

国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 7 月 14 日证监许可【2011】1094 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中出现的风险主要分为三类，一是境外投资产品风险，包括海外市场风险、汇率风险、法律和政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、流动性风险、信用风险、操作或技术风险、会计核算风险、税务风险等；三是本基金的特有风险，包括基金中基金产品特有风险、所投资 ETF 基金的对对手方风险、基金资产整体波动率无法控制在目标水平的风险、投资对象资产数量与资产规模有限引致的特殊风险、上市交易及外汇额度限制引致的特殊风险。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人建议投资人根据自身的风险偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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 2016 年 11 月 3 日，投资组合报告为 2016 年 3 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日。

一、基金的名称

国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）

二、基金的类型和存续期限

1、基金的类别：基金中基金(FOF)

2、基金的运作方式：上市契约型开放式

三、投资目标

本基金通过在大宗商品各品种间的分散配置以及在商品类、固定收益类资产间的动态配置，力求在有效控制基金资产整体波动性的前提下分享大宗商品市场增长的收益。

四、投资范围

本基金的投资范围包括法律法规允许的、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）、债券、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%（若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取消后的规定执行）；投资于基金（含ETF）的资产不低于基金资产的60%，其中不低于80%投资于商品类基金。

商品类基金包括跟踪综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的ETF；业绩比较基准90%以上基于综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的共同基金。

当法律法规或监管机构允许基金投资于商品期货或其它品种时，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更上述比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

五、投资策略

本基金的投资策略为首先确定基准配置比例，包括商品类、固定收益类资产间的大类资产配置比例和各商品品种间的品种配置比例，然后以基准配置比例为参照构建投资组合，最后根据市场波动性调整固定收益类资产比例，以求将投资组合的整体风险控制在特定的水平以内。

1、资产配置策略

本基金的资产配置策略在于确定基准配置比例，包括大类资产配置比例和各商品品种配置比例。

（1）各商品品种间的配置比例

国际上的大宗商品品种繁多，本基金拟投资的商品品种主要可分为以下四大类别：

能源类：包括原油、天然气、燃料油、汽油、瓦斯油等等；

工业金属类：包括铝、锌、铜、镍、铅等等；

贵金属类：包括黄金、白银等等；

农产品类：玉米、小麦、大豆、白糖、棉花、咖啡、可可、牲畜等等。

在商品品种配置比例的选择上，将以分散配置、均衡配置为出发点，综合考虑各商品品种历史表现以及商品市场基本面等各方面因素，力求构建一个相对稳定的商品品种配置比例基准，在全面反映大宗商品走势的同时，尽量降低商品类资产整体的波动性。

具体而言，在商品品种配置比例方面考虑以下因素：

各商品品种各自价格的历史表现和历史波动性

各商品品种价格间历史相关性

各商品品种的全球产量、交易量

各商品品种的可投资性（即是否可通过商品类基金进行投资）

（2）大类资产配置比例

本基金的大类资产类别包括商品类资产和固定收益类资产，大类资产配置以严格控制风险为目标，力求将资产的整体年化波动率控制在不超过 15%的水平。

具体而言，可分为以下步骤：

对商品资产部分近期的历史实际波动率进行计算并年化；

如商品资产部分历史实际波动率小于 15%，则将固定收益类资产比例设置为零。

如商品资产部分历史实际波动率大于 15%，则提高固定收益类资产比例，以求将资产的整体历史实际波动率降至 15%以内。

本基金管理人与德意志银行合作，对以上资产配置方法进行了固化和完善，制定了基准配置组合和定期调整方法。为对组合的表现进行持续跟踪，由德意志银行以指数的形式进行发布了国泰大宗商品配置指数，并以此指数作为本基金的业绩比较基准。关于指数的更多细节参见（六）业绩比较基准。

2、商品类基金投资策略

本基金的商品类基金投资将主要参照基准配置比例中的商品品种配置比例进行配置，具体方法如下：

（1）根据基准配置比例中商品部分各商品品种的成分和权重，在商品基金中抽样选择基础资产商品品种与基准配置比例中商品部分相同或接近的基金，组成初选基金池。

（2）通过量化模型进行最优化分析，从备选基金池中选取基金构建组合。最优化目标为组合与基准配置比例中商品部分的日收益率序列的相关系数最大化，并

据此求解组合中各基金的权重。

(3) 当基准配置比例定期或不定期进行调整时，通过量化模型重新计算，对组合进行相应调整。

(4) 由基金管理人基于对宏观经济和各商品品种基本面的判断，综合评估历史波动率是否准确反映了各商品品种的市场风险，并对组合进行适度调整。

3、固定收益类资产投资策略

本基金投资的固定收益类资产指现金、银行存款、债券、债券型公募基金（含债券型 ETF）、货币市场基金（含货币型 ETF）。

在确定了商品类基金的组合后，本基金将参照基准配置比例中固定收益类资产的配置比例进行配置，并根据所构建商品类基金组合的实际历史波动率加以调整，力求将基金资产的整体波动率控制在年化 15% 以内。

