

# 国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

（2012 年第一号）

**基金管理人：国泰基金管理有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

### 重要提示

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金根据 2006 年 3 月 16 日中国证券监督管理委员会《关于同意国泰金鹿保本增值混合证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2006]43 号）核准募集。根据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》的规定，上一个保本周期期满后，在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下，保本基金转入第二个保本周期。第二个保本周期的基金名称变更为“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）”。

经本基金管理人与本基金托管人协商一致，并经中国证监会核准（证监许可[2008]583 号），国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）于 2008 年 5 月 6 日开始募集。《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》在募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后于 2008 年 6 月 12 日生效。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人对《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》进行了修改，同时基金名称变更为“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金”。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

本基金的第三个保本周期起始于 2010 年 7 月 2 日，并于 2012 年 7 月 2 日到期。针对本基金第四个保本周期担保人的变更，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人对《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》进行了修改，并于 2012 年 6 月 11 日刊登了修订后的基金合同全文，本次修订后的基金合同于 2012 年 7 月 3 日起生效。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）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，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）本基金的意愿、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，基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩及其净值表现并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

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 2012 年 6 月 12 日，投资组合报告为 2012 年 1 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 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

成立日期：1998 年 3 月 5 日

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：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1 亿元人民币

联系人：何晔

联系电话：（021）38569000，4008888688

基金管理人股权结构如下：

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

### （二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2012 年 6 月 12 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，以及 24 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、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、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（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、国泰价值经典股票型证券投资基金（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、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)。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：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，20 年证券从业经历。1982 年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。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 年起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 月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999 年 10 月起任公司董事长、党委书记。

庄乾志，董事，博士研究生，高级经济师。1999 年 8 月至 2004 年 12 月在中国建设银行总行工作，历任建设银行总行投资银行部副经理、机构业务部高级经理。2005 年 1 月至 2007 年 7 月在中国建银投资有限责任公司任投行部副总兼证券公司重组办公室主任。2007 年 8 月至 2009 年 2 月在西南证券有限责任公司任董事、党委委员及副总裁。2009 年 2 月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任资本市场部负责人、战略部负责人，现任中国建银投资有限责任公司办公室、党委办公室主任。2012 年 4 月起任公司董事。

林川，董事，博士研究生。2006年6月至2009年1月在美国华盛顿互惠银行任高级计量分析师。2009年2月至2009年7月在美国富升人寿保险任财务经理。2010年3月起在中国建银投资有限责任公司风险管理部工作，现任中国建银投资有限责任公司风险管理部综合风险组负责人。2012年4月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生。1991年起历任 BARCLAYS BANK 金融分析师；1993年起任 BOISSY GESTION SA (AZUR - GMF)首席执行官；2003年起任 ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监；2004年起任 GENERALI FINANCES SA 副总经理、投资总监；2007年起任 GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A./GENERALI INVESTMENTS 首席执行官、投资总监；2009年起任 GENERALI INVESTMENTS 董事会主席/首席执行官。2011年起任 Generali Group 首席投资官。并兼任 Generali Investments SICAV (卢森堡)主席、Generali Investments Deutschland 监事会主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano) 董事会成员等职务。2010年6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）。1994年起历任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理、忠利保险有限公司英国分公司、忠利亚洲中国地区总经理、中意财产保险有限公司董事、总经理，兼任中意人寿保险有限公司董事。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。

金旭，董事，硕士研究生，19年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任党支部副书记、副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007年11月起任公司董事、党委副书记。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993年回国从事律师工作，现为北京中伦律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001年5月起任公司独立董事。

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、执行院长。兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、中国法学会国际经济法学研究会常务副会

长、中国法学会民法学研究会常务理事、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、大连仲裁委仲裁员、北京市华贸硅谷律师事务所兼职律师等职。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。

## 2、监事会成员：

唐建光，监事会主席，大学本科。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月进入中国建银投资有限责任公司，先后任资产处置部负责人、总经理、资产管理处置部总经理、负责人，现任中国建银投资有限责任公司企业管理部高级业务总监。2010年11月起担任本公司监事会主席。

Amerigo BORRINI，监事，大学本科，CFA，金融咨询师。1967年起历任忠利集团会计结算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官。2010年6月起任本公司监事。

