

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要(2013 第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（以下简称“国泰金鼎价值基金”或“本基金”）由金鼎证券投资基金转型而来。基金转型经 2007 年 3 月 9 日金鼎证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会 2007 年 3 月 27 日证监基金字[2007]88 号文核准。自 2007 年 4 月 11 日起，由《金鼎证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》生效。

国泰基金管理有限公司（“本基金管理人”或“基金管理人”或“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集中申购的核准，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。

投资有风险，投资者拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“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引致的投资风险，由投资者自行负责。

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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，基金管理人并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 2013 年 10 月 11 日，投资组合报告为 2013 年 3 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 6 月 30 日。

第一节 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

成立日期：1998年3月5日

住所：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1亿元人民币

联系人：何晔

联系电话：021-38569000，4008888688

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2013年10月11日，本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及39只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金

联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰6个月短期理财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、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金(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、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰中证医药卫生行业指数分级证券投资基金。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：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，21年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理，1998年3月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999年10月起任公司董事长、党委书记。

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

林川，董事，博士研究生。2006年6月至2009年1月在美国华盛顿互惠银行任高级计量分析师。2009年2月至2009年7月在美国富升人寿保险任财务经理。2010年3月起在中

国建银投资有限责任公司风险管理部工作，现任中国建银投资有限责任公司风险管理部风险管理二组负责人。2012年4月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生。1991年起历任 BARCLAYS BANK 金融分析师；1993年起任 BOISSY GESTION SA (AZUR - GMF) 首席执行官；2003年起任 ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监；2004年起任 GENERALI FINANCES SA 副总经理、投资总监；2007年起任 GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A./GENERALI INVESTMENTS 首席执行官、投资总监；2009年起任 GENERALI INVESTMENTS 董事会主席/首席执行官。2011年起任 Generali Group 首席投资官。并兼任 Generali Investments SICAV (卢森堡) 主席、Generali Investments Deutschland 监事会主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano) 董事会成员等职务。2010年6月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员（FCII）及英国特许保险师（Chartered Insurer）。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。

金旭，董事，硕士研究生，20年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007年11月起任公司董事。

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

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、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。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。

（二）监事会：

唐建光，监事会主席，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月起任公司监事会主席。

Amerigo BORRINI，监事，大学本科，CFA，金融咨询师。1967年起历任忠利集团会计结算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官、忠利集团兼并收购及企业融资部总监，并在 Generali Horizon S.p.A., Trieste(IT)、BG Fiduciaria SIM 兼任董事会主席及 Autovie Venete S.p.A.、Banca Generali S.p.A.、Flandria(B)、Generali Investments Italy SGR S.p.A., Trieste(IT)、Generali Investments SICAV(Lux)、Generali Finance B.V., Diemen(NL)、Generali Investissement, Parigi (FR)、Genirland(IRL)、Generali Multinational Pension Solutions SICAV(Lux)、Graafschap Holland N.V., Diemen(NL)、La Centrale Finanziaria Generale S.p.A.、Net Engineering International S.p.A., Padova(IT)、Perseo S.p.A., Torino(IT)、Premuda S.p.A., Genvoa(IT)、Transocean Holding Corporation(USA) 等公司兼任董事。2010年6月起任公司监事。

刘顺君，监事，硕士研究生，高级经济师。1986年7月至2000年3月在中国人民解放军军事经济学院工作，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。

沙颢，监事，硕士研究生。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券，1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团，2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司，先后担任交易管理部总监、研究部总监。现任公司投资总监兼基金经理。2010年11月起任公司职工监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001年10月加入国泰基金管理有限公司，2010年10月至2013年6月任运营管理部负责人。现从事电子商务营销工作。2007年11月起任公司职工监事。

（三）高级管理人员：

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，20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。

周向勇，硕士研究生，17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。

李志坚，硕士研究生，21年金融业从业经历。1992年2月至1994年12月在美国花旗银行台北分行工作，任财务企划助理；1995年1月至2000年12月在台湾大华证券公司工作，任债券交易总监；2001年1月至2004年9月在台湾景顺投信股份有限公司工作，负责投资业务；2004年10月至2006年5月在台湾保诚投信股份有限公司工作，负责投资业务；2006年6月至2010年4月在美国纽约人寿台湾子公司工作，任投资长；2010年5月至2012年12月在台湾富邦投信股份有限公司工作，任投资长；2013年1月起加入国泰基金管理有限公司，任全球投资总监，2013年6月起任公司副总经理。

林海中，硕士研究生，11年证券基金从业经历。2002年8月至2005年4月在中国证监会信息中心工作，历任专业助理、主任科员；2005年4月至2012年6月在中国证监会基金

