

国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

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成。依据中国证监会 2009 年 9 月 8 日证监许可[2009]925 号文核准的金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议，金盛证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）。自 2009 年 10 月 19 日起，由《金盛证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称基金合同）的约定，本基金自 2015 年 8 月 8 日起基金类别变更为混合型基金，基金名称由国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）修改为国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF），基金合同部分条款相应修订。

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、勤勉尽责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。

投资有风险，投资人集中申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，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于集中申购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人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。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

投资有风险，投资人在申购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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 10 月 19 日，投资组合报告为 2017 年 3 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：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 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：壹亿壹千万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：021-31089000，4008888688

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 10 月 19 日，本基金管理人共管理 101 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、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰

稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

三、主要人员情况

（一）董事会：

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，现任战略发展部部长。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。

SantoBorsellino，董事，硕士研究生。1994-1995 年在 BANKOFITALY 负责经济研究；1995 年在 UNIVERSITYOFBOLOGNA 任金融部助理，1995-1997 年在 ROLOFINANCEUNICREDITOITALIANOGROUPSOFIPASpA 任金融分析师；1999-2004 年在 LEHMANBROTHERSINTERNATIONAL 任股票保险研究员；2004-2005 年任 URWICKCAPITALLLP 合伙人；2005-2006 年在 CREDITSUISSE 任副总裁；2006-2008 年在 EURIZONCAPITALSGRSpA 历任研究员/基金经理。2009-2013 年任 GENERALIINVESTMENTSEUROPE 权益部总监。2013 年 6 月起任 GENERALIINVESTMENTSEUROPE 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（CharteredInsurer）。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。

（二）监事会：

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。

YeziPherozeChinoy，监事，大学本科。1995年12月至2000年5月在JardineFlemingIndia任公司秘书及法务。2000年9月至2003年2月，在DresdnerKleinwortBenson任合规部主管、公司秘书兼法务。2003年3月至2008年1月任JPMorganChaseIndia合规部副总经理。2008年2月至2008年8月任PrudentialPropertyInvestmentManagementSingapore法律及合规部主管。2008年8月至2014年3月任AllianzGlobalInvestorsSingaporeLimited东南亚及南亚合规部主管。2014年3月17日起任GeneralInvestmentsAsiaLimited首席执行官。2016年12月1日起任GeneralInvestmentsAsiaLimited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。2017年7月起任权益投资总监。2015年8月起任公司职工监事。

倪莹，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。

（三）高级管理人员：

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

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、本基金基金经理

（1）现任基金经理

杨飞，硕士研究生，9年证券基金从业经历。2008年7月至2009年8月在诺德基金管理有限公司任助理研究员，2009年9月至2011年2月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011年2月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014年10月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2015年3月起兼任国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（原国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015年5月起兼任国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（原国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015年5月至2016年5月任国泰成长优选混合型证券投资基金（原国泰成长优选股票型证券投资基金）的基金经理，2016年2月至2017年10月兼任国泰大健康股票型证券投资基金的基金经理，2016年4月至2017年5月任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2017年3月起兼任国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

（2）历任基金经理

自本基金成立起至 2013 年 6 月 12 日由张玮担任基金经理，自 2013 年 6 月 13 日起至 2014 年 7 月 15 日由张玮和周伟锋共同担任基金经理，自 2014 年 7 月 16 日起至 2015 年 5 月 10 日由张玮担任基金经理，自 2015 年 5 月 11 日起至今由杨飞担任基金经理。

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：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

陈星德：副总经理

吴晨：固收投资总监、绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作）

邓时锋：权益投资总监、权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：海外投资总监、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)67595096

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。

原珏，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、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：陈四清 联系人：客户服务中心

客服电话：95566 网址：www.boc.cn

4 中国建设银行股份有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：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：李建红 联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888 传真：0755-83195109

客户服务热线：95555 网址：www.cmbchina.com

7 上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：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 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
- 15 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
- 16 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
- 17 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
- 18 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
- 19 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
- 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：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
- 21 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

22 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

23 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：www.xyzq.com.cn

24 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

25 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.msyzq.com

26 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

27 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

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：www.962518.com

29 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：徐丽峰 联系人：周欣玲

电话：0791-86281305 传真：0791-86281305

网址：www.gsstock.com

30 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、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

31 广发证券股份有限公司 注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广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