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员工作，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。

沙骏，监事，硕士研究生。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券，1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团，2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司；2008年2月至2009年8月任交易

部总监；2009年9月至2011年6月任研究部总监；2011年1月至2012年2月兼任公司投资副总监；2012年2月起兼任公司投资总监。2011年4月起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。2010年11月起担任公司职工监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001年10月加入国泰基金管理有限公司，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。2007年11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。

金旭，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，19年证券从业经历。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。现任公司副总经理兼北京分公司总经理。

梁之平，本科，15年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理，大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监，2008年4月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理兼财富管理中心总经理，2011年1月至2012年2月兼任深圳分公司总经理，2010年4月起任公司副总经理兼财富管理中心总经理。

李峰，硕士研究生，16年银行证券基金从业经历。1996年5月至2003年6月任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管，2003年7月至2005年5月任国联安基金管理有限公司监察稽核专员，2005年5月至2007年3月任信诚基金管理有限公司督察长，2007年4月至2009年1月任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009年2月加盟国泰基金管理有限公司，现任公司督察长。

### 4、本基金基金经理及相关研究人员配备

#### （1）现任基金经理

沙骥，男，硕士研究生。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券，1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团，2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司；2008年2月至2009年8月任交易部总监；2009年9月至2011年6月任研究部总监；2011年1月至2012年2月兼任公司投资副总监，2012年2月起兼任公司投资总监。2011年4月起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。

邱晓华，硕士研究生。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月起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。

徐佳，学士，曾任职于中诚信国际信用评级有限责任公司信用评级部、中诚信证券评估有限公司。2009年3月加盟国泰基金，任固定收益部高级信用分析师。2011年4月至2012年6月担任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理助理，2011年6月至2012年6月担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理助理。2012年6月起担任国泰保本混合型证券投资基金和国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。

#### （2）历任基金经理

2008年6月至2008年8月，由高红兵担任本基金的基金经理；2008年8月至2010年6月，由陈强、唐珂共同担任本基金的基金经理。2010年6月20日至2010年9月17日，由翁锡赉先生、范迪钊共同担任本基金的基金经理。2010年9月18日至2011年6月14日，由吴晨、翁锡赉先生和范迪钊共同担任本基金的基金经理。2011年6月15日至2011年11月30日，由吴晨、沙骏、邱晓华共同担任本基金的基金经理。2011年12月1日起，由沙骏、邱晓华共同担任本基金的基金经理。2012年6月13日起，由沙骏、邱晓华、徐佳共同担任本基金的基金经理。

#### （3）相关研究人员配备

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

#### 5、投资决策委员会

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。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：

金旭女士：总经理

梁之平先生：副总经理兼财富管理中心总经理

张人蟠先生：总经理助理

周向勇先生：总经理助理

刘夫先生：投资副总监

沙骏先生：投资总监

张则斌先生：财富管理中心投资总监

黄焱先生：投资总监兼基金管理部总监

张玮先生：投资总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

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

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。



在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

## （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 120 余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

## （三）证券投资基金托管情况

截至 2012 年 3 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证

100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等 147 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货

币型、指数型等多种类型的基金，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。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 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：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		电话：021-38561759	传真：021-68775881
		客户服务专线：400-888-8688，021-38569000	
		联系人：蔡丽萍	网址： <a href="http://www.gtfund.com">www.gtfund.com</a>
2	国泰基金管理有限公司北京直销柜台	地址：中国北京市西城区金融大街7号第5层	
		电话：010-66553078	传真：010-66553082
		联系人：王彬	
3	国泰基金电子交易平台	网站： <a href="http://www.gtfund.com">www.gtfund.com</a> 登录网上交易页面	
		电话：021-38561739	联系人：徐怡