监管部工作，历任主任科员、副处长、处长。2012年6月加入国泰基金管理有限公司，2012年8月起任公司督察长。

（四）本基金基金经理及相关研究人员配备

1、现任基金经理

邓时锋，男，硕士研究生，13年证券基金从业经验。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混合的基金经理，2009年5月起兼任国泰区位优势股票的基金经理。

2、历任基金经理

国泰金鼎价值基金：2007年4月11日至2008年3月由崔海峰担任基金经理，2008年4月起由邓时锋担任基金经理。

金鼎基金（2000年5月16日至2007年4月10日）：2000年5月至2002年5月由张以杰担任基金经理，2002年5月至2003年1月由胡定超担任基金经理，2003年1月至2004年3月由何江旭担任基金经理，2004年3月至2007年2月由徐学标担任基金经理，2007年2月起由崔海峰担任基金经理。

3、相关研究人员配备

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

（五）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，其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

李志坚先生：副总经理

周向勇先生：副总经理

黄焱先生：总经理助理

张则斌先生：投资总监

沙骏先生：投资总监

张玮先生：投资总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

（六）上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

第二节 基金托管人

（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

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至2013年6月30日，中国建设银行资产总额148,592.14亿元，较上年末增长6.34%。2013年上半年，中国建设银行实现净利润1,199.64亿元，较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%，年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元，较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%，较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元，较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司，海外机构已覆盖到全球14个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家，拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5，较上年上升1位；在美国《财富》世界500强排名第50位，较上年上升27位；在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2，较上年提升11位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，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、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工225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

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资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。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，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 2013 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 311 只证券投资基金。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。中国建设银行在 2005 年及自 2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在 2007 年及 2008 年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网 2011 年度和 2012 年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度“最佳基金托管银行”奖。

第三节 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：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼	
		直销业务专用电话：021-38561759	
		客户服务专线：400-888-8688，021-38569000	
		传真：021-68775881	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金管理有限公司北京直销柜台	地址：中国北京市西城区金融大街 7 号第 5 层	
		电话：010-66553078	传真：010-66553082

		联系人：吉·青珂莫	
3	国泰基金电子交易平台	网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面	
		电话：021-38561841	联系人：沈茜

(二) 代销机构

1、代销银行及券商

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：蒋超良	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：曹榕	电话：021-58781234
		网址：www.bankcomm.com	
6	招商银行股份有限公司	注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
		法定代表人：傅育宁	联系人：邓炯鹏
		电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
		客户服务热线：95555	网址：www.cmbchina.com

7	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号	
		办公地址：上海市中山东一路12号	
		法定代表人：吉晓辉	电话：021-61618888
		联系人：高天、虞谷云	客户服务热线：95528
8	华夏银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街22号	
		办公地址：北京市东城区建国门内大街22号	
		法定代表人：吴建	客户服务热线：95577
		网址：www.hxb.com.cn	
9	中信银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
		法定代表人：孔丹	联系人：丰靖
		电话：010-65550827	传真：010-65550827
		客服电话：95558	网址：www.bank.ecitic.com
10	中国民生银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号	
		法定代表人：董文标	联系人：董云巍、吴海鹏
		电话：010-58351666	传真：010-83914283
		客服电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
11	中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街3号	
		法定代表人：李国华	联系人：陈春林
		客服电话：95580	传真：010-68858117
		网址：www.psbc.com	
12	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
13	平安银行股份有限公司	注册地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦	
		法定代表人：肖遂宁	联系人：王昕
		电话：0755-22168032	客服电话：95511-3或95501
		网址：www.bank.pingan.com	
14	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
15	国泰君安证券 股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区商城路618号	
		法定代表人：万建华	联系人：芮敏祺
		电话：021-38676161	传真：021-38670161
		客服电话：400-888-8666	网址：www.gtja.com
16	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：魏明
		电话：010-85130588	传真：010-65182261
		客服电话：400-888-8108	网址：www.csc108.com
17	国信证券股份 有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼	
		法定代表人：何如	联系人：齐晓燕
		电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
		客服电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
18	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：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	
19	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	
20	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	
21	申银万国证券股	注册地址：上海市常熟路171号	

