

# 国泰民安增利债券型发起式证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2015 年第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

国泰民安增利债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]1596 号文核准募集。本基金的基金合同于 2012 年 12 月 26 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。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

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。

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 2015 年 12 月 26 日，投资组合报告为 2015 年 3 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日。

# 一、基金管理人

## 一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

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

成立时间：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：唐建光

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：何 晔

联系电话：（021）31089000，4008888688

股本结构：

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

## 二、基金管理人管理基金的基本情况

截至 2015 年 12 月 26 日，本基金管理人共管理 57 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国

泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金。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

#### （一）董事会成员：

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

2014 年 10 月任国泰基金管理有限公司监事会主席，2014 年 8 月起任公司党委书记，  
2015 年 8 月起任公司董事长、法定代表人。

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

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

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

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

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。1994 年 3 月至 2002 年 2 月在中国电力信

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

张峰，董事，硕士研究生，16年证券从业经历。1987年7月至1999年3月就职于国家计划委员会，历任产业经济研究所科员、政研室经济分析处副处长、财金司综合处处长。1999年3月至2001年7月在嘉实基金管理有限公司工作，任研究部副总监、市场部总监。2001年7月至2002年4月在中保集团资产管理公司，任总经理助理。2002年4月至2015年4月在嘉实基金管理有限公司工作，历任督察长、副总经理兼首席市场官。2015年5月加入国泰基金管理有限公司，2015年8月起任公司总经理及公司董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2013年起兼任金诚信矿业管理股份有限公司（目前已上市）独立董事，2015年5月起兼任北京采安律师事务所兼职律师。2010年6月起任公司独立董事。

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

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

常瑞明，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起在工商银行河北省工作，历任河北沧州市支行主任、副行长；河北省分行办公室副主任、信息处处长、副处长；河北保定市分行行长、党组副书记、书记；河北省分行副行长、行长、党委书记；2004年起任工商银行山西省分行行长、党委书记；2007年起任工商银行工会工作委员会常务副主任；

2010 年至 2014 年任北京银泉大厦董事长。2014 年 10 月起任公司独立董事。

（二）监事会成员：

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

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

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

李辉，监事，大学本科。1997 年 7 月至 2000 年 4 月任职于上海远洋运输公司，2000 年 4 月至 2002 年 12 月任职于中宏人寿保险有限公司，2003 年 1 月至 2005 年 7 月任职于海康人寿保险有限公司，2005 年 7 月至 2007 年 7 月任职于 AIG 集团，2007 年 7 月至 2010 年 3 月任职于星展银行。2010 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人。现任公司总经理助理、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人。2013 年 11 月起任公司职工监事。

束琴，监事，大专学历。1980 年 3 月至 1992 年 3 月分别任职于人民银行安康地区分

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

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

### （三）高级管理人员：

唐建光，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

张峰，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

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

周向勇，硕士研究生，19年金融从业经历。1996年7月至2004年12月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004年12月至2011年1月在中国建银投资公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011年1月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012年11月起任公司副总经理。

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

### （四）本基金的基金经理

#### （1）现任基金经理

韩哲昊，男，学士，5年证券从业经历，2010年9月至2011年9月在旻盛投资有限公司工作，任交易员。2011年9月加入国泰基金管理有限公司，历任债券交易员、基金经理助理。2015年6月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民

安增利债券型发起式证券投资基金、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金和国泰信用债券型证券投资基金的基金经理，2015 年 7 月起兼任国泰淘金互联网债券型证券投资基金和国泰创利债券型证券投资基金（原国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金）的基金经理。

## （2）历任基金经理

自成立至 2015 年 6 月 24 日由张一格担任本基金的基金经理，自 2015 年 6 月 25 日至今由韩哲昊担任本基金的基金经理。

## （五）本基金投资决策委员会成员

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

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

张峰：总经理、董事

委员：

周向勇：副总经理

黄焱：总经理助理兼投资总监兼权益投资（事业）部总经理

吴晨：绝对收益投资（事业）部副总监

张则斌：权益投资总监

（六）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

### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分, 总行设在北京。经国务院批准, 中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡, 成为国内网点最多、业务辐射范围最广, 服务领域最广, 服务对象最多, 业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外, 中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉, 每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行, 中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念, 坚持审慎稳健经营、可持续发展, 立足县域和城市两大市场, 实施差异化竞争策略, 着力打造“伴你成长”服务品牌, 依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品, 致力为广大客户提供优质的金融服务, 与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行, 经验丰富, 服务优质, 业绩突出, 2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计, 并获得无保留意见的 SAS70 审计报告, 表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设, 品牌声誉进一步提升, 在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出, 获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立, 2004 年 9 月更名为托管业务部, 内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托

资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2015 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 306 只。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理,实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### （一）直销机构

| 序号 | 机构名称             | 机构信息                                                                                 |                   |
|----|------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 | 地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层                                                        |                   |
|    |                  | 直销业务专用电话：021-31081759                                                                |                   |
|    |                  | 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<br>智能手机APP平台：iphone交易客户端、Android交易客户端<br>“国泰基金”微信交易平台 |                   |
|    |                  | 电话：021-31081738                                                                      | 联系人：李静姝           |

