988 | 网址：www.zscffund.com |
| 10 | 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：李兴春 | 联系人：叶志杰 |
| | | 电话：021-50583533 | 传真：021-50583633 |
| | | 客服电话：400-921-7755 | |
| | | 网址：www.leadfund.com.cn | |
| 11 | 浙江金观诚财富管理有限公司 | 注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室 | |

| | | | |
|----|------------------|--|----------------------|
| | | 办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富 | |
| | | 法定代表人：徐黎云 | 联系人：孙成岩 |
| | | 电话：0571-88337888 | 传真：0571-56899710 |
| | | 客服电话：400-068-0058 | |
| | | 网址：www.jincheng-fund.com | |
| 12 | 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 | |
| 13 | 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：400-6099-200 | 网址：www.yixinfund.com |
| 14 | 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 | |
| | | 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 2208 | |
| | | 法定代表人：吴雪秀 | 联系人：徐越 |
| | | 客服电话：400-001-1566 | 联系电话：010-88312877 |
| | | 网址：www.yilucaifu.com | |
| 15 | 北京增财基金销售有限公司 | 办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 | |
| | | 客户服务热线：400-001-8811 | |
| | | 公司网站：www.zcvc.com.cn | |
| 16 | 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 | |
| | | 办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层 | |
| | | 法定代表人：燕斌 | 联系人：兰敏 |
| | | 电话：021-52822063 | 传真：021-52975270 |
| | | 客服电话：400-166-6788 | 网址：www.66zichan.com |

| | | | |
|----|----------------------|---------------------------------|-----------------|
| 17 | 上海汇付金融服务 有限公司 | 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层 | |
| | | 办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼 | |
| | | 法定代表人：金佶 | 联系人：陈云卉 |
| | | 客服电话：400-821-3999 | |
| | | 手机客户端：天天盈基金 | |
| 18 | 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09单元 | |
| | | 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼 | |
| | | 法定代表人：鲍东华 | |
| | | 客户服务电话：400-821-9031 | |
| | | 网站：www.lufunds.com | |
| 19 | 北京钱景基金销售 有限公司 | 注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 | |
| | | 法定代表人：赵荣春 | |
| | | 电话：010-57418829 | 传真：010-57569671 |
| | | 客服电话：400-893-6885 | |
| | | 网址：www.qianjing.com | |
| 20 | 北京虹点基金销售 有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元 | |
| | | 办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层 | |
| | | 法定代表人：胡伟 | |
| | | 客户服务电话：400-618-0707 | |
| | | 网址：www.hongdianfund.com | |
| 21 | 深圳市新兰德证券 投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | |
| | | 公司地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层 | |
| | | 客户服务电话：400-166-1188 | |
| | | 法定代表人：张彦 | 联系人：文雯 |
| | | 电话：010-83363101 | |
| | | 网址：8.jrj.com.cn | |

| | | | |
|----|----------------|--|------------------------|
| 22 | 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 | |
| | | 法定代表人：陈继武 | 联系人：李晓明 |
| | | 电话：021-63333319 | 传真：021-63333390 |
| | | 客服电话：4006-433-389 | |
| | | 网址：www.lingxianfund.com | |
| 23 | 深圳富济财富管理有限公司 | 注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室 | |
| | | 办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室 | |
| | | 法定代表人：刘鹏宇 | 联系人：杨涛 |
| | | 电话：0755-83999907-815 | 传真：0755-83999926 |
| | | 客服电话：0755-83999907 | |
| | | 网址：www.jinqianwo.cn | |
| 24 | 珠海盈米财富管理有限公司 | 注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 | |
| | | 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203单元 | |
| | | 法定代表人：肖雯 | 联系人：李孟军 |
| | | 电话：18500050725 | 传真：021-63333390 |
| | | 客服电话：020-89629099 | |
| | | 网址：www.yingmi.cn | |
| 25 | 北京新浪仓石基金销售有限公司 | 注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室 | |
| | | 办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室 | |
| | | 法定代表人：李昭琛 | 联系人：付文红 |
| | | 电话：010-62676405 | 传真：010-82607151 |
| | | 客服电话：010-62675369 | |
| | | 网址：www.xincai.com | |
| 26 | 南京苏宁基金销售有限公司 | 注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 | |
| | | 办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号（苏宁总部） | |
| | | 法定代表人：钱燕飞 | 联系人：喻明明 |
| | | 电话：025-66996699-884131 | 传真：025-66008800-884131 |