由于本基金固定收益类资产投资的目的是优化流动性管理和分散投资风险，因此在投资策略会侧重于短久期、高流动性、高信用等级的品种进行投资。

4、衍生品投资策略

本基金投资衍生品主要采取组合避险策略和有效管理策略。衍生品的投资比例应根据法律法规、本基金合同的规定，在充分考虑投资需要后予以确定。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

国泰大宗商品配置指数（全收益指数）

国泰大宗商品配置指数（Guotai Commodity Allocation Index）是国泰基金和德意志银行联合开发的综合性商品指数，涵盖能源、贵金属、工业金属、农产品等多个商品类别，以反映大宗商品市场的整体走势。指数编制中借鉴了国际上较为流行的风险控制指数技术，以控制指数波动率为目标来进行资产配置。通过在指数中加入现金部分并动态调整，力求将指数的整体年化波动率控制在不超过年化 15% 的水平，以达到控制风险的目的。

国泰大宗商品配置指数以 2000 年 1 月 4 日为基期，基点为 100 点。投资者可以通过德意志银行的指数发布网站 DBIQ(<http://index.db.com>) 查询指数的情况，也可以通过彭博资讯查询指数情况，彭博代码为 DBCMCNU1。同时，为便于投资者查询，国泰基金也在公司网站 (<http://www.gtfund.com>) 上公布指数的情况，提供指数介绍、每日走势、商品成分和权重等相关信息。

如果国泰大宗商品配置指数被停止编制及发布，或国泰大宗商品配置指数编制者或所有者停止对本基金的指数使用授权，或国泰大宗商品配置指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致国泰大宗商品配置指数

不宜继续作为业绩比较基准，或证券市场上有其他代表性更强、更合适投资的指数作为本基金的业绩比较基准，或有更能代表本基金风险收益特征的业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的业绩比较基准。基金管理人将依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准或备案后予以公告。

1、指数的构成

国泰大宗商品配置指数的构成包括两大部分：商品资产部分(商品期货投资组合)和现金部分（现金或短期政府债券）。商品资产部分涵盖能源、贵金属、工业金属、农产品等四大类别，用于反映商品市场的整体走势；现金部分用于平抑商品期货组合的市值波动，控制风险。指数提供商根据商品资产部分的近期历史波动率动态调整现金部分的比重，力求将标的整体年化波动率控制在特定的水平（年化 15%）以内，以达到控制风险的目的。

商品资产部分的收益根据商品期货每日的结算价进行计算，现金部分的收益以三月期美国国债的收益率进行计算（3-month T-Bill）。

2、指数的资产配置方法

国泰大宗商品配置指数在资产配置上采用了基于历史波动率的风险控制机制。于每月的第十个工作日对商品资产部分在过去 90 天中的历史波动率进行计算，并将历史波动率和目标波动率（年化 15%）进行比较：当商品资产部分波动率较高时提高现金部分比例，当商品资产部分波动率较低时相应降低现金部分比例，以求达到将指数整体在过去 90 天的波动率控制在不超过年化 15%的水平。

3、商品资产部分的成分和权重

截至 2011 年 4 月 29 日，国泰大宗商品配置指数中商品资产部分的成分和权重如下表所示：

能源 贵金属 工业金属 农产品

WTI 原油 9.8% 黄金 22.0% 铝 6.8% 玉米 4.8%

布伦特原油 4.0% 白银 10.8% 锌 6.1% 小麦 4.8%

天然气 6.9% 铜 6.2% 大豆 4.3%

燃料油 2.5% 镍 0.9% 白糖 3.3%

汽油 2.5% 铅 0.5% 棉花 0.9%

瓦斯油 0.9% 咖啡 0.8%

可可 0.7%

牲畜 0.6%

合计 26.6% 32.8% 20.4% 20.3%

4、期货合约的选取

对于任一商品品种，都有多个到期日不同的期货合约可以选择。国泰大宗商品配置指数在期货合约的选取上采用了德意志银行专有的优化展期（Optimum Yield）技术，对每种商品的期货远期曲线进行分析，根据模型选择出展期损失最小（或展期收益最大）的合约月份，并用该月份的期货合约编制指数。