32 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

33 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.bhjq.com

34 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

35 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

36 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

37 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

38 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

39 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

40 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

41 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

42 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

43 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

44 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

45 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

46 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

47 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

48 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

49 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

50 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

51 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

52 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

53 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

54 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

55 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

56 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

57 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

58 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

59 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

60 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

61 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

62 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

63 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

64 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

65 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

66 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：www.swsc.com.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 开源证券有限责任公司 注册地址：西安市锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚 联系人：王姣

电话：029-68633210 客服电话：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

69 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

70 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

71 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.gjqz.com.cn

72 中信期货有限公司 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层

1301-1305 室、14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓 联系人：洪诚

电话：0755-23953913 传真：0755-83217421

网址：www.citicsf.com

73 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

74 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

75 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

76 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

77 浙商银行股份有限公司 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

客服电话：95527

网址：www.czbank.com

78 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：02158787698

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：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：北京市西城区阜成门大街 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 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公园 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

20 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

21 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

22 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

公司地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

客户服务电话：400-166-1188

法定代表人：张彦 联系人：文雯

电话：010-83363101

网址：8.jrj.com.cn

23 上海凯石财富基金销售有限公司 注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表：陈继武 联系人：李晓明

电话：021-63333319 传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

网址：www.lingxianfund.com

24 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：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

25 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：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

26 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：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

272 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：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.snjjjin.com

283 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

293 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

303 北京格上富信基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章 联系人：曹庆展

电话：010-68983311 传真：010-65983333

客服电话：400-066-8586

网址：www.igesafe.com

313 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

323 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 SOHOT2B 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

333 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

343 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

法定代表人：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

（二）注册登记机构

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：周明

联系电话：021-58872935

传真：021-68870311

联系人：郑奕莉

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：李一

经办注册会计师：许康玮、李一

四、基金的名称

国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)

五、基金类型和存续期限

1、基金的类别：混合型证券投资基金；

2、基金的运作方式：契约型开放式；

3、基金存续期限：不定期。

六、投资目标

本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求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，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、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金融工具。

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。

本基金股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、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金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有高成长性和良好基本面的中小盘成长股票。

基金管理人每季末将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，选择累计流通市值占 A 股总流通市值前 1/2 的股票，称为中小盘股票。

如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前三个工作日公告变更后具体的计算方法。

如法律法规或中国证监会修改对基金投资品种的规定，基金管理人在履行相应程序后，可以依据新的规定修订基金的投资范围及投资比例。

八、投资策略

基金管理人在构建投资组合的过程中，遵循以下投资策略：

1、资产配置策略

根据宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围、组合投资止损点，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置初始比例，再进行综合的对比分析和评估后作出大类资产配置方案。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：

战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足基金风险-回报率目标的资产组合。

战术性资产配置根据过去的各类资产长短期平均回报率不同，预测其未来的短期性回报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。

2、股票投资策略

(1) 股票选择过程

本基金的股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象，采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。首先，通过对股票的流通市值进行排序，构成中小盘上市公司股票池；其次，利用成长因子筛选出具有成长性的上市公司，构成具有成长优势的中小盘股票池；最后，通过相对价值评估以及实地调研，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票投资组合。

(2) 成长型股票筛选

本基金对中小盘股票池的股票的成长性筛选采用成长因子，主要包括销售收入增长率、净利润增长率、总资产增长率、净资产收益率增长率等，对上市公司进行成长性评价，分析和预测企业未来的成长性，剔除不符合本基金投资要求的股票，筛选出近期成长性高的股票，形成二级股票备选池。

(3) 相对价值评估分析

在二级股票备选池范围内，本基金利用相对价值评估，形成可投资的股票组合。相对价值评估主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，将国内上市公司的有关估值与国际公司相应指标进行比较，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括股息贴现模型、自由现金流贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA 等方法。

(4) 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上市公司的上游供货商、下游客户、竞争对手和业务合作伙伴，以及税务、海关等行政管理部门对调研结论进行核实。

(5) 建立投资组合

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立买入和卖出股票名单，并选择合理时机，稳步建立投资组合。在建立投资组合过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，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，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

以对长期利率预期为基础确定期限结构。在预期利率下降时，增加组合久期，提高债券价格上升产生的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，降低债券价格下降产生的损失。如果预期市场收益率曲线作强烈的整体向上平移，降低债券组合的整体持仓比例，同时降低组合久期，来使组合损失降到最低。

