

# 上证 180 金融交易型开放式指数 证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019 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

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 2 月 17 日证监许可[2011]239 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 3 月 31 日正式生效。

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。投资者在投资本基金前，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。投资者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。投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、IOPV 计算错误的风险、基金的退市风险、投资者申购赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

投资有风险，投资者认购（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者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 3 月 31 日，投资组合报告为 2019 年 1 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室

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

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

### (二) 基金管理人管理基金的基本情况

截至 2019 年 3 月 31 日，本基金管理人共管理 104 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)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金(由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来,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、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、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、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、国泰安康定期支付混合型证券投资基金(由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来)、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、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、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、国泰创业板指数证券投资基金(LOF)、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、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、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、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）、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）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）。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 1 月至 1992 年 10 月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年 11 月至 1998 年 2 月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理。1998 年 3 月至 2015 年 10 月在国泰基金管理有限公司工作，其中 1998 年 3 月至 1999 年 10 月任总经理，1999 年 10 月至 2015 年 8 月任董事长。2015 年 1 月至 2016 年 8 月，在中建投信托有限责任公司任纪委书记，2015 年 3 月至 2016 年 8 月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016 年 8 月至 11 月，在建投投资有限责任公司、建投传媒华文公司任监事长、纪委书记。2016 年 11 月起调入国泰基金管理有限公司任公司党委书记，2017 年 3 月起任公司董事长、法定代表人。

方志斌，董事，硕士研究生。2005 年 7 月至 2008 年 7 月，任职宝钢国际经营财务部。2008 年 7 月至 2010 年 2 月，任职金茂集团财务总部。2010 年 3 月至今，在中国建银投资有限责任公司工作，历任长期股权投资部助理业务经理、业务经理，战略发展部业务经理、处长。2014 年 4 月至 2015 年 11 月，任建投华科投资有限责任公司董事。2014 年 2 月至 2017 年 11 月，任中国投资咨询有限责任公司董事。2017 年 12 月起任公司董事。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006 年 7 月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任股权管理部业务副经理、业务经理，资本市场部业务经理，策略投资部助理投资经理，公开市场投资部助理投资经理，战略发展部业务经理、组负责人，战略发展部处长，现任战略发展部总经理助理。2014 年 5 月起任公司董事。

Santo Borsellino，董事，硕士研究生。1994-1995 年在 BANK OF ITALY 负责经济研究；1995 年在 UNIVERSITY OF BOLOGNA 任金融部助理，1995-1997 年在 ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP - SOFIPA SpA 任金融分析师；1999-2004 年在 LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL 任股票保险研究员；2004-2005 年任 URWICK CAPITAL LLP 合伙人；2005-2006 年在 CREDIT SUISSE 任副总裁；2006-2008 年在 EURIZONCAPITAL SGR SpA 历任研究员/基金经理。2009-2013 年任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 权益部总监。2013 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 年至 1994 年任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994 年至 1996 年任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996 年至 1998 年任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998 年至 2017 年任忠利亚洲中国地区总经理；2002 年至今任中意人寿保险有限公司董事；2007 年至今任中意财产保险有限公司董事；2007 年至 2017 年任中意财产保险有限公司总经理；2013 年至今任中意资产管理有限公司董事；2017 年至今任忠利集团大中华区股东代表。2010 年 6 月起任公司董事。

丁琪，董事，硕士，高级政工师。1994 年 7 月至 1995 年 8 月，在西北电力集团物资总公司任财务科职员。1995 年 8 月至 2000 年 5 月，在西北电力集团财务有限公司任财务部干事。2000 年 6 月至 2005 年 8 月，在国电西北公司财务部任成本电价处干事、资金运营处副处长。2005 年 8 月至 2012 年 10 月，在中国电力财务有限公司西北分公司任副总经理（主持工作）、总经理、党组副书记。2012 年 10 月至 2014 年 11 月，在中国电力财务有限公司华中分公司任总经理、党组副书记。2014 年 11 月至今，在中国电力财务有限公司任副总经理、党组成员、党委委员。2019 年 4 月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，23 年金融从业经历。1996 年 7 月至 2004 年 12 月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004 年 12 月至 2011 年 1 月在中国建银投资有限责任公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011 年 1 月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012 年 11 月至 2016 年 7 月任公司副总经理，2016 年 7 月起任公司总经理及公司董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986 年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，先后任助教、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 年起在工商银行工作，历任河北沧州市支行主任、副行长；河北省分行办公室副主任、信息处处长、副处长；河北保定市分行行长、党组副书记、书记；河北省分行副行长、行长、党委书记；2004 年起任工商银行山