##### 2、代销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	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：肖钢	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址： <a href="http://www.boc.cn">www.boc.cn</a>
2	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： <a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>	
3	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：蒋超良	客户服务电话：95599
		网址： <a href="http://www.95599.cn">www.95599.cn</a>	
4	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：姜建清	电话：95588
		网址：www.icbc.com.cn	
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：胡怀邦	客服电话：95559
		联系人：曹榕	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：上海市浦东新区浦东南路 500 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：汤嘉惠、虞谷云	客户服务热线：95528
		网址：www.spdb.com.cn	
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	客服服务热线：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：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：董文标	联系人：董云巍、吴海鹏
		电话：010-58351666	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： <a href="http://www.bankofbeijing.com.cn">www.bankofbeijing.com.cn</a>	
12	中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街3号	
		法定代表人：李国华	联系人：陈春林
		客服电话：95580	网址： <a href="http://www.psbc.com">www.psbc.com</a>
13	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： <a href="http://www.srcb.com">www.srcb.com</a>
14	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	客服电话：400-600-8008
		网址： <a href="http://www.china-invs.cn">www.china-invs.cn</a>	
15	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： <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>
16	宏源证券股份有限公司	注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号	
		法定代表人：冯戎	联系人：李巍
		电话：010-88085858	传真：010-88085195
		客服电话：400-800-0562	网址： <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a>
17	万联证券有限责任公司	注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层	
		法定代表人：张建军	联系人：罗创斌
		电话：020-37865070	传真：020-22373718-1013
		客服电话：400-888-8133	网址： <a href="http://www.wlzq.com.cn">www.wlzq.com.cn</a>
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	联系人：魏明
		电话：010-85130588	传真：010-65182261

		客服电话：400-888-8108	网址： <a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a>
19	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： <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>	
20	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：顾伟国	联系人：田薇
		电话：010-66568430	传真：010-66568990
		网址： <a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a>	
21	中信证券（浙江） 有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦 19 楼	
		法定代表人：沈强	联系人：周妍
		电话：0571-86078823	客服电话：0571-96598
		网址： <a href="http://www.bi.gsun.com.cn">www.bi.gsun.com.cn</a>	
22	申银万国证券股份 有限公司	注册地址：上海市常熟路 171 号	
		法定代表人：丁国荣	联系人：邓寒冰
		电话：021-54033888	传真：021-54038844
		客服电话：021-962505	网址： <a href="http://www.sw2000.com.cn">www.sw2000.com.cn</a>
23	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：王益民	联系人：吴宇
		电话：021-63325888	传真：021-63326173
		客服电话：95503	网址： <a href="http://www.dfzq.com.cn">www.dfzq.com.cn</a>
24	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： <a href="http://www.dwzq.com.cn">www.dwzq.com.cn</a>
25	广发证券股份有限 公司	注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
		办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、41 和 42 楼	
		法定代表人：王志伟	联系人：黄岚
		电话：020-87555888	传真：020-87555305

		客服电话：95575	网址： <a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>
26	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： <a href="http://www.gsstock.com">www.gsstock.com</a>	
27	民生证券有限责任公司	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： <a href="http://www.msza.com">www.msza.com</a>
28	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： <a href="http://www.962518.com">www.962518.com</a>
29	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：徐浩明	联系人：刘晨
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：10108998、400-888-8788	
		网址： <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>	
30	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）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： <a href="http://www.zxwt.com.cn">www.zxwt.com.cn</a>
31	中信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层	
		法定代表人：王东明	联系人：陈忠
		电话：010-84588888	传真：010-84865560

		网址: <a href="http://www.ecitic.com">www.ecitic.com</a>	
32	华泰证券有限责任公司	注册地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
		办公地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
		法定代表人: 吴万善	联系人: 张小波
		电话: 025-84457777	网址: <a href="http://www.htzq.com.cn">www.htzq.com.cn</a>
		客服电话: 95597	
33	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: 021-63219781	传真: 021-51062920
		客服电话: 95579	网址: <a href="http://www.95579.com">www.95579.com</a>
34	国海证券有限责任公司	注册地址: 广西南宁市滨湖路 46 号	
		法定代表人: 张雅锋	联系人: 武斌
		电话: 0755-83707413	传真: 0755-83700205
		客服电话: 400-888-8100 (全国)、96100 (广西)	
		网址: <a href="http://www.ghzq.com.cn">www.ghzq.com.cn</a>	
35	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一大街 29 号	
		办公地址: 天津市河西区宾水道 3 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: <a href="http://www.bhzq.com">www.bhzq.com</a>
36	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: 石保上	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: <a href="http://www.ccnew.com">www.ccnew.com</a>	
37	国信证券股份有限公司	注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼	
		法定代表人: 何如	联系人: 齐晓燕
		电话: 0755-82130833	传真: 0755-82133952
		客服电话: 95536	网址: <a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>