七、风险收益特征

本基金为基金中基金，基金管理人力求将基金年化波动率控制在特定的水平（年化 15%）以内。因此本基金属于证券投资基金中的较高预期风险和预期收益的基金。

八、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2016 年 9 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

其中：普通股 - -

存托凭证 - -

优先股 - -

房地产信托 - -

2 基金投资 254,376,331.51 77.08

3 固定收益投资 - -

其中：债券 - -

资产支持证券 - -

4 金融衍生品投资 - -

其中：远期 - -

期货 - -

期权 --

权证 --

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 货币市场工具 --

7 银行存款和结算备付金合计 75,654,690.71 22.92

8 其他各项资产 5,157.10 0.00

9 合计 330,036,179.32 100.00

2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4、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及存托凭证
投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7、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
投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资
投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、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基金投资明细

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值

（人民币元） 占基金资产净值比例(%)

1 UNITED STATES OIL FUND LP ETF 基金 开放式 US Commodity Funds LLC

60,095,837.13 18.25

2 PROSHARES ULTRA BLOOMBERG CRUDE OIL ETF 基金 开放式 ProShares

58,059,062.98 17.63

3	POWERSHARES DB US DOLLAR INDEX BULLISH FUND ETF 基金 开放式 DB Commodity Services LLC	30,044,517.36	9.12
4	VELOCITYSHARES 3X LONG CRUDE ETN 基金 开放式 VelocityShares	28,014,824.09	8.51
5	IPATH SP GSCI CRUDE OIL TR ETN 基金 开放式 Barclays Capital Inc	27,982,068.81	8.50
6	UNITED STATES BRENT OIL FUND ETF 基金 开放式 US Commodity Funds LLC	27,932,389.32	8.48
7	POWERSHARES DB OIL FUND ETF 基金 开放式 DB Commodity Services LLC	12,395,439.41	3.76
8	UNITED STATES 12 MONTH OIL ETF 基金 开放式 US Commodity Funds LLC	9,753,541.26	2.96
9	POWERSHARES DB PREC METALS FUND ETF 基金 开放式 DB Commodity Services	27,118.55	0.01
10	POWERSHARES DB AGRICULTURE FUND ETF 基金 开放式 DB Commodity Services LLC	13,342.24	0.00

10、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(人民币元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 5,157.10

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 5,157.10

(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

本基金本报告期末未持有股票。

九、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2012 年 5 月 3 日至 2012 年 12 月 31 日 -1.00% 0.45% 0.43% 0.81% -1.43% -0.36%

2013 年度 -16.36% 0.58% -18.37% 0.75% 2.01% -0.17%

2014 年度 -17.39% 0.52% -14.61% 0.63% -2.78% -0.11%

2015 年度 -39.62% 2.01% -14.86% 0.83% -24.76% 1.18%

2016 年上半年 7.02% 2.88% 17.68% 0.84% -10.66% 2.04%

2012 年 5 月 3 日至 2016 年 6 月 30 日 -55.80% 1.50% -29.87% 0.77% -25.93% 0.73%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

十、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：辛怡

联系电话：021-31089000，4008888688

股本结构：

股东名称 股权比例

中国建银投资有限责任公司 60%

意大利忠利集团 30%

中国电力财务有限公司 10%

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2016 年 11 月 3 日，本基金管理人共管理 67 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

资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金(由国泰6个月短期理财债券型证券投资基金转型而来)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)(由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来,国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来)、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金。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

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任资产管理处置部总经理、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,

2016年6月7日至2016年7月7日代任公司总经理。

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

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。

周向勇，董事，硕士研究生，20年金融从业经历。1996年7月至2004年12月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004年12月至2011年1月在中国建银投资公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011年1月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012年11月至2016年7月7日任公司副总经理，2016年7月8日起任公司总经理及公司董事。

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

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。

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。

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、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人。现任公司总经理助理。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9月起兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