西省分行行长、党委书记;2007 年起任工商银行工会工作委员会常务副主任;2010 年至 2014 年任北京银泉大厦董事长。2014 年 10 月起任公司独立董事。

黄晓衡, 独立董事, 硕士研究生, 高级经济师。1975 年 7 月至 1991 年 6 月, 在中国建设银行江苏省分行工作, 先后任职于计划处、信贷处、国际业务部, 历任副处长、处长。1991 年 6 月至 1993 年 9 月, 任中国建设银行伦敦代表处首席代表。1993 年 9 月至 1994 年 7 月, 任中国建设银行纽约代表处首席代表。1994 年 7 月至 1999 年 3 月, 在中国建设银行总行工作, 历任国际部副总经理、资金计划部总经理、会计部总经理。1999 年 3 月至 2010 年 1 月, 在中国国际金融有限公司工作, 历任财务总监、公司管委会成员、顾问。2010 年 4 月至 2012 年 3 月, 任汉石投资管理有限公司(香港)董事总经理。2013 年 8 月至 2016 年 1 月, 任中金基金管理有限公司独立董事。2017 年 3 月起任公司独立董事。

吴群, 独立董事, 博士研究生, 高级会计师。1986 年 6 月至 1999 年 1 月在中国财政研究院研究生部会计教研室工作, 历任讲师、副研究员、副主任、主任。1991 年起兼任中国财政研究院研究生部(财政部财政科研所研究生部)硕士生导师。1999 年 1 月至 2003 年 6 月在沪江德勤北京分所工作, 历任技术部/企业风险管理部高级经理、总监, 管理咨询部总监。2003 年 6 月至 2005 年 11 月, 在中国电子产业工程有限公司工作, 担任财务部总经理。2014 年 9 月至 2016 年 7 月任中国上市公司协会军工委员会副会长, 2016 年 8 月至 2018 年 1 月任中国上市公司协会军工委员会顾问。2005 年 11 月至 2016 年 7 月在中国电子信息产业集团有限公司工作, 历任审计部副主任、资产部副主任(主持工作)、主任。2012 年 3 月至 2016 年 7 月, 担任中国电子信息产业集团有限公司总经济师。2003 年 1 月至 2016 年 11 月, 在中国电子信息产业集团有限公司所投资的境内外多个公司担任董事、监事。2017 年 5 月起兼任首约科技(北京)有限公司独立董事。2017 年 10 月起任公司独立董事。

## 2、监事会成员

梁凤玉, 监事会主席, 硕士研究生, 高级会计师。1994 年 8 月至 2006 年 6 月, 先后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、基金经理助理, 2008 年 4 月至 2018 年 3 月任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理, 2009 年 5 月至 2018 年 3 月任国泰区位优势混合型证券投资基金(原国泰区位优势股票型证券投资基金)的基金经理, 2013 年 9 月至 2015 年 3 月任国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)的基金经理, 2015 年 9 月至 2018 年 3 月任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。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, 历任信息技术部总监、运营管理部总监, 现任公司总经理助理。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, 历任审计部总监助理、纪检监察室副主任, 现任审计部总监、风险管理部总监。2017 年 3 月起任公司职工监事。

### 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。

李辉, 大学本科, 19 年金融从业经历。1997 年 7 月至 2000 年 4 月任职于上海远洋运输公司, 2000 年 4 月至 2002 年 12 月任职于中宏人寿保险有限公司, 2003 年 1 月至 2005 年 7



月任职于海康人寿保险有限公司，2005 年 7 月至 2007 年 7 月任职于 AIG 集团，2007 年 7 月至 2010 年 3 月任职于星展银行。2010 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人，2015 年 8 月至 2017 年 2 月任公司总经理助理，2017 年 2 月起担任公司副总经理。