##### （二）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：姜建清                    | 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：刘士余                    | 客户服务电话：95599    |
|    |              | 联系人：客户服务中心                   | 传真：010-85109219 |
|    |              | 网址：www.95599.cn              |                 |

|    |                |                               |                            |
|----|----------------|-------------------------------|----------------------------|
| 3  | 中国银行股份有限公司     | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号         |                            |
|    |                | 法定代表人：田国立                     | 联系人：客户服务中心                 |
|    |                | 客服电话：95566                    | 网址：www.boc.cn              |
| 4  | 中国建设银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号          |                            |
|    |                | 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼    |                            |
|    |                | 法定代表人：王洪章                     | 客服电话：95533                 |
|    |                | 网址：www.ccb.com                |                            |
| 5  | 交通银行股份有限公司     | 注册地址：上海市银城中路 188 号            |                            |
|    |                | 法定代表人：牛锡明                     | 客服电话：95559                 |
|    |                | 联系人：张宏革                       | 电话：021-58781234            |
|    |                | 网址：www.bankcomm.com           |                            |
| 6  | 招商银行股份有限公司     | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦     |                            |
|    |                | 法定代表人：傅育宁                     | 联系人：邓炯鹏                    |
|    |                | 电话：0755-83198888              | 传真：0755-83195109           |
|    |                | 客户服务热线：95555                  | 网址：www.cmbchina.com        |
| 7  | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 办公地址：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  | 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：<br>www.bank.ecitic.com |
| 9  | 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         |
| 10 | 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       |
| 11 | 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  |
| 12 | 渤海银行股份有限公司     | 注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号        |                       |
|    |                | 法定代表人：刘宝凤                       | 联系人：王宏                |
|    |                | 电话：022-58316666                 | 传真：022-58316259       |
|    |                | 客服电话：400-888-8811               | 网址：www.cbhb.com.cn    |
| 13 | 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：www.qdccb.com                |                       |
| 14 | 洛阳银行股份有限公司     | 注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口           |                       |
|    |                | 法定代表人：王建甫                       | 联系人：胡艳丽               |
|    |                | 电话：0379-65921977                | 传真：0379-65920155      |
|    |                | 客服电话：0379-96699                 |                       |
|    |                | 网址：www.bankofluoyang.com.cn     |                       |
| 15 | 深圳农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |                       |
|    |                | 法定代表人：李伟                        | 联系人：王璇 宋永成            |
|    |                | 电话：0755-25188269                | 传真：0755-25188785      |
|    |                | 客服电话：4001961200                 | 网址：www.4001961200.com |
| 16 | 大连银行股份有限公司     | 注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼  |                       |
|    |                | 法定代表人：陈占维                       | 联系人：李鹏                |
|    |                | 电话：0411-82308602                | 传真：0411-82311420      |
|    |                | 客服电话：400-664-0099               | 网址：www.bankofd1.com   |
| 17 | 上海银行股份有限公司     | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号          |                       |
|    |                | 法定代表人：范一飞                       | 联系人：夏雪                |
|    |                | 电话：021-68475888                 | 传真：021-684761111      |

|    |                    |                                      |                         |
|----|--------------------|--------------------------------------|-------------------------|
|    |                    | 客服电话：021-962888                      |                         |
|    |                    | 网址：www.bankofshanghai.com            |                         |
| 18 | 平安银行股份有<br>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<br>95501 |
|    |                    | 网址：www.bank.pingan.com               |                         |
| 19 | 哈尔滨银行股份<br>有限公司    | 注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号               |                         |
|    |                    | 法定代表人：郭志文                            | 联系人：武艳凤                 |
|    |                    | 电话：0451-86779018                     | 传真：0451-86779218        |
|    |                    | 客服电话：95537、400-60-95537              |                         |
|    |                    | 网址：http://www.hrbcb.com.cn           |                         |
| 20 | 广州农村商业银行<br>股份有限公司 | 注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号               |                         |
|    |                    | 法定代表：黄子励                             | 联系人：戴一挥                 |
|    |                    | 电话：020-22389298                      | 电话：020-22389188         |
|    |                    | 客服电话：020-961111                      | 网址：www.grcbank.com      |
| 21 | 国泰君安证券股<br>份有限公司   | 注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号                |                         |
|    |                    | 法定代表人：万建华                            | 联系人：芮敏祺                 |
|    |                    | 电话：021-38676161                      | 传真：021-38670161         |
|    |                    | 客服电话：400-888-8666                    | 网址：www.gtja.com         |
| 22 | 中信建投证券股<br>份有限公司   | 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼             |                         |
|    |                    | 法定代表人：王常青                            | 联系人：魏明                  |
|    |                    | 电话：010-85130588                      | 传真：010-65182261         |
|    |                    | 客服电话：400-888-8108                    | 网址：www.csc108.com       |
| 23 | 国信证券股份有<br>限公司     | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼 |                         |
|    |                    | 法定代表人：何如                             | 联系人：齐晓燕                 |
|    |                    | 电话：0755-82130833                     | 传真：0755-82133952        |
|    |                    | 客服电话：95536                           | 网址：www.guosen.com.cn    |
| 24 | 招商证券股份有<br>限公司     | 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层       |                         |
|    |                    | 法定代表人：宫少林                            | 联系人：林生迎                 |
|    |                    | 电话：0755-82943666                     | 传真：0755-82943636        |