唐建光，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

陈星德，博士，14年证券基金从业经历。曾就职于江苏省人大常委会、中国证券监督管理委员会、瑞士银行环球资产管理香港公司和国投瑞银基金管理有限公司。2009年1月至2015年11月就职于上投摩根基金管理有限公司，历任督察长、副总经理。2015年12月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，17年证券从业经历。1999年7月至2014年2月就职于中国证监会陕西监管局，历任稽查处副主任科员、主任科员、行政办公室副主任、稽查二处副处长等；2014年2月至2014年12月就职于中国证监会上海专员办，任副处长；2015年1月至2015年2月就职于上海申乐实业控股集团有限公司，任副总经理；2015年2月至2016年3月就职于嘉合基金管理有限公司，2015年7月起任公司督察长；2016年3月加入国泰基金管理有限公司，2016年3月25日起任公司督察长。

4、本基金的基金经理

（1）现任基金经理

吴向军，硕士研究生，12年证券基金从业经历。2004年6月至2007年6月在美国Avera Global Partners工作，担任股票分析师；2007年6月至2011年4月在美国Security Global Investors工作，担任高级分析师。2011年5月起加盟国泰基金管理有限公司，2013年4月起任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金的基金经理，2013年8月起兼任国泰美国房地产开发股票型证券投资基金的基金经理，2015年7月起任国泰纳斯达克100指数证券投资基金和国泰大宗商

品配置证券投资基金(LOF)的基金经理，2015年12月起任国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金的基金经理。2015年8月至2016年6月任国际业务部副总监，2016年6月起任国际业务部副总监（主持工作）。

（2）历任基金经理

自本基金成立起至2014年11月3日由崔涛担任基金经理，2014年11月4日起至2015年1月15日由邱晓华担任本基金的基金经理，2015年1月16日起至2015年7月13日由邱晓华和白海峰共同担任本基金的基金经理，自2015年7月14日起至2015年12月28日由吴向军和邱晓华共同担任本基金的基金经理，自2015年12月29日至今由吴向军担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

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

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

吴晨：绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作）

邓时锋：权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：国际业务部副总监（主持工作）

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

十一、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费，含境外托管人收取的费用；
- 3、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；

- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、征管费、过户费、手续费、券商佣金及其他性质类似的费用等），所投资基金的交易费用和管理费用，及在境外市场的开户、交易、清算和登记等相关的各项费用；
- 8、外汇兑换交易的相关费用；
- 9、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 10、与基金缴纳税款有关的手续费、汇款费及顾问费；
- 11、基金上市初费和上市月费；
- 12、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

（四）不列入基金费用的项目

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

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

（六）基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人应聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

十二、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票

代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷

部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

十三、境外托管人

（一）境外托管人的基本情况

名称：道富银行 State Street Bank and Trust Company

注册地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

办公地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

法定代表人：Joseph L. Hooley

成立时间：1891年4月13日

最近一个会计年度（截止到2016年06月30日）所有者权益（Shareholders'

Equity) : 220.73 亿美元

(二) 托管资产规模、国际信用评级和托管业务 道富银行的全球托管业务由美国道富集团全资拥有。道富银行始创于 1891 年, 自 1924 年成为美国第一个共同基金的托管人后, 道富银行已成为一家具有领导地位的国际托管银行。截至 2016 年 06 月 30 日, 托管和行政管理资产总额已达到 27.79 万亿美元, 一级资本比率为 15.0%。道富银行长期存款信用评级为 AA- (标准普尔) 及 Aa1 (穆迪投资)

。道富银行在全球 30 个国家或地区设有办事处, 2016 年 06 月 30 日道富拥有超过 3 万 2 千多名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务。在亚洲开设了四个全方位的营运中心: 香港、新加坡、东京及悉尼, 提供全球托管、基金会计、绩效评估、投资纲领监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。

(三) 境外托管人的职责 1、安全保管受托财产; 2、计算境外受托资产的资产净值; 3、按照相关合同的约定, 及时办理受托资产的清算、交割事宜; 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定, 开设受托资产的资金账户以及证券账户; 5、按照相关合同的约定, 提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息; 6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料; 7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

十四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

序号 机构名称 机构信息

1 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 地址: 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

客户服务专线: 400-888-8688, 021-31089000

传真: 021-31081861 网址: www.gtfund.com

2 国泰基金

电子交易平台 电子交易网站: www.gtfund.com 登录网上交易页面

智能手机 APP 平台: iphone 交易客户端、Android 交易客户端

“国泰基金”微信交易平台

电话: 021-31081738 联系人: 李静姝

2、销售机构

(1) 销售银行及券商

序号 机构名称 机构信息

1 中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰 客户服务电话：95599

联系人：客户服务中心 传真：010-85109219

网址：www.95599.cn

2 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

3 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

4 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

5 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

6 上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉 电话：021-61618888

联系人：高天、虞谷云 客户服务热线：95528

7 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

8 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

9 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

10 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

11 东莞农村商业银行股份有限公司 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表：何沛良 联系人：何茂才