38	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：黄健
		电话：0755-82943666	传真：0755-82943636
		网址： <a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>	
		客服电话：400-888-8111\95565	
39	兴业证券股份有限公司	注册地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦	
		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： <a href="http://www.xyjq.com.cn">www.xyjq.com.cn</a>
40	齐鲁证券有限公司	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：0531-68889752
		客服电话：95538	网址： <a href="http://www.qlyzq.com.cn">www.qlyzq.com.cn</a>
41	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： <a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a>
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： <a href="http://www.dgzq.com.cn">www.dgzq.com.cn</a>
43	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：常向东
		电话：0471-4913998	传真：0471-4930707
		客服电话：0471-4961259	网址： <a href="http://www.cnht.com.cn">www.cnht.com.cn</a>
44	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	
		法定代表人：卢长才	联系人：王飞
		电话：0755-83199511	客服电话：0755-83199511
		传真：0755-83199545	网址： <a href="http://www.csc.com.cn">www.csc.com.cn</a>

45	厦门证券有限公司	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：傅毅辉	联系人：卢金文
		电话：0592-5161642	传真：0592-5161140
		客服电话：0592-5163588	网址： <a href="http://www.xmzq.cn">www.xmzq.cn</a>
46	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： <a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>
47	英大证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层	
		法定代表人：赵文安	联系人：王睿
		电话：0755-83007069	传真：0755-83007167
		客服电话：400-869-8698	网址： <a href="http://www.ydsc.com.cn">www.ydsc.com.cn</a>
48	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： <a href="http://www.ci.cc.com.cn">www.ci.cc.com.cn</a>	
49	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： <a href="http://www.hfzq.com.cn">www.hfzq.com.cn</a>
50	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：010-66045500
		客服电话：010-66045678	网址： <a href="http://www.txsec.com">www.txsec.com</a>
51	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： <a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a>
52	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： <a href="http://www.e5618.com">www.e5618.com</a>
53	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： <a href="http://www.hlzqgs.com">www.hlzqgs.com</a>	
54	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： <a href="http://www.gyzq.com.cn">www.gyzq.com.cn</a>
55	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： <a href="http://www.hzbank.com.cn">www.hzbank.com.cn</a>
56	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： <a href="http://www.cbhb.com.cn">www.cbhb.com.cn</a>
57	青岛银行股份有限公司	注册地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦	
		法定代表人：郭少泉	联系人：滕克
		电话：0532-85709732	传真：0532-85709725
		客服电话：96588（青岛）400-669-6588（全国）	
		网址： <a href="http://www.qdccb.com">www.qdccb.com</a>	
58	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： <a href="http://www.westsecu.com">www.westsecu.com</a>
59	深圳发展银行股份有限公司	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：张青
		电话：0755-82088888	传真：0755-25841098
		客服电话：95501	网址： <a href="http://www.sdb.com.cn">www.sdb.com.cn</a>
60	德邦证券有限责任公司	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：罗芳
		电话：021-68761616	传真：021-68767981
		客服电话：4008888128	网址： <a href="http://www.tebon.com.cn">www.tebon.com.cn</a>
61	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： <a href="http://www.avicsec.com">www.avicsec.com</a>
62	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： <a href="http://www.bankofluoyang.com.cn">www.bankofluoyang.com.cn</a>	
63	东海证券有限责任公司	注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼	
		法定代表人：朱科敏	联系人：李涛
		电话：0519-88157761	传真：0519-88157761
		客服电话：400-888-8588	网址： <a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a>
64	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： <a href="http://www.foundersc.com">www.foundersc.com</a>
65	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	网址： <a href="http://www.i618.com.cn">www.i618.com.cn</a>