|    |              |                                         |                       |
|----|--------------|-----------------------------------------|-----------------------|
|    |              | 网址: www.newone.com.cn                   |                       |
|    |              | 客服电话: 400-888-8111/95565                |                       |
| 25 | 中国银河证券股份有限公司 | 注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座         |                       |
|    |              | 法定代表人: 陈有安                              | 联系人: 田薇               |
|    |              | 电话: 010-66568430                        | 传真: 010-66568990      |
|    |              | 客服电话: 400-8888-888                      |                       |
|    |              | 网址: www.chinastock.com.cn               |                       |
| 26 | 海通证券股份有限公司   | 注册地址: 上海市淮海中路 98 号                      |                       |
|    |              | 法定代表人: 王开国                              | 联系人: 李笑鸣              |
|    |              | 电话: 021-23219000                        | 传真: 021-23219100      |
|    |              | 客服电话: 400-888-8001 (全国), 021-95553      |                       |
|    |              | 网址: www.htsec.com                       |                       |
| 27 | 申万宏源证券有限公司   | 注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层              |                       |
|    |              | 法定代表人: 李梅                               | 联系人: 黄莹               |
|    |              | 电话: 021-33388211                        | 客服电话: 4008895523      |
|    |              | 网址: www.swhysc.com                      |                       |
| 28 | 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   |
| 29 | 万联证券有限责任公司   | 注册地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层 |                       |
|    |              | 法定代表人: 张建军                              | 联系人: 罗创斌              |
|    |              | 电话: 020-38286651                        | 传真: 020-22373718-1013 |
|    |              | 客服电话: 400-888-8133                      | 网址: www.wlzq.com.cn   |
| 30 | 东吴证券股份有限公司   | 注册地址: 苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层       |                       |
|    |              | 法定代表人: 吴永敏                              | 联系人: 方晓丹              |
|    |              | 电话: 0512-65581136                       | 传真: 0512-65588021     |
|    |              | 客服电话: 0512-33396288                     | 网址: www.dwzq.com.cn   |
| 31 | 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 |
| 32 | 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  |
| 33 | 国盛证券有限责任公司 | 注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号                                |                    |
|    |            | 办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼                   |                    |
|    |            | 法定代表人：曾小普                                          | 联系人：徐美云            |
|    |            | 电话：0791-6285337                                    | 传真：0791-6288690    |
|    |            | 网址：www.gsstock.com                                 |                    |
| 34 | 光大证券股份有限公司 | 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号                              |                    |
|    |            | 法定代表人：薛峰                                           | 联系人：刘晨             |
|    |            | 电话：021-22169999                                    | 传真：021-22169134    |
|    |            | 客服电话：95525、10108998、400-888-8788                   |                    |
|    |            | 网址：www.ebscn.com                                   |                    |
| 35 | 广发证券股份有限公司 | 注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）    |                    |
|    |            | 办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼 |                    |
|    |            | 法定代表人：孙树明                                          | 联系人：黄岚             |
|    |            | 电话：020-87555888                                    | 传真：020-87555305    |
|    |            | 客服电话：95575                                         | 网址：www.gf.com.cn   |
| 36 | 中信证券股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座                 |                    |
|    |            | 法定代表人：王东明                                          | 联系人：陈忠             |
|    |            | 电话：010-84588888                                    | 传真：010-84865560    |
|    |            | 网址：www.cs.ecitic.com                               |                    |
| 37 | 渤海证券股份有限公司 | 注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室                  |                    |
|    |            | 办公地址：天津市河西区宾水道 8 号                                 |                    |
|    |            | 法定代表人：杜庆平                                          | 联系人：王兆权            |

|    |              |                                                 |                    |
|----|--------------|-------------------------------------------------|--------------------|
|    |              | 电话：022-28451861                                 | 传真：022-28451892    |
|    |              | 客服电话：400-651-5988                               | 网址：www.bhzq.com    |
| 38 | 中信万通证券有限责任公司 | 注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室       |                    |
|    |              | 办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061） |                    |
|    |              | 法定代表人：杨宝林                                       | 联系人：吴忠超            |
|    |              | 电话：0532-85022326                                | 传真：0532-85022605   |
|    |              | 客服电话：0532-96577                                 | 网址：www.zxwt.com.cn |
| 39 | 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：www.htzq.com.cn |
|    |              | 客服电话：95597                                      |                    |
| 40 | 长江证券股份有限公司   | 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦                          |                    |
|    |              | 法定代表人：胡运钊                                       | 联系人：李良             |
|    |              | 电话：027-65799999                                 | 传真：027-85481900    |
|    |              | 客服电话：95579                                      | 网址：www.95579.com   |
| 41 | 国海证券股份有限公司   | 注册地址：广西桂林市辅星路 13 号                              |                    |
|    |              | 法定代表人：张雅锋                                       | 联系人：牛孟宇            |
|    |              | 电话：0755-83709350                                | 传真：0755-83704850   |
|    |              | 客服电话：95563                                      | 网址：www.ghzq.com.cn |
| 42 | 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                                |                    |
| 43 | 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.qlzq.com.cn   |
| 44 | 恒泰证券股份有<br>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   |
| 45 | 东莞证券有限责<br>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   |
| 46 | 中国中投证券有<br>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<br>心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12.<br>13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元 |                      |
|    |                  | 法定代表人：龙增来                                                                                                              | 联系人：刘毅               |
|    |                  | 电话：0755-82023442                                                                                                       | 传真：0755-82026539     |
|    |                  | 网址：www.china-invs.cn                                                                                                   |                      |
|    |                  | 客服电话：400-600-8008、95532                                                                                                |                      |
| 47 | 长城国瑞证券有<br>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       |
| 48 | 华宝证券有限责<br>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<br>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 |
| 49 | 中国国际金融有<br>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<br>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                                                                                                     |                      |
| 50 | 华福证券有限责<br>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  |
| 51 | 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    |
| 52 | 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  |
| 53 | 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    |
| 54 | 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                 |                     |
| 55 | 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  |
| 56 | 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 |
| 57 | 平安证券有限责任公司   | 注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼       |                     |
|    |              | 法定代表人：杨宇翔                         | 联系人：郑舒丽             |