| | | | |
|----|-----------------|--------------------------------------|-----------------|
| | | 客服电话：95177 | |
| | | 网址：www.snjijin.com | |
| 27 | 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 | |
| | | 法定代表人：王伟刚 | 联系人：丁向坤 |
| | | 电话：010-56282140 | 传真：010-62680827 |
| | | 客服电话：400-619-9059 | |
| | | 网址：www.hcjijin.com | |
| 28 | 北京创金启富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A | |
| | | 法定代表人：梁蓉 | 联系人：李婷婷 |
| | | 电话：010-66154828 | 传真：010-63583991 |
| | | 客服电话：400-6262-818 | |
| | | 网址：www.5irich.com | |
| 29 | 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 | |
| | | 办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院 | |
| | | 法定代表人：江卉 | 联系人：赵德赛 |
| | | 电话：010-89188343 | 客服电话：95118 |
| | | 网址：fund.jd.com | |
| 30 | 北京蛋卷基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 | |
| | | 办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507 | |
| | | 法定代表人：钟斐斐 | 联系人：戚晓强 |
| | | 电话：010-61840688 | 传真：010-61840699 |
| | | 客服电话：4000618518 | |
| | | APP 下载网址：danjuanapp.com | |
| 31 | 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 | |
| | | 办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室 | |
| | | 法定代表人：周斌 | 联系人：张鼎 |
| | | 电话：010-59313555 | 传真：010-59313586 |
| | | 客服电话：4008980618 | |

| | | | |
|----|----------------|--------------------------------------|------------------|
| | | 网址: www.chtfund.com | |
| 32 | 上海华夏财富投资管理有限公司 | 注册地址: 上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室 | |
| | | 办公地址: 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层 | |
| | | 法定代表: 李一梅 | 联系人: 仲秋玥 |
| | | 电话: 010-88066632 | 传真: 010-88066552 |
| | | 客服电话: 400-817-5666 | |
| | | 网址: www.amcfortune.com | |

2. 场内销售机构

信用互利基金需通过具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位办理场内申购、赎回业务。投资人需使用深圳证券账户, 通过深圳证券交易所交易系统办理信用互利基金份额的场内申购、赎回业务。本基金互利 A 份额(场内简称: 互利 A; 交易代码: 150066)与互利 B 份额(场内简称: 互利 B; 交易代码 150067)于 2012 年 1 月 17 日在深圳证券交易所上市交易。

(二) 登记结算机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司
 地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号
 法定代表人: 金颖
 联系人: 朱立元
 电话: (010) 59378839
 传真: (010) 59378907

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 通力律师事务所
 住所: 上海市银城中路 68 号 19 楼
 负责人: 韩炯
 联系电话: 021-31358666
 传真: 021-31358600
 联系人: 黎明
 经办律师: 吕红、黎明

(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：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：李一

经办注册会计师：许康玮、李一

四、基金的名称

国泰信用互利分级债券型证券投资基金

五、基金类型和存续期限

1. 基金类型：债券型
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

在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

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，包括国内依法发行上市的债券、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）、货币市场工具、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，但须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。

本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但可以参与一级市场股票首次公开发行或增发，还可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中，投资于信用债券的比例不低于固定收益类资产的80%；本基金投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%。同时本基金还应保留不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金投资的信用债券指金融债、政策性金融债、公司债、企业债、短期融资券、地方政府债、可转换公司债券（含可分离交易的可转换债券）、资产支持证券等除国债和央行票据外的非国家信用的债券资产。

八、投资策略

1. 大类资产配置

本基金将主要根据对宏观经济运行周期和国内外经济形势的分析和判断，结合国家财政货币政策、证券市场走势、资金面状况、各类资产流动性等其他多方面因素，自上而下确定本基金的大类资产配置策略，并通过严格的风险评估，在充分分析市场环境和流动性的基础上，对投资组合进行动态的优化调整，力求保持基金的总体风险水平相对稳定。

2. 债券投资策略

本基金债券投资将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略、可转债策略、回购交易套利策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形变、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。

（1）久期策略

本基金将基于对宏观经济政策和通货膨胀状况的分析，预测未来的利率变化趋势，并确定相应的久期目标，合理控制利率风险。在预期利率整体上升时，降低组合的平均久期；在预期利率整体下降时，提高组合的平均久期。在通胀预期较为强烈的时期，提高短久期、高收益债券的配置比例，以有效应对加息预期，降低组合风险。

（2）收益率曲线策略

在组合的久期配置确定以后，本基金将通过收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）信用债策略

信用债策略是本基金债券投资的核心策略。本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。具体的投资策略包括：

1) 自上而下与自下而上的分析相结合的策略：自上而下即从宏观经济、债券市场、机构行为等角度分析，制定久期、类属配置策略，选择投资时点；自下而上即寻找相对有优势和评级上调概率较大的公司，制定个券选择策略。本基金通过将两种分析方式相结合来确定信用债的行业配置，经济上升期选择周期性行业，经济回落期选择防御型行业；

2) 相对投资价值判断策略：根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。由于利差水平受流动性和信用水平的影响，因此该策略也可扩展到新老券置换、流动性和信用的置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券或是流动性更好的债券，或在相同外部信用级别和收益率下，买入内部信用评级更高的债券；

3) 信用风险评估：信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险收益的信用利差。基准收益率主要受宏观经济政策环境的影响，而信用利差收益率主要受该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线以及该信用债本身的信用变化的影响。债券发行人自身素质的变化，包括公司产权状况、法人治理结构、管理水平、经营状况、财务质量、抗风险能力等的变化将对信用级别产生影响。