66	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：曾明 宋永成
		电话：0755-25188269	传真：0755-25188785
		客服电话：4001961200	网址： <a href="http://www.961200.net">www.961200.net</a>
67	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： <a href="http://www.xcsc.com">www.xcsc.com</a>
68	华融证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区月坛北街 26 号	
		法定代表人：丁之锁	联系人：陶颖
		电话：010-58568040	传真：010-58568062
		客服电话：010-58568118	网址： <a href="http://www.hrsec.com.cn">www.hrsec.com.cn</a>
69	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： <a href="http://www.rxzq.com.cn">www.rxzq.com.cn</a>
70	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： <a href="http://www.jhzq.com.cn">www.jhzq.com.cn</a>
71	广州证券有限责任公司	注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼	
		法定代表人：刘东	联系人：林洁茹
		电话：020-88836999	传真：020-88836654
		客服电话：020-961303	网址： <a href="http://www.gzs.com.cn">www.gzs.com.cn</a>
72	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： <a href="http://www.bankofdl.com">www.bankofdl.com</a>
73	天源证券经纪有限公司	注册地址：青海省西宁市长江路 53 号	
		法定代表人：林小明	联系人：王斌

		电话：0755-33331188	传真：0755-33329815
		客服电话：4006543218	网址：www.tyzq.com.cn
74	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：张玉静
		电话：0755-33227953	传真：0755-82080798
		客服电话：4006-788-877	
		网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com	

(二) 注册登记机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司	注册地址：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：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		法定代表人：陈勇胜	传真：021-38561800
		联系人：何晔	
		客户服务专线：400-888-8688，021-38569000	

(三) 担保人

序号	机构名称	机构信息	
1	重庆市三峡担保集团有限公司	注册地址：重庆市渝中区中华路178号国际商务中心6楼	
		办公地址：重庆市渝中区中华路178号国际商务中心6楼	
		法定代表人：李卫东	成立日期：2006年4月30日
		组织形式：有限责任公司	注册资本：叁拾亿元整
		经营范围：许可经营项目：从事融资性担保及法律、法规没有限制的其他担保和再担保业务。一般经营项目：利用自有资金从事投资业务（不得从事金融业务），企业营销策划及咨询服务，企业财务顾问。	

(四) 出具法律意见书的律师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	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	
		负责人：韩炯	联系人：黎明
		联系电话：021-31358666	传真：021-31358600

	经办律师：吕红、黎明
--	------------

(五) 审计基金财产的会计师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	普华永道中天会计师事务所有限公司	注册地址：中国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：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼	
		法人代表：杨绍信	联系人：单峰
		电话：021-61238888	传真：021-61238800
		经办注册会计师：汪棣、单峰	

**四、基金名称**

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金

**五、基金类型**

保本型、混合型

**六、基金运作方式**

契约型开放式

**七、基金投资目标**

在保证本金安全的前提下，力争在本基金保本期结束时，实现基金财产的增值。

**八、基金份额发售面值**

人民币 1.00 元

**九、基金存续期限**

不定期。

**十、基金保本期**

二年。自基金管理人公告的保本期开始日起至 2 个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则保本期到期日顺延至下一个工作日。

**十一、保本**

投资基金可控制符合条件的基金份额持有人投资净额损失的风险。在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本期默认选择转入当期保本期的基金份额持有人持有本基金到当期保本期到期的，由基金管理人对其投资净额承担保本义务，由担保人就保本期基金管理人所承担的前述保本义务的履行提供不可撤销的连带责任保证。

## 十二、基金的存续

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金为契约型开放式证券投资基金，基金管理人和基金注册登记人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的首次募集于 2006 年 3 月 16 日获中国证券监督管理委员会《关于同意国泰金鹿保本增值混合证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2006]43 号），募集期为 2006 年 3 月 24 日至 2006 年 4 月 25 日。募集期间募集及利息结转的基金份额共计 2,517,710,461.09 份基金份额，有效认购户数为 32542 户。《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 28 日正式生效。

本基金在第一个保本期期满后，在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下，本基金转入第二个保本期。第二个保本期的基金名称变更为“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）”。经本基金管理人与本基金托管人协商一致，中国证监会核准（证监许可[2008]583 号），国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）于 2008 年 5 月 6 日开始募集。《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》在基金募集结束后报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后于 2008 年 6 月 12 日生效。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人对《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（二期）基金合同》进行了修改，同时基金名称变更为“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金”。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