|    |            |                                          |                       |
|----|------------|------------------------------------------|-----------------------|
|    |            | 电话：0755-22626391                         | 传真：0755-82400862      |
|    |            | 客服电话：95511-8                             | 网址：www.pingan.com     |
| 58 | 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：www.tebon.com.cn   |
| 59 | 中航证券有限公司   | 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 |                       |
|    |            | 法定代表人：杜航                                 | 联系人：戴蕾                |
|    |            | 电话：0791-86768681                         | 传真：0791-86770178      |
|    |            | 客服电话：400-8866-567                        | 网址：www.avicsec.com    |
| 60 | 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 |
| 61 | 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                       |                       |
| 62 | 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   |
| 63 | 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    |
| 64 | 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 |
| 65 | 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  |
| 66 | 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 |
| 67 | 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    |
| 68 | 西南证券股份有限公司       | 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号                          |                    |
|    |                  | 法定代表人：余维佳                                 | 联系人：张煜             |
|    |                  | 电话：023-63786141                           | 传真：023-63786212    |
|    |                  | 网址：http://www.swsc.com.cn                 |                    |
| 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   |
| 69 | 华鑫证券有限责任公司       | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元    |                    |
|    |                  | 法定代表人：俞洋                                  | 联系人：王逍             |
|    |                  | 电话：021-64339000                           | 传真：021-54668802    |
|    |                  | 客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918 |                    |
|    |                  | 网址：www.cfsc.com.cn                        |                    |
| 70 | 杭州联合农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：杭州市建国中路99号                           |                    |
|    |                  | 法定代表：张晨                                   | 联系人：仇侃宁            |

|    |                  |                             |                    |
|----|------------------|-----------------------------|--------------------|
|    |                  | 电话：0571-87923225            | 传真：0571-87923214   |
|    |                  | 客服电话：96592                  | 网址：www.urcb.com    |
| 71 | 包商银行股份有限公司       | 注册地址：内蒙古包头市钢铁大街6号           |                    |
|    |                  | 法定代表：李镇西                    | 法定代表：刘芳            |
|    |                  | 电话：0472-5189051             | 电话：0472-5189057    |
|    |                  | 客服电话：96016（北京、内蒙古地区）        |                    |
|    |                  | 网址：www.bsb.com.cn           |                    |
| 72 | 山东寿光农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：山东寿光市银海路19号            |                    |
|    |                  | 法定代表：颜廷军                    | 联系人：周淑贞            |
|    |                  | 电话：0536-5293756             | 传真：0536-5293756    |
|    |                  | 客服电话：0536-96633             |                    |
| 73 | 晋商银行股份有限公司       | 注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦A座 |                    |
|    |                  | 法定代表：上官永清                   |                    |
|    |                  | 客服电话：95105588               | 网址：www.jshbank.com |
| 74 | 宁波银行股份有限公司       | 注册地址：宁波市江东区中山东路294号         |                    |
|    |                  | 法定代表人：陆华裕                   |                    |
|    |                  | 客服电话：96528（上海地区 962528）     |                    |
|    |                  | 网址：www.nbcb.com.cn          |                    |
| 75 | 浙商银行股份有限公司       | 注册地址：浙江省杭州市庆春路288号          |                    |
|    |                  | 法定代表人：张达洋                   |                    |
|    |                  | 客服电话：95527                  |                    |
|    |                  | 网址：http://www.czbank.com    |                    |
| 76 | 张家港农村商业银行股份有限公司  | 注册地址：张家港市人民中路66号            |                    |
|    |                  | 法定代表：王自忠                    | 联系人：朱芳             |
|    |                  | 电话：0512-96065               | 客服电话：0512-96065    |
|    |                  | 传真：051256968259             |                    |
|    |                  | 网址：http://www.zrcbank.com   |                    |
| 77 | 恒丰银行股份有限公司       | 地址：山东省烟台市芝罘区南大街248号         |                    |
|    |                  | 法定代表：蔡国华                    |                    |