封雪梅，硕士研究生，21 年金融从业经历。1998 年 8 月至 2001 年 4 月任职于中国工商银行北京分行营业部；2001 年 5 月至 2006 年 2 月任职于大成基金管理有限公司，任高级产品经理；2006 年 3 月至 2014 年 12 月任职于信达澳银基金管理有限公司，历任市场总监、北京分公司总经理、总经理助理；2015 年 1 月至 2018 年 7 月任职于国寿安保基金管理有限公司，任总经理助理；2018 年 7 月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，20 年金融从业经历。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、稽查处二处副处长等；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，担任公司督察长，2019 年 3 月起转任公司副总经理。

刘国华，博士研究生，25 年金融从业经历。曾任职于山东省国际信托投资公司、万家基金管理有限公司；2008 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，先后担任产品规划部总监、公司首席产品官、公司首席风险官，2019 年 3 月起担任公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

艾小军，硕士，18 年证券基金从业经历。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5

月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任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）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金和国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监（量化）、金融工程总监。

## （2）历任基金经理

自本基金成立以来至 2014 年 1 月由章贇担任基金经理，自 2014 年 1 月至 2014 年 6 月由章贇和艾小军共同担任本基金的基金经理，2014 年 6 月起至今由艾小军担任本基金的基金经理。

## 5、本基金投资决策委员会成员

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

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

周向勇：总经理

执行委员：

张玮：总经理助理

委员：

吴晨：固收投资总监、绝对收益投资（事业）部总监

邓时锋：FOF 投资总监

吴向军：海外投资总监、国际业务部总监

胡松：养老金投资总监、养老金及专户投资（事业）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）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2019 年 3 月 31 日，中国银行已托管 710 只证券投资基金，其中境内基金 670 只，

QDII 基金 40 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额销售机构

##### 1、申购赎回代理券商

序号	机构名称	机构信息	
1	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	
		办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼	
		法定代表人：杨德红	
		客服电话：95521	网址：www.gtja.com
2	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：无
		客服电话：95587 4008-888-108	网址：www.csc108.com
3	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
4	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	
5	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层	
		办公地址：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：陈共炎	

		客服电话：4008-888-888 或 95551	网 址： www.chinastock.com.cn
6	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	
7	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：陈飙
		电话：021-33388254	客服电话：95523 4008895523
		网址：www.swhysc.com	
8	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	
		办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号	
		法定代表人：杨华辉	
		客服电话：95562	网址：www.xyq.com.cn
9	上海证券有限责 任公司	注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼	
		法定代表人：李俊杰	联系人：邵珍珍
		电话：021-53686888	传真：021-53686100-7008
		客服电话：4008918918	网址：www.shzq.com
10	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	
11	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：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦	
		法定代表人：孙树明	
		客服电话：95575	网址：www.gf.com.cn
12	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	

		办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
		法定代表人：张佑君
		客服电话：95548      网址：www.cs.ecitic.com
13	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：天津市南开区滨水西道 8 号
		法定代表人：王春峰      联系人：蔡霆
		电话：022-28451991      传真：022-28451892
		客服电话：400-651-5988      网址：www.ewww.com.cn
14	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
		客服电话：95538      网址：www.zts.com.cn
15	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
		办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
		法定代表人：王连志
		客服电话：400-800-1001
		网址：www.essence.com.cn
16	东莞证券股份有 限公司	注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
		法定代表人：陈照星      联系人：李荣
		电话：0769-22115712      传真：0769-22115712
		客服电话：95328      网址：www.dgzq.com.cn
17	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
		办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层
		法定代表人：高涛
		客服电话：95532      网址：www.china-invs.cn

18	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
19	中国民族证券有限责任公司	注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼	
		办公地址：北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼	
		法定代表人：姜志军	
		客服电话：400-889-5618	网址：www.e5618.com
20	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
21	平安证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
		法定代表人：何之江	联系人：王阳
		电话：021-38637436	传真：021-33830395
		客服电话：95511-8	网址：stock.pingan.com
22	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
23	中航证券有限公司	注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层	
		办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号 中航资本大厦 35 层	
		法定代表人：王晓峰	
		客服电话：95335	网址：www.avicsec.com
24	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717	
		办公地址：北京市朝阳区北四环 27 号盘古大观 A 座 40 楼	
		法定代表人：施华	
		客服电话：95571	网址：www.foundersc.com