本基金的第三个保本期起始于 2010 年 7 月 2 日，并于 2012 年 7 月 2 日到期。针对本基金第四个保本期担保人的变更，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人对《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》进行了修改，并于 2012 年 6 月 11 日刊登了修订后的基金合同全文，本次修订后的基金合同于 2012 年 7 月 3 日起生效。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

本基金基金合同生效后的存续期间，连续二十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；法律法规另有规定的，按其规定办理。



### 十三、基金份额的申购与赎回

#### （一）申购与赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

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。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并至少在一种中国证监会指定媒体上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回、转换时间所在开放日的价格。

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

##### 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购与赎回自基金合同生效日后不超过三个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 3 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （二）申购与赎回的场所

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或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与赎回。基金管理人可根据情况变更增减代销机构，并予以公告。

#### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，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赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、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；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 日予以公告。

#### （四）申购与赎回的数额限定

### 1、申购金额的限制

基金管理人网上交易及代销机构每个账户单笔申购的最低金额为 1000 元（含申购费）；直销机构每个账户每次申购本基金的最低金额为 1 万元（含申购费）。

### 2、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 100 份基金份额，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额不足 100 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

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

## （五）申购和赎回的程序

### 1、申购与赎回申请的提出

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内提出申购或赎回的申请。

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。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

### 2、申购与赎回申请的确认

注册登记机构应在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。”

### 3、申购与赎回申请的款项支付

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本基金合同和有关法律法规规定处理。

## （六）申购和赎回的数额与价格

### 1、申购份额的处理方式

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

（2）赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回净额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入

方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2、申购份额的计算

申购份额的计算方法如下：

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

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

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

（注：对于 500 万（含）以上的申购适用绝对数额的申购费金额，即净申购金额 = 申购金额 - 申购费用）

3、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

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

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

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

4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值的计算公式为：

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

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

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

（七）基金的申购费与赎回费及其用途

1、申购费用

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

本基金的申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
50 万元以下	1.2%
50 万元（含）— 200 万元	0.8%
200 万元（含）— 500 万元	0.4%
500 万元（含）以上	1000 元/笔

举例说明如下：

某投资者以 40 万元申购本基金，申购费率为 1.2%，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：

$$\text{净申购净额} = 400,000 / (1 + 1.2\%) = 395,256.91 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 400,000 - 395,256.91 = 4743.09 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 395,256.91 / 1.100 = 359,324.46 \text{ 份}$$

即投资者以 40 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 359,324.46 份。

## 2、赎回费用

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付销售、注册登记等机构的相关手续费。

本基金的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
6个月以下（含）	1.8%
6个月—2年	1.0%
2年（含）以上	0

（注：1 年按 365 天计算；6 个月按 183 天计算；基金份额持有人持有时间的计算，以其份额在注册登记机构的注册登记日开始计算。）

举例说明：

某基金份额持有人赎回持有不超过 6 个月的 1000 份基金份额，赎回对应的赎回费率为 1.8%，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：

$$\text{赎回金额} = 1000 \times 1.100 = 1100 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 1100 \times 1.8\% = 19.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 1100 - 19.80 = 1080.20 \text{ 元}$$

即基金份额持有人赎回持有不超过 6 个月的 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 1080.20 元。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人最迟应在调整实施前 2 日在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

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

## （八）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

#### （九）过渡期申购的特别规定

基金管理人应在当期保本期到期前公告处理规则，允许投资者在下一个保本期开始前的过渡期限定期限内申请购买本基金基金份额，投资者在上述期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。投资者在过渡期限定期限内申购本基金的，按其申购的基金份额在折算日所代表的资产净值确认下一保本期的投资净额并适用下一保本期的保本条款。

基金管理人在当期保本期到期前，将根据担保人提供的下一个保本期担保额度确定并公告下一个保本期的担保规模上限，规模控制的具体方案详见当期保本期到期前公告的处理规则。

投资者在过渡期内指定期限外的开放日或者在下一保本期开始后的开放日申购本基金的，不适用下一保本期的保本条款。

## 十四、投资目标

在保证本金安全的前提下，力争在本基金保本期结束时，实现基金财产的增值。

## 十五、投资范围

本基金为保本增值混合基金，投资范围包括国内依法公开发行的各类债券、股票以及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 60%，投资于股票、权证等其他资产不高于基金资产的 30%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 十六、投资理念