|    |                  |                                                                           |
|----|------------------|---------------------------------------------------------------------------|
|    |                  | 客服电话：400-813-8888                                                         |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.egbank.com">www.egbank.com</a>                    |
| 78 | 昆仑银行股份有限公司       | 注册地址：新疆克拉玛依市世纪大道7号                                                        |
|    |                  | 法定代表人：王国樑                                                                 |
|    |                  | 联系人：张碧华                                                                   |
|    |                  | 电话：021-89026813                                                           |
|    |                  | 传真：010-89025421                                                           |
|    |                  | 客服电话：4006696569                                                           |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.klb.cn">www.klb.cn</a>                            |
| 79 | 广发银行股份有限公司       | 注册地址：广州市东风东路713号                                                          |
|    |                  | 法定代表人：董建岳                                                                 |
|    |                  | 电话：020-38322256                                                           |
|    |                  | 传真：020-87310955                                                           |
|    |                  | 客服电话：400-830-8003                                                         |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.cgbchina.com.cn/">http://www.cgbchina.com.cn/</a> |
| 80 | 苏州银行股份有限公司       | 注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路728号                                                     |
|    |                  | 法定代表人：王兰凤                                                                 |
|    |                  | 电话：0512-69868390                                                          |
|    |                  | 传真：0512-69868370                                                          |
|    |                  | 客服电话：0512-96067                                                           |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.suzhoubank.com">www.suzhoubank.com</a>            |
| 81 | 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： <a href="http://www.jnbank.com.cn">www.jnbank.com.cn</a>              |

## 2、第三方销售机构

| 序号 | 机构名称                 | 机构信息                                                         |
|----|----------------------|--------------------------------------------------------------|
| 1  | 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室                                  |
|    |                      | 法定代表人：汪静波                                                    |
|    |                      | 联系人：方成                                                       |
|    |                      | 电话：021-38602377                                              |
|    |                      | 传真：021-38509777                                              |
|    |                      | 客服电话：4008215399                                              |
|    |                      | 网址： <a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a> |
| 2  | 上海好买基金销售有限公司         | 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室                                 |

|   |                  |                                    |                      |
|---|------------------|------------------------------------|----------------------|
|   |                  | 法定代表人：杨文斌                          | 联系人：薛年               |
|   |                  | 电话：021-20613999                    | 传真：021-68596916      |
|   |                  | 客服电话：400-700-9665                  | 网址：www.ehowbuy.com   |
| 3 | 杭州数米基金销售有限公司     | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号              |                      |
|   |                  | 法定代表人：陈柏青                          | 联系人：周熾旻              |
|   |                  | 电话：0571-28829790                   | 传真：0571-26698533     |
|   |                  | 客服电话：4000-766-123                  | 网址：www.fund123.cn    |
| 4 | 深圳众禄基金销售有限公司     | 注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元 |                      |
|   |                  | 法定代表人：薛峰                           | 联系人：童彩平              |
|   |                  | 电话：0755-33227950                   | 传真：0755-82080798     |
|   |                  | 客服电话：4006-788-887                  |                      |
|   |                  | 网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com   |                      |
| 5 | 上海长量基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室          |                      |
|   |                  | 法定代表人：张跃伟                          | 联系人：敖玲               |
|   |                  | 电话：021-58788678-8201               | 传真：021-58787698      |
|   |                  | 客服电话：400-089-1289                  | 网址：www.erichfund.com |
| 6 | 北京展恒基金销售有限公司     | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号               |                      |
|   |                  | 法定代表人：闫振杰                          | 联系人：焦琳               |
|   |                  | 电话：010-62020088-8288               | 传真：010-62020088-8802 |
|   |                  | 客服电话：4008886661                    |                      |
|   |                  | 网址：www.myfund.com                  |                      |
| 7 | 浙江同花顺基金销售有限公司    | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903           |                      |
|   |                  | 法定代表人：凌顺平                          | 联系人：杨翼               |
|   |                  | 电话：0571-88911818-8565              | 传真：0571-86800423     |
|   |                  | 客服电话：4008-773-776<br>0571-88920897 | 网址：www.5ifund.com    |
| 8 | 江苏金百临投资咨询有限公司    | 注册地址：无锡市滨湖区锦溪路99号                  |                      |
|   |                  | 法定代表：费晓燕                           | 联系人：袁丽萍              |
|   |                  | 电话：0510-82758877                   | 传真：0510-88555858     |
|   |                  | 客服电话：0510-9688988                  | 网址：www.jsjbl.com     |