25	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	
26	湘财证券股份有 限公司	注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	
		办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	
		法定代表人：孙永祥	
		客服电话：95351	网址：www.xcsc.com
27	红塔证券股份有 限公司	注册地址：昆明北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼	
		法定代表人：况雨林	联系人：刘晓明
		电话：0871-3577942	传真：0871-3578827
		客服电话：0871-3577930	网址：www.hongtastock.com
28	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：李琦	联系人：王怀春
		电话：0991-2307105	传真：0991-2301927
		客服电话：4008000562	网址：www.hysec.com
29	西藏东方财富证 券股份有限公司	注册地址：拉萨市北京中路 101 号	
		办公地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号	
		法定代表人：陈宏	联系人：帅炜炜
		电话：021-36532109	传真：021-36531910
		客服电话：4009112233	网址：www.xzsec.com

## 2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时公告。

## (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：周明

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：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：魏佳亮

经办注册会计师：许康玮、魏佳亮

## **四、基金的名称**

上证180金融交易型开放式指数证券投资基金

## 五、基金类型和存续期限

- 1、基金类型：股票型
- 2、基金运作方式：交易型开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

## 六、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 七、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%。

如法律法规或监管机构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。

## 八、投资策略

### 1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### 2、债券投资策略

基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金的标的指数为上证180金融股指数,简称180金融。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应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

本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2019年3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	6,074,942,133.36	99.93

	其中：股票	6,074,942,133.36	99.93
2	固定收益投资	10,000.00	0.00
	其中：债券	10,000.00	0.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,491,170.66	0.06
7	其他各项资产	607,677.65	0.01
8	合计	6,079,050,981.67	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	100,402.08	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-

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	100,402.08	0.00

(2) 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,074,841,731.28	99.99
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	-	-
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	6,074,841,731.28	99.99

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

(1) 期末指数投资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	601318	中国平安	12,292,107	947,721,449.70	15.60
2	600036	招商银行	17,823,504	604,573,255.68	9.95
3	601166	兴业银行	21,552,716	391,612,849.72	6.45
4	600030	中信证券	13,557,002	335,942,509.56	5.53
5	601328	交通银行	47,538,672	296,641,313.28	4.88
6	600016	民生银行	43,001,087	272,626,891.58	4.49
7	601288	农业银行	66,378,698	247,592,543.54	4.08
8	600000	浦发银行	20,281,272	228,772,748.16	3.77
9	601398	工商银行	37,294,650	207,731,200.50	3.42
10	600837	海通证券	13,941,030	195,592,650.90	3.22

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603379	三美股份	2,052	66,546.36	0.00
2	603681	永冠新材	1,767	33,855.72	0.00

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,000.00	0.00

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	110053	苏银转债	100	10,000.00	0.00

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

本基金本报告期末未投资股指期货。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(除“招商银行”、“兴业银行”、“交通银行”、“民生银行”、“农业银行”、“浦发银行”、“工商银行”违规外)没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字〔2018〕1 号，招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户、为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保、未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目、高管人员在获得任职资格核准前履职、未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务、未严格审查贸易背景真实性开立信用证、违规签订保本合同销售同业非保本理财产品、非真实转让信贷资产、违规向典当行发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等共计十四项违规事实。中国银监会决定对其罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

根据招商银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司上海、天津、长沙、西

宁等下属分行、支行由于违规办理无真实贸易背景的保理融资业务、理财“双录”未完整记录销售全过程、资产质量反映不真实等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕1 号，兴业银行存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规、同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、提供日期倒签的材料、部分非现场监管统计数据与事实不符、个别董事未经任职资格核准即履职、变相批量转让个人贷款、向四证不全的房地产项目提供融资等共计十二项违规事实。中国银保监会决定对其罚款 5870 万元。