价格终将反映价值。

## 十七、投资策略

本基金采用固定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）技术和基于期权的组合保险（OBPI，Option-Based Portfolio Insurance）技术相结合的投资策略。通过量化的资产类属配置达到本金安全。用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损，并通过投资可转债及股票等风险资产来获得资本利得。

本基金的主体保本技术为 CPPI 技术。在具体操作过程中，CPPI 技术主要用来确定安全资产和风险资产的比例，而 OBPI 技术主要运用于可转换债券的投资，它是建立在 CPPI 技术基础之上的必要补充。

债券投资策略：本基金对可转债以外的债券投资在策略上分为两个部分，其中一部分采取被动式的资产负债管理策略，以其现金净流入冲抵可转债等风险资产组合可能发生的亏损。另一部分采取积极的债券投资策略，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组合管理。

可转债投资策略：本基金运用国际普遍使用的二叉树模型计算可转债所含期权的价值，结合该可转债的债券价值对可转债进行相对价值评估，根据本溢价率排序和行业资金配置情况确定最终的可转债投资组合。

股票投资策略：本基金把握可转债与股票之间出现的无风险套利机会。谨慎参与一级市场股票首发和增发，以获得一、二级市场之间的利润。在构造股票组合时，采取自上而下的方法，定量分析与定性分析相结合，通过组合管理有效规避个股的非系统性风险，通过行业精选确定拟投资的优势行业及相应比例，通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

权证投资策略：本基金主要采用国际上通行的权证定价模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，对有关参数特别是股票价格的隐含波动率进行修正，得出权证理论价格，作为基金投资权证的基础依据。本基金对权证的投资主要用于锁定收益和控制风险。

## 十八、业绩比较基准

本基金以 2 年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。

上述业绩比较基准是在考虑了本基金的投资策略、保本期限、客户构成及资金来源性质等特点的基础上制订的。如果今后市场有其他代表性更强的业绩比较基准推出，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致并公告后可以变更上述业绩比较基准，无需召开基金份额持有人大会。

## 十九、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种。投资人可获得投资净额保本担保。未持有到期而赎回的基金份额以及日常申购的基金份额，不享受保本担保。

## 二十、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规定，于2012年4月17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2012年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	65,650,513.79	4.10
	其中：股票	65,650,513.79	4.10
2	固定收益投资	1,455,762,000.00	90.95
	其中：债券	1,455,762,000.00	90.95
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	19,950,149.93	1.25
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	15,530,333.37	0.97
6	其他各项资产	43,699,976.55	2.73
7	合计	1,600,592,973.64	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	9,001,798.65	0.57
B	采掘业	-	-
C	制造业	42,840,447.43	2.69
C0	食品、饮料	8,019,600.00	0.50
C1	纺织、服装、皮毛	6,517,239.75	0.41
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,516,000.00	0.10
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	26,787,607.68	1.68

C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	7,592,872.96	0.48
K	社会服务业	6,215,394.75	0.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	65,650,513.79	4.13

(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	600335	*ST 盛工	929,224	14,932,629.68	0.94
2	002176	江特电机	666,010	11,854,978.00	0.75
3	002477	雏鹰农牧	289,913	9,001,798.65	0.57
4	000671	阳光城	939,712	7,592,872.96	0.48
5	002293	罗莱家纺	89,955	6,517,239.75	0.41
6	002400	省广股份	269,785	6,029,694.75	0.38
7	600887	伊利股份	200,000	4,408,000.00	0.28
8	600519	贵州茅台	10,000	1,969,600.00	0.12
9	000858	五粮液	50,000	1,642,000.00	0.10
10	600527	江南高纤	200,000	1,516,000.00	0.10

(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	90,080,000.00	5.66
2	央行票据	96,820,000.00	6.08
3	金融债券	50,055,000.00	3.15



	其中：政策性金融债	50,055,000.00	3.15
4	企业债券	210,378,000.00	13.22
5	企业短期融资券	978,318,000.00	61.48
6	中期票据	30,111,000.00	1.89
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,455,762,000.00	91.48