|    |                  |                                        |                           |
|----|------------------|----------------------------------------|---------------------------|
| 9  | 上海天天基金销售有限公司     | 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层          |                           |
|    |                  | 法定代表：其实                                | 联系人：朱钰                    |
|    |                  | 电话：021-54509988-1071                   | 传真：021-64383798           |
|    |                  | 客服电话：4001818188                        | 网址：<br>www.1234567.com.cn |
| 10 | 万银财富（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内     |                           |
|    |                  | 法定代表：李招弟                               | 联系人：刘媛                    |
|    |                  | 电话：010-59393923                        | 传真：010-59393074           |
|    |                  | 客服电话：4008080069                        | 网址：www.wy-fund.com        |
| 11 | 上海利得基金销售有限公司     | 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室           |                           |
|    |                  | 法定代表：盛大                                | 联系人：叶志杰                   |
|    |                  | 电话：021-50583533                        | 传真：021-50583633           |
|    |                  | 客服电话：400-005-6355                      |                           |
|    |                  | 网址：www.leadfund.com.cn                 |                           |
| 12 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室  |                           |
|    |                  | 法定代表：齐凌峰                               | 联系人：阮志凌                   |
|    |                  | 电话：010-82151989                        | 传真：010-82158830           |
|    |                  | 客服电话：400-158-5050                      | 网址：www.9ifund.com         |
| 13 | 浙江金观诚财富管理有限公司    | 注册地址：杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 801  |                           |
|    |                  | 法定代表：陆彬彬                               | 联系人：鲁盛                    |
|    |                  | 电话：0571-56028617                       | 传真：0571-56899710          |
|    |                  | 客服电话：400-068-0058                      |                           |
|    |                  | 网址：www.jincheng-fund.com               |                           |
| 14 | 嘉实财富管理有限公司       | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元 |                           |
|    |                  | 法定代表：赵学军                               | 联系人：张倩                    |
|    |                  | 电话：021-20289890                        | 客服电话：400-021-8850         |
|    |                  | 传真：021-20280110、010-85097308           |                           |
|    |                  | 网址：www.harvestwm.cn                    |                           |
| 15 | 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809     |                           |
|    |                  | 法定代表：沈伟桦                               | 联系人：王巨明                   |

|    |                      |                                                                               |                      |
|----|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------|----------------------|
|    |                      | 电话：010- 52858244                                                              | 传真： 010-85894285     |
|    |                      | 客服电话：400-6099-500                                                             | 网址：www.yixinfund.com |
| 16 | 一路财富（北京）<br>信息科技有限公司 | 办公地址：北京西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 22 层 2208                                      |                      |
|    |                      | 客户服务热线：400-001-1566                                                           |                      |
|    |                      | 公司网站：http://www.yilucaifu.com                                                 |                      |
| 17 | 北京增财基金销售<br>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：http://www.zcvc.com.cn                                                   |                      |
| 18 | 上海联泰资产管理<br>有限公司     | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室                                        |                      |
|    |                      | 客户服务热线：4000-466-788                                                           |                      |
|    |                      | 公司网站：http://www.91fund.com.cn                                                 |                      |
| 19 | 上海汇付金融服务<br>有限公司     | 办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室                                                    |                      |
|    |                      | 客服电话：400-820-2819                                                             |                      |
|    |                      | 公司网站： <a href="http://a0918660.atobo.com.cn">http://a0918660.atobo.com.cn</a> |                      |
| 20 | 上海陆金所资产管<br>理有限公司    | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼                                                     |                      |
|    |                      | 法定代表人：郭坚                                                                      |                      |
|    |                      | 客户服务电话：400-821-9031                                                           |                      |
|    |                      | 网站：www.lufunds.com                                                            |                      |
| 21 | 北京钱景财富投<br>资管理有限公司   | 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：http://www.qianjing.com                                                    |                      |
| 22 | 北京乐融多源投<br>资咨询有限公司   | 注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层                                             |                      |
|    |                      | 法定代表人：董浩                                                                      |                      |
|    |                      | 客户服务电话：400-068-1176                                                           |                      |
|    |                      | 网址：www.jimufund.com                                                           |                      |
| 23 | 北京微动利投资<br>管理有限公司    | 注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室                                       |                      |

|    |                  |                                                                           |                  |
|----|------------------|---------------------------------------------------------------------------|------------------|
|    |                  | 法定代表人：梁洪军                                                                 |                  |
|    |                  | 客户服务电话：400-819-6665                                                       |                  |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.buyforyou.com.cn">http://www.buyforyou.com.cn</a> |                  |
| 24 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#                                       |                  |
|    |                  | 公司地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层                                           |                  |
|    |                  | 客户服务电话：400-166-1188                                                       |                  |
|    |                  | 网址： <a href="http://8.jrj.com.cn/">http://8.jrj.com.cn/</a>               |                  |
| 25 | 上海凯石财富基金销售有限公司   | 注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室                                           |                  |
|    |                  | 法定代表：陈继武                                                                  | 联系人：李晓明          |
|    |                  | 电话：021-63333319                                                           | 传真：021-63333390  |
|    |                  | 客服电话：4000-178-000                                                         |                  |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.lingxianfund.com">www.lingxianfund.com</a>        |                  |
| 26 | 深圳富济财富管理有限公司     | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室                                         |                  |
|    |                  | 法定代表：齐小贺                                                                  | 联系人：马力佳          |
|    |                  | 电话：0755-83999907-815                                                      | 传真：0755-83999926 |
|    |                  | 客服电话：0755-83999907                                                        |                  |
|    |                  | 网址： <a href="http://www.jinqianwo.cn">www.jinqianwo.cn</a>                |                  |