电话：0769-22866255 电话：0769-22866255

客服电话：0769-961122 网址：www.drcbank.com

12 国泰君安证券股份有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红 联系人：芮敏祺

电话：021-38676161 传真：021-38670161

客服电话：95521 网址：www.gtja.com

13 中信建投证券股份有限公司 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青 联系人：许梦园

电话：010-85156398 传真：010-65182261

客服电话：95587

4008-888-108 网址：www.csc108.com

14 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

15 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

16 中国银河证券股份有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安 联系人：邓颜

电话：010-66568292 传真：010-66568990

客服电话：400-8888-888

网址：www.chinastock.com.cn

17 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

18 申万宏源证券有限公司 注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅 联系人：黄莹

电话：021-33388211 客服电话：95523

4008895523

网址：www.swhysc.com

19 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

20 万联证券有限责任公司 注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军 联系人：甘蕾

电话：020-38286026 传真：020-38286588

客服电话：400-888-8133 网址：www.wlzq.com.cn

21 民生证券股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政 联系人：赵明

电话：010-85127622 传真：010-85127917

客服电话：400-619-8888 网址：www.msq.com

22 东吴证券股份有限公司 注册地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力 联系人：陆晓

电话：0512-62938521 传真：0512-65588021

全国客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn

23 东方证券股份有限公司 注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：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

24 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

25 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

26 光大证券股份有限公司 注册地址：上海市静安区新闸路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

27 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

28 中信证券股份有限公司 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时

代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君 联系人：侯艳红

电话：010-60838888 传真：010-60836029

网址：www.cs.ecitic.com

29 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

30 中信证券（山东）有限责任公司 注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）

法定代表人：杨宝林 联系人：赵艳青

电话：0532-85023924 传真：0532-85022605

客服电话：95548 网址：www.citicssd.com

31 华泰证券股份有限公司 注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易 联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193 网址：www.htzq.com.cn

客服电话：95597

32 长江证券股份有限公司 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：崔少华 联系人：奚博宇

电话：027-65799999 传真：027-85481900

客服电话：95579 网址：www.95579.com

33 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

34 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

35 中泰证券股份有限公司 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮 联系人：吴阳

电话：0531-68889155 传真：0531-68889185

客服电话：95538 网址：www.zts.com.cn

36 安信证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦

35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551 传真：0755-82558355

客服电话：400-800-1001

网址：www.essence.com.cn

37 恒泰证券股份有限公司 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民 联系人：王旭华

电话：0471-4972343 传真：0471-4961259

客服电话：0471-4961259 网址：www.cnht.com.cn

38 东莞证券有限责任公司 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

30 楼

法定代表人：游锦辉 联系人：梁健伟

电话：0769-22119341 传真：0769-22116999

客服电话：0769-961130 网址：www.dgzq.com.cn

39 中国中投证券有限责任公司 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处

荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15.

16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：高涛 联系人：张鹏

电话：0755-82023442 传真：0755-82026539

网址：www.china-invs.cn

客服电话：400-600-8008、95532

40 长城国瑞证券有限公司 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼

法定代表人：王勇 联系人：赵钦

电话：0592-5161642 传真：0592-5161140

客服电话：0592-5163588 网址：www.xmzq.cn

41 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

42 中国国际金融股份有限公司 注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁 联系人：罗文雯

电话：010-65051166 传真：010-65051156

网址：www.cicc.com.cn

43 华福证券有限责任公司 注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳 联系人：张腾

电话：0591-87278701 传真：0591-87841150

客服电话：0591-96326 网址：www.hfzq.com.cn

44 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

45 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

46 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

47 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

48 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

49 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

50 平安证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林 联系人：周一涵

电话：021-38637436 传真：021-33830395

客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com

51 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：400888128 网址：www.tebon.com.cn