（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	0980110	09 远洋地产债	1,800,000	180,414,000.00	11.34
2	1181183	11 津城建 CP01	1,000,000	100,810,000.00	6.34
3	1101030	11 央行票据 30	1,000,000	96,820,000.00	6.08
4	1181318	11 甘电投 CP01	700,000	70,707,000.00	4.44
5	1181268	11 兰花 CP01	600,000	60,474,000.00	3.80

（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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的情况；本基金投资的前十名证券的发行主体除五粮液之外，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

根据 2011 年 5 月 28 日五粮液发布的相关公告，该公司于 2011 年 5 月 27 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2011]17 号），经查明，五粮液信息披露存在以下四项违法事实：五粮液关于四川省宜宾五粮液投资（咨询）有限责任公司对成都智溢塑胶制品有限公司在亚洲证券有限责任公司的证券投资款的《澄清公告》存在重大遗漏；五粮液在中国科技证券有限责任公司的证券投资信息披露不及时、不完整；五粮液 2007 年年度报告存在录入差错未及时更正；五粮液未及时披露董事被司法羁押事项。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》一百九十三条的规定，证监会决定对五粮液给予警告，并处以 60 万元罚款，对相关自然人分别处以 3-25 万元罚款。

本基金管理人此前投资该股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就五粮液受调查事件进行了及时分析和研究，认为五粮液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、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	359,478.04
2	应收证券清算款	115,798.70
3	应收股利	-
4	应收利息	43,057,847.36
5	应收申购款	166,852.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,699,976.55

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 二十一、基金的业绩

本基金业绩截止日为2011年12月31日，并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪守信守、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
2008年6月12日至2008年12月31日	5.10%	0.08%	2.30%	0.00%	2.80%	0.08%
2009年度	5.06%	0.11%	2.79%	0.00%	2.27%	0.11%
2010年度	-1.39%	0.18%	2.89%	0.00%	-4.28%	0.18%

2011 年度	-1.49%	0.13%	4.17%	0.01%	-5.66%	0.12%
2008 年 6 月 12 日至 2011 年 12 月 31 日	7.26%	0.13%	12.15%	0.01%	-4.89%	0.12%

## 二十二、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的证券交易费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

7、在有关规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，销售服务费的具体计提方法、计提标准在招募说明书或有关公告中载明。

- 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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.10% 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 1.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 2、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 0.20% 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 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

3、本部分第一条 1 款至 8 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

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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（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。

### 二十三、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》、《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2012年1月20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，增加了本基金第三个保本期转为第四个保本期的相关提示，并更新了招募说明书内容的截止日期；
- 2、在“第二节 释义”部分，更新了“担保人”、“基金份额持有人大会”、“投资净额”、“《保证合同》”、“持有到期”、“保本期到期日”等释义；
- 3、更新了“第三节 基金管理人”中的相关信息；
- 4、更新了“第四节 基金托管人”中的相关信息；
- 5、更新了“第五节 相关服务及担保机构”的相关信息；
- 6、更新了“第六节 基金的基本情况”中有关“保本”和“保本期”的相关内容；
- 7、更新了“第七节 基金的存续”中本基金第三个保本期转为第四个保本期的相关内容；
- 8、更新了“第九节 保本”中的相关内容；
- 9、更新了“第十节 担保”中的相关内容，本基金第四个保本期由重庆市三峡担保集团有限公司为担保人；
- 10、更新了“第十一节 基金的投资”中“风险收益特征”的相关内容，并更新基金投资组合报告为本基金2012年1季度报告的内容；
- 11、更新了“第十二节 基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核；

- 12、更新了“第十三节 基金的财产”中关于“基金财产的账户”的相关内容；
- 13、更新了“第二十节 保本期到期”的相关内容；
- 14、更新了“第二十二节 基金合同内容摘要”中的“附件（《保证合同》）”的内容；
- 15、更新了“第二十四节 对基金份额持有人的服务”的相关内容；
- 16、更新了“第二十五节 其他应披露事项”，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](http://www.gtfund.com)。

国泰基金管理有限公司

二〇一二年七月二日