## 二、登记结算机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

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

法定代表人：唐建光

电话：4008-888-688，021-31089000

传真：021-31081800

联系人：何 晔

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

传 真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：黄靖婷

经办注册会计师：许康玮、黄靖婷

## 四、基金的募集

国泰民安增利债券型发起时证券投资基金

## 五、基金类型

债券型基金

## 六、投资目标

在适度承担风险并保持资产流动性的基础上，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。

## 七、投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、商业银行金融债与次级债、政策性金融债、中期票据、资产支持证券、可分离交易可转债、短期融资券、中小企业私募债、债券回购和银行存款等固定收益类资产，股票和权证等权益类资产，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，但须符合中国证监会相关规定。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%；基金投资于中小企业私募债的比例不高于基金资产净值的 20%；基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

## 八、投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过分析宏观经济运行状况、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，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。

### 2、固定收益品种投资策略

本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。

#### （1）久期策略

根据国内外的宏观经济形势、经济周期、国家的货币政策、汇率政策等经济因素，对未来利率走势做出准确预测，并确定本基金投资组合久期的长短。

考虑到收益率变动对久期的影响，若预期利率将持续下行，则增加信用投资组合的久期；相反，则缩短信用投资组合的久期。组合久期选定之后，要根据各相关经济因素的实时变化，及时调整组合久期。

考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率将持续下行的同时，长久期产品比短久期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。

#### （2）期限结构策略

根据国际国内经济形势、国家的货币政策、汇率政策、货币市场的供需关系、投资者对未来利率的预期等因素，对收益率曲线的变动趋势及变动幅度做出预测，收益率曲线的变动趋势包括：向上平行移动、向下平行移动、曲线趋缓转折、曲线陡峭转折、曲线正蝶式移动、曲线反蝶式移动，并根据变动趋势及变动幅度预测来决定信用投资产品组合的期限结构，然后选择采取相应期限结构策略：子弹策略、杠铃策略或梯式策略。

若预期收益曲线平行移动，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小，宜采用子弹策略，具体的幅度临界点运用测算模型进行测算。若预期收益曲线做趋缓转折，宜采用杠铃策略。若预期收益曲线做陡峭转折，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小宜采用子弹策略；用做判断依据的具体正向及负向变动幅度临界点，需要运用测算模型进行测算。

### （3）个券选择策略

#### 1）特定跟踪策略

特定是指某类或某个信用产品具有某种特别的特点，这种特点会造成此类信用产品的价值被高估或者低估。特定跟踪策略，就是要根据特定信用产品的特定特点，进行跟踪和选择。在所有的信用产品中，寻找在持有期内级别上调可能性比较大的产品，并进行配置；对在持有期内级别下调可能性比较大的产品，要进行规避。判断的基础就是对信用产品进行持续内部跟踪评级及对信用评级要素进行持续跟踪与判断，简单的做法就是跟踪特定事件：国家特定政策及特定事件变动态势、行业特定政策及特定事件变动态势、公司特定事件变动态势，并对特定政策及事件对于信用产品的级别变化影响程度进行评估，从而决定对于特定信用产品的取舍。

#### 2）相对价值策略

本策略的宗旨是要找到价值被低估的信用产品。属于同一个行业、类属同一个信用级别且具有相近期限的不同债券，由于息票因素、流动性因素及其他因素的影响程度不同，可能具有不同的收益水平和收益变动趋势，对同类债券的利差收益进行分析，找到影响利差的因素，并对利差水平的未来走势做出判断，找到价值被低估的个券，进而相应地进行债券置换。本策略实际上是某种形式上的债券互换，也是寻求相对价值的一种投资选择策略。

这种投资策略的一个切实可行的操作方法是：在一级市场上，寻找并配置在同等行业、同等期限、同等信用级别下拥有较高票面利率的信用产品；在二级市场上，寻找并配置同等行业、同等信用级别、同等票面利率下具有较低二级市场信用溢价（价值低估）的信用产品并进行配置。

#### 3）数量化选择策略（骑乘策略）

债券投资的另外一个可利用的策略就是骑乘策略，也就是当收益率曲线比较陡峭时，买入收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，

从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑而获得资本利得收益。

通过运用数量化投资选择策略，来对个券进行选择。考虑到骑乘策略，国泰基金通过 ROLL-DOWN 模型等数量化工具来选择相对价值低估的个券，并通过凸性分析选择波动特性最优的单个产品。

#### （4）中小企业私募债投资策略

利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合 Z-Score、KMV 等数量分析模型，测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异，根据自上而下的宏观经济及行业特性分析，从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异，结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。

### 3、股票投资策略

本基金适当投资于股票市场，以强化组合获利能力，提高预期收益水平。本基金股票投资以价值选股、组合投资为原则，通过选择高流动性股票，保证组合的高流动性；通过选择具有高安全边际的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、组合投资，降低个股风险与集中性风险。

本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选取主业清晰，具有持续的核心竞争力，管理透明度较高，流动性好且估值具有高安全边际的个股构建股票组合。

### 4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面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，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较标准为：一年期银行定期存款税后收益率 + 0.5%

本基金选择该业绩比较基准的原因如下：

本基金在满足分红条件的情况下，将定期为投资者分配收益。该机制体现了本基金追求绝对收益、为投资者实现稳定定期回报的理念。因此，本基金采用一年期银行定期存款税后收益率 + 0.5%作为业绩比较基准也正是本基金追求绝对收益的体现。