52 中航证券有限公司 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四 联系人：史江蕊

电话：010-64818301 传真：010-64818443

客服电话：400-88-95335 网址：www.avicsec.com

53 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

54 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

55 湘财证券有限责任公司 注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波 联系人：钟康莺

电话：021-68634518 传真：021-68865680

客服电话：400-888-1551 网址：www.xcsc.com

56 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

57 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

58 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

59 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

60 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

61 浙商证券股份有限公司 注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7

法定代表人：吴承根 联系人：毛亚莉

电话：021-64318893 传真：021-64713795

客服电话：967777 网址：www.stocke.com.cn

62 中银国际证券有限责任公司 注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚 联系人：王炜哲

电话：021-20328309 传真：021-50372474

客服电话：4006208888 网址：www.bocichina.com

63 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

64 西南证券股份有限公司 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳 联系人：张煜

电话：023-63786141 传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

65 国都证券股份有限公司 注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆 联系人：黄静

电话：010-84183333 传真：010-84183311-3389

客服电话：4008188118 网址：www.guodu.com

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

法定代表人：李刚 联系人：王姣

电话：029-68633210 客服电话：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

67 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

68 华鑫证券有限责任公司 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人：俞洋 联系人：王道

电话：021-64339000

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址: www.cfsc.com.cn

69 国金证券股份有限公司 注册地址: 四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址: 四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云 联系人: 贾鹏

电话: 028-86690058 传真: 028-86690126

客户服务电话: 4006600109 网址: www.gjq.com.cn

70 中信期货股份有限公司 注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

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

法定代表人: 张皓 联系人: 洪诚

电话: 0755-23953913 传真: 0755-83217421

网址: www.citicsf.com

71 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

72 浙商银行股份有限公司 注册地址: 浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人: 张达洋

客服电话: 95527

网址: www.czbank.com

73 江苏江南农村商业银行股份有限公司 注册地址: 常州市和平中路 413 号

法定代表: 陆向阳 联系人: 包静

电话: 0519-89995170 传真: 0519-89995170

客服电话: (0519)96005

网址: www.jnbank.com.cn

(2) 第三方销售机构

序号 机构名称 机构信息

1 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司 注册地址: 上海市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：www.noah-fund.com

2 上海好买基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区场中路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 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

法定代表人：陈柏青 联系人：周嫵旻

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

0571-88920897 网址：www.5ifund.com

8 上海天天基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼
2 层

法定代表人：其实 联系人：朱钰

电话：021-54509988-1071 传真：021-64383798

客服电话：4001818188 网址：www.1234567.com.cn

9 众升财富（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区
13 号楼 A 座 9 层 908 室

法定代表人：李招弟 联系人：李艳

电话：010-59497361 传真：010-64788016

客服电话：400-059-8888 网址：www.zscffund.com

10 上海利得基金销售有限公司 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
法定代表人：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

11 嘉实财富管理有限公司 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼
06-10 单元

法定代表人：赵学军 联系人：张倩

电话：021-20289890 客服电话：400-021-8850

传真：021-20280110、010-85097308

网址：www.harvestwm.cn

12 一路财富（北京）信息科技有限公司 办公地址：北京西城区阜成门大街 2 号
万通新世界广场 A 座 22 层 2208

客户服务热线：400-001-1566

公司网站：www.yilucaifu.com

13 北京增财基金销售有限公司 办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼
12 层 1208 号

客户服务热线：400-001-8811

公司网站：www.zcvc.com.cn

14 上海联泰资产管理有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北
路 277 号 3 层 310 室

客户服务热线：4000-466-788

公司网站：www.91fund.com.cn

15 上海陆金所资产管理有限公司 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路
1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

网站：www.lufunds.com

16 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：8.jrj.com.cn

17 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：www.lingxianfund.com

18 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：www.jinqianwo.cn

19 珠海盈米财富管理有限公司 注册地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国
际广场南塔 12 楼

法定代表：肖雯 联系人：吴煜浩

电话：020-89629012 传真：021-63333390

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（二）登记结算机构

序号 机构名称 机构信息

1 中国证券登记结算有限责任公司 地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖 联系人：朱立元

电话：010-59378839 传真：010-59378907

（三）出具法律意见书的律师事务所

序号 机构名称 机构信息

1 上海市通力律师事务所 住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯 联系人：黎明

联系电话：021-31358666 传真：021-31358600

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

序号 机构名称 机构信息

1 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：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

联系人：胡逸嵘

联系电话：（021）23238888 传真：（021）23238800

经办注册会计师：许康玮、胡逸嵘

十五、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 2016 年 6 月 16 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“四、基金的投资”中投资组合报告，更新至 2016 年 9 月 30 日；
- 3、更新了“五、基金的业绩”中的相关内容，更新至 2016 年 6 月 30 日；
- 4、更新了“六、基金管理人”中的相关内容；
- 5、更新了“十九、境外托管人”中的相关内容；
- 6、更新了“二十、相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 7、更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”中的相关内容；
- 8、更新了“二十四、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。

国泰基金管理有限公司

二〇一六年十二月十七日