根据兴业银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司上海、郑州、兰州、大连等下属分行、支行由于授信不审慎造成信用风险暴露、贷前调查不尽职导致贷款资金回流至借款人、信贷资金被挪用等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕12 号，交通银行存在（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 690 万元。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕13 号，交通银行存在并购贷款占并购交易价款比例不合规、并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 50 万元。

根据交通银行 2018 年 5 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司广东、厦门、常州、天津等下属分行、支行由于授信业务严重违反审慎经营规则、金融许可证管理不到位、信贷资金流入期货市场等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕8 号，民生银行存在（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实，中国银



保监会决定对其罚款 3160 万元。

根据 2018 年 12 月 7 日中国银保监会发布的处罚公告银保监银罚决字〔2018〕8 号，民生银行存在贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实，中国银保监会决定对其罚款 200 万元。

根据民生银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司银川、太原、济南、宁波等下属分行、支行由于流动资金贷款严重违反审慎经营规则、授信业务调查审查不审慎、在项目贷款中未认真核实项目资本金和股东借款到账依据真实性等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据农业银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司大连、西安、乌鲁木齐、武汉等下属分行、支行由于在代理销售保险业务过程中存在欺骗投保人的行为、贷前贷后未尽职责，超过借款人实际需求发放流动资金贷款、汽车消费分期业务管理不尽职等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字〔2018〕4 号，浦发银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求、提供不实说明材料、不配合调查取证、以贷转存，虚增存贷款、票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严、国内信用证业务贸易背景审查不严、贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款、违规通过同业投资转存款方式，虚增存款、票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理、对代理收付资金的信托计划提供保本承诺、以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产、投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大、修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符、为非保本理财产品出具保本承诺函、向关系人发放信用贷款、向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符、收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。等共计十九项违规事实。中国银监会决定对其罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。

根据浦发银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司信用卡中心、郑州、杭州、上海、乌鲁木齐等下属分行、支行由于信用卡业务授信不审慎、违规开展存贷业务、员工管理不到位、违规开展票据业务等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

根据工商银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，工商银行西安、贵州、广东、湖南、湖北等省下属分行、支行由于在代理销售保险业务过程中存在欺骗投保人的行为、授信业务严重违反审慎经营规则、违规签发银行承兑汇票、贷后管理不到位等行为分别受到当

地银保监局罚款、警告等监管处罚。

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

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

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	525,610.20
2	应收证券清算款	81,094.06
3	应收股利	-
4	应收利息	973.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	607,677.65

(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

1) 期末指数投资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指数投资中不存在流通受限情况。

2) 期末积极投资前五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	603379	三美股份	66,546.36	0.00	网下新股

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2018年12月31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 3 月 31 日至 2011 年 12 月 31 日	-20.87%	1.32%	-18.69%	1.37%	-2.18%	-0.05%
2012 年度	21.68%	1.26%	18.79%	1.27%	2.89%	-0.01%
2013 年度	-6.46%	1.86%	-8.94%	1.87%	2.48%	-0.01%
2014 年度	89.04%	1.71%	83.93%	1.71%	5.11%	0.00%
2015 年度	-8.94%	2.59%	-10.30%	2.60%	1.36%	-0.01%
2016 年度	-5.08%	1.24%	-7.78%	1.24%	2.70%	0.00%
2017 年度	21.89%	0.82%	19.56%	0.82%	2.33%	0.00%
2018 年度	-17.11%	1.38%	-18.77%	1.38%	1.66%	0.00%
2011 年 3 月 31 日至 2018 年 12 月 31 日	48.68%	1.61%	29.98%	1.62%	18.70%	-0.01%

## 十三、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、标的指数许可使用费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

### (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0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%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0.1%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、标的指数使用费按照基金管理人与指数许可方签署的指数许可使用合同的约定从基金财产中支付。

4、本条第(一)款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

### (三) 不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

### (四) 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) 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 2018 年 11 月

13 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“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的相关信息；
- 5、更新了“十、基金的投资”中基金投资组合报告，数据截止至2019年3月31日；
- 6、更新了“十一、基金的业绩”，数据截止至2018年12月31日；
- 7、更新了“二十七、其他应披露的事项”，新增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**  
二〇一九年五月十四日