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

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

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

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

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

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

央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

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

由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；

市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；

单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

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实现稳健的超额收益。

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。

九、业绩比较基准

本基金的业绩基准=35%天相中盘成长指数+45%天相小盘成长指数+20%中证全债指数

天相风格指数系列包含三个规模风格指数天相大盘、天相中盘和天相小盘，以及六个价值成长风格指数大盘价值、大盘成长、中盘价值、中盘成长、小盘价值和小盘成长。编制方法是：将股票按照流通市值排序，累计流通市值前30%的股票为天相大盘，累计流通市值中间40%的股票为天相中盘，累计流通市值后30%的股票为天相小盘。然后在每个规模类中将股票按照B/P值分成价值成长，并保证每个规模类的价值成长指数的流通市值相同。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

十、风险收益特征

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

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 10 月 24 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 2017 年 9 月 30 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 3,935,934,188.96 93.66

其中：股票 3,935,934,188.96 93.66

2 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 256,827,023.02 6.11

7 其他各项资产 9,650,299.98 0.23

8 合计 4,202,411,511.96 100.00

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 62,896,600.00 1.50

B 采矿业 --

--

C 制造业 2,712,795,308.34 64.86

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 681,925,539.18 16.30

F 批发和零售业 63,512,509.71 1.52

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 35,084,259.00 0.84

J 金融业 41,313,718.80 0.99

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 338,406,253.93 8.09

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 --

R 文化、体育和娱乐业 --

S 综合 --

合计 3,935,934,188.96 94.10

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	002217	合力泰	33,980,307	382,278,453.75	9.14
2	300296	利亚德	18,440,573	371,577,545.95	8.88
3	300197	铁汉生态	25,679,131	347,695,433.74	8.31
4	300355	蒙草生态	26,212,723	338,406,253.93	8.09
5	600056	中国医药	13,676,995	334,539,297.70	8.00
6	002310	东方园林	15,908,144	334,230,105.44	7.99
7	300274	阳光电源	13,718,493	230,882,237.19	5.52
8	600703	三安光电	7,260,287	168,003,041.18	4.02
9	300145	中金环境	9,394,910	162,625,892.10	3.89
10	600487	亨通光电	4,715,000	162,196,000.00	3.88

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,222,086.05

2 应收证券清算款 2,812,841.65

3 应收股利 -

- 4 应收利息 59,847.81
- 5 应收申购款 5,555,524.47
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 9,650,299.98

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 300145 中金环境 162,625,892.10 3.89 重大事项

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 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2009 年 10 月 19 日至 2009 年 12 月 31 日 9.84% 0.53% 12.03% 1.47% -2.19% -0.94%

2010 年度 8.20% 1.34% 8.44% 1.38% -0.24% -0.04%

2011 年度 -21.74% 1.21% -27.53% 1.17% 5.79% 0.04%

2012 年度 0.70% 1.20% 1.79% 1.21% -1.09% -0.01%

2013 年度 30.13% 1.47% 9.93% 1.09% 20.20% 0.38%

2014 年度 26.63% 1.41% 21.62% 0.93% 5.01% 0.48%

2015 年度 88.54% 2.97% 42.14% 2.13% 46.40% 0.84%

2016 年度 0.45% 1.96% -15.26% 1.52% 15.71% 0.44%

2017 年上半年 20.79% 1.00% -3.48% 0.69% 24.27% 0.31%

2009 年 10 月 19 日至 2017 年 6 月 30 日 253.08% 1.69% 39.27% 1.37% 213.81% 0.32%

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、基金上市初费及上市月费；
- 4、基金财产划拨支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、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、基金托管人在法律规定的范围内参照公允的市场价格按实列支，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 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 3 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 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

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 3 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）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整基金管理费率和基金托管费率。调高基金管理费、基金托管费等，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费、基金托管费等，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（六）与基金销售有关的费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书十、基金份额的申购、赎回与转换中的(六)申购与赎回的费率与(七)申购份数与赎回金额的计算方式中的相关规定。

（七）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照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 6 月 2 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、更新了十一、基金的投资中基金投资组合报告，更新至 2017 年 9 月 30 日；
- 6、更新了十二、基金的业绩，更新至 2017 年 6 月 30 日；
- 7、更新了二十二、托管协议内容摘要中的相关内容；
- 8、更新了二十五、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

二一七年十二月二日