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

开基金份额持有人大会。

## 十、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

## 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2015 年 9 月 30 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              | 2,324,041.00  | 4.47         |
|    | 其中：股票             | 2,324,041.00  | 4.47         |
| 2  | 固定收益投资            | 47,565,808.90 | 91.47        |
|    | 其中：债券             | 47,565,808.90 | 91.47        |
|    | 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      | 727,382.14    | 1.40         |
| 7  | 其他各项资产            | 1,383,615.29  | 2.66         |
| 8  | 合计                | 52,000,847.33 | 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         | -            | -     |
| B | 采矿业              | -            | -     |
| C | 制造业              | 1,779,826.00 | 3.45  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 27,210.00    | 0.05  |
| E | 建筑业              | 15,495.00    | 0.03  |
| F | 批发和零售业           | 101,960.00   | 0.20  |
| 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              | 399,550.00   | 0.77  |
| 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               | 2,324,041.00 | 4.50  |

（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  | 002407 | 多氟多  | 20,000 | 731,000.00 | 1.42         |
| 2  | 600366 | 宁波韵升 | 20,000 | 318,200.00 | 0.62         |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 20,000 | 291,200.00 | 0.56         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 1,100  | 209,341.00 | 0.41         |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 10,000 | 153,800.00 | 0.30         |
| 6  | 600687 | 刚泰控股 | 11,000 | 147,070.00 | 0.28         |
| 7  | 600682 | 南京新百 | 4,000  | 101,960.00 | 0.20         |
| 8  | 300043 | 互动娱乐 | 6,000  | 83,940.00  | 0.16         |
| 9  | 002539 | 新都化工 | 7,500  | 76,350.00  | 0.15         |
| 10 | 601211 | 国泰君安 | 4,000  | 74,400.00  | 0.14         |

（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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 19,133,600.00 | 37.04        |
|    | 其中：政策性金融债 | 19,133,600.00 | 37.04        |
| 4  | 企业债券      | 23,316,387.60 | 45.14        |
| 5  | 企业短期融资券   | 5,047,000.00  | 9.77         |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | 68,821.30     | 0.13         |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 47,565,808.90 | 92.08        |

（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  | 018001    | 国开 1301     | 100,000 | 10,091,000.00 | 19.53        |
| 2  | 150205    | 15 国开 05    | 70,000  | 7,035,000.00  | 13.62        |
| 3  | 122705    | 12 苏交通      | 49,260  | 5,063,928.00  | 9.80         |
| 4  | 041454076 | 14 南汇 CP002 | 50,000  | 5,047,000.00  | 9.77         |
| 5  | 122041    | 09 招金债      | 47,800  | 4,845,964.00  | 9.38         |

（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。

（八）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。

（九）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。

(十) 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

3、其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 5,555.11     |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,364,888.68 |
| 5  | 应收申购款   | 13,171.50    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,383,615.29 |

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

| 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 | 600682 | 南京新百 | 101,960.00 | 0.20 | 重大事项 |
|---|--------|------|------------|------|------|

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2015 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

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

国泰民安增利债券基金 A:

| 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   |
|---------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2012 年 12 月 26 日至<br>2012 年 12 月 31 日 | 0.10%  | 0.05%     | 0.06%      | 0.01%         | 0.04%  | 0.04% |
| 2013 年度                               | -0.20% | 0.13%     | 3.50%      | 0.01%         | -3.70% | 0.12% |
| 2014 年度                               | 21.52% | 0.22%     | 3.47%      | 0.01%         | 18.05% | 0.21% |
| 2015 年上半年                             | 8.93%  | 0.37%     | 1.49%      | 0.01%         | 7.44%  | 0.36% |
| 2012 年 12 月 26 日至<br>2015 年 6 月 30 日  | 32.25% | 0.23%     | 8.52%      | 0.01%         | 23.73% | 0.22% |

国泰民安增利债券基金 C:

| 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   |
|---------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2012 年 12 月 26 日至<br>2012 年 12 月 31 日 | 0.10%  | 0.05%     | 0.06%      | 0.01%         | 0.04%  | 0.04% |
| 2013 年度                               | -0.70% | 0.13%     | 3.50%      | 0.01%         | -4.20% | 0.12% |
| 2014 年度                               | 20.93% | 0.22%     | 3.47%      | 0.01%         | 17.46% | 0.21% |
| 2015 年上半年                             | 8.78%  | 0.36%     | 1.49%      | 0.01%         | 7.29%  | 0.35% |
| 2012 年 12 月 26 日至<br>2015 年 6 月 30 日  | 30.75% | 0.23%     | 8.52%      | 0.01%         | 22.23% | 0.22% |

## 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、销售服务费：本基金从C类基金份额的基金资产中计提销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“（一）基金费用的种类中第 4—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

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

- 1、在“重要提示”部分，新增了招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了“三、基金管理人”中的相关信息；
- 3、更新了“四、基金托管人”中的相关信息；
- 4、更新了“五、相关服务机构”中的相关信息；
- 5、更新了“九、基金的投资”中基金投资组合报告，数据截至 2015 年 9 月 30 日；
- 6、更新了“十、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；

7、更新了“二十三、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**

**二〇一六年二月五日**