本基金管理人将利用内部评级系统来对信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差进行全面的分析。该系统包含定性评级、定量打分以及条款分析等多个不同层面。定性评级主要关注股权结构、股东实力、行业风险、历史违约及或有负债等；定量打分系统主要考察发债主体的财务实力；条款分析系统主要针对有担保的长期债券，通过分析担保条款、担保主体的长期信用水平，并结合担保的情况下对债项做出综合分析。

（4）可转债策略

可转换公司债券兼具股票与债券的特性。本基金也将充分利用可转债具有安全边际和进攻性的双重特征，在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，配置溢价率低、具有一定安全边际的可转债进行投资。

（5）回购套利策略

回购套利策略也是本基金重要的投资策略之一，把信用债投资和回购交易结合起来，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来博取超额收益，或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。

3. 新股投资策略

本基金的股票投资包括新股申购、增发等一级市场投资。在参与股票一级市场投资的过程中，本基金管理人将全面深入地研究企业的基本面，发掘新股内在价值，结合市场估值水平，并充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。

中证全债指数作为中证指数有限公司提供的中证系列指数之一，具有一定的优势和市场影响力。中证全债指数从上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场选择国债、金融债及企业债组成样本券，能够较好的反映债券市场变动的全貌，市场代表性较强，比较适合作为本基金的业绩比较基准。

如果出现市场情况发生变化等情形导致此业绩比较基准不再适用或者出现更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。基金管理人对业绩比较基准的调整或变更须与基金托管人协商一致后报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

从基金资产整体运作来看，本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从本基金的两类基金份额来看，由于本基金资产及收益的分配安排，优先类份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；进取类份额则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

十一、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 14 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 2016 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 固定收益投资 | 353,909,738.23 | 95.91 |
| | 其中：债券 | 353,909,738.23 | 95.91 |
| | 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 | 7,806,188.77 | 2.12 |
| 7 | 其他各项资产 | 7,297,707.85 | 1.98 |
| 8 | 合计 | 369,013,634.85 | 100.00 |

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 12,163,180.00 | 4.60 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 39,500,000.00 | 14.93 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,500,000.00 | 14.93 |
| 4 | 企业债券 | 264,930,391.40 | 100.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,006,000.00 | 3.78 |
| 6 | 中期票据 | 9,653,000.00 | 3.65 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 17,657,166.83 | 6.68 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 353,909,738.23 | 133.80 |

5. 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 | 170210 | 17 国开 10 | 400,000 | 39,500,000.00 | 14.93 |
| 2 | 122849 | 11 新余债 | 200,000 | 20,124,000.00 | 7.61 |
| 3 | 122830 | 11 沈国资 | 149,990 | 15,384,474.30 | 5.82 |
| 4 | 122821 | 11 吉城建 | 150,000 | 15,180,000.00 | 5.74 |
| 5 | 122834 | 11 牡国投 | 150,000 | 15,138,000.00 | 5.72 |

6. 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。

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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

(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。

(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) 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,771.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,293,606.15 |
| 5 | 应收申购款 | 329.71 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,297,707.85 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 110032 | 三一转债 | 5,346,000.00 | 2.02 |
| 2 | 113009 | 广汽转债 | 916,246.50 | 0.35 |
| 3 | 128013 | 洪涛转债 | 178,288.00 | 0.07 |

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

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

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2011 年 12 月 29 日至 2011 年 12 月 31 日 | 0.00% | 0.00% | 0.19% | 0.09% | -0.19% | -0.09% |
| 2012 年度 | 7.30% | 0.06% | 3.52% | 0.07% | 3.78% | -0.01% |

| | | | | | | |
|--------------------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2013 年度 | 2.94% | 0.09% | -1.07% | 0.10% | 4.01% | -0.01% |
| 2014 年度 | 12.47% | 0.15% | 10.82% | 0.09% | 1.65% | 0.06% |
| 2015 年度 | 9.80% | 0.12% | 8.74% | 0.08% | 1.06% | 0.04% |
| 2016 年度 | 3.99% | 0.08% | 2.00% | 0.09% | 1.99% | -0.01% |
| 2017 年上半年 | 1.34% | 0.07% | -0.20% | 0.07% | 1.54% | 0.00% |
| 2011 年 12 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日 | 43.74% | 0.11% | 25.85% | 0.09 | 17.89% | 0.02% |

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. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市费及年费；
9. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，

经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对基金招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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 2017 年 2 月 11 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，更新了招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了“三、基金管理人”中的相关内容；
- 3、更新了“四、基金托管人”中的相关内容；
- 4、更新了“五、相关服务机构”中销售机构的相关信息；

- 5、更新了“十二、基金的投资”中基金投资组合报告，更新至2017年6月30日；
- 6、更新了“十三、基金的业绩”，更新至2017年6月30日；
- 7、更新了“二十七、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

二〇一七年八月十二日