	份有限公司	法定代表人：丁国荣	联系人：邓寒冰
		电话：021-54033888	传真：021-54038844
		客服电话：021-962505	网址：www.sw2000.com.cn
22	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.xywq.com.cn
23	中信证券（浙江） 有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19楼	
		法定代表人：沈强	联系人：周妍
		电话：0571-86078823	客服电话：0571-96598
		网址：www.bigsun.com.cn	
24	万联证券有限责 任公司	注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层	
		法定代表人：张建军	联系人：罗创斌
		电话：020-38286651	传真：020-22373718-1013
		客服电话：400-888-8133	网址：www.wlwq.com.cn
25	民生证券股份有 限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层	
		法定代表人：余政	联系人：赵明
		电话：010-85127622	传真：010-85127917
		客服电话：400-619-8888	网址：www.msyzq.com
26	东吴证券股份有 限公司	注册地址：苏州工业园区翠园路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
27	东方证券股份有 限公司	注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层	
		法定代表人：潘鑫军	联系人：吴宇
		电话：021-63325888	传真：021-63326173
		客服电话：95503	网址：www.dfzq.com.cn
28	上海证券有限责 任公司	注册地址：上海市西藏中路336号	
		法定代表人：郁忠民	联系人：张瑾

		电话：021-53519888	传真：021-53519888
		客服电话：021-962518	网址：www.962518.com
29	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市永叔路15号	
		办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼	
		法定代表人：曾小普	联系人：徐美云
		电话：0791-6285337	传真：0791-6288690
		网址：www.gsstock.com	
30	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闸路1508号	
		法定代表人：徐浩明	联系人：刘晨
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：10108998、400-888-8788	
		网址：www.ebscn.com	
31	宏源证券股份有限公司	注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号	
		法定代表人：冯戎	联系人：李巍
		电话：010-88085858	传真：010-88085195
		客服电话：400-800-0562	网址：www.hysec.com
32	世纪证券有限责任公司	注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼	
		法定代表人：卢长才	联系人：王飞
		电话：0755-83199511	客服电话：0755-83199511
		传真：0755-83199545	网址：www.csc.com.cn
33	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
34	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	
35	渤海证券股份有 限公司	注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街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
36	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
37	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	
38	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
39	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
40	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	
41	齐鲁证券有限公司	注册地址: 山东省济南市市中区经七路86号	
		办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号	
		法定代表人: 李玮	联系人: 吴阳
		电话: 0531-68889155	传真: 0531-68889185
		客服电话: 95538	网址: www.qlzq.com.cn
42	安信证券股份有限公司	注册地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	
		法定代表人: 牛冠兴	联系人: 陈剑虹
		联系电话: 0755-82825551	传真: 0755-82558355
		客服电话: 400-800-1001	
		网址: www.essence.com.cn	
43	恒泰证券股份有限公司	注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号	
		法定代表人: 庞介民	联系人: 王旭华
		电话: 0471-4972343	传真: 0471-4961259
		客服电话: 0471-4961259	网址: www.cnht.com.cn
44	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	
45	中国中投证券有限责任公司	注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23单元	
		法定代表人: 龙增来	联系人: 刘毅
		电话: 0755-82023442	传真: 0755-82026539
		网址: www.china-invs.cn	
		客服电话: 400-600-8008、95532	
46	厦门证券有限公司	注册地址: 厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼	
		法定代表人: 傅毅辉	联系人: 赵钦
		电话: 0592-5161642	传真: 0592-5161140

		客服电话：0592-5163588	网址：www.xmzq.cn
47	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
48	中国国际金融有限公司	注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	
		法定代表人：李剑阁	联系人：罗文雯
		电话：010-65051166	传真：010-65051156
		网址：www.cicc.com.cn	
49	华福证券有限责任公司	注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层	
		法定代表人：黄金琳	联系人：张腾
		电话：0591-87278701	传真：0591-87841150
		客服电话：0591-96326	网址：www.hfzq.com.cn
50	天相投资顾问有限公司	注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
		法定代表人：林义相	联系人：林爽
		电话：010-66045608	传真：010-66045527
		客服电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
51	信达证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
		法定代表人：高冠江	联系人：唐静
		电话：010-88656100	传真：010-88656290
		客服电话：400-800-8899	网址：www.cindasc.com
52	中国民族证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层	
		法定代表人：赵大建	联系人：李微
		电话：010-59355941	传真：010-66553791
		客服电话：400-889-5618	网址：www.e5618.com
53	华龙证券有限责任公司	注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号	
		法定代表人：李晓安	联系人：李昕田
		电话：0931-8888088	传真：0931-4890515
		客服电话：0931-4890100、4890619、4890618	网址：www.hlzqgs.com
54	国元证券股份有	注册地址：安徽省合肥市寿春路179号	

	限公司	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
55	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
56	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
57	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
58	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
59	方正证券股份有 限公司	注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层	
		法定代表人：雷杰	联系人：郭瑞军
		电话：0731-85832503	传真：0731-85832214
		客服电话：95571	网址：www.foundersec.com
60	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
61	湘财证券有限责	注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼	

	任公司	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
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	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
68	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
69	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
70	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	
71	国都证券有限责任公司	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
72	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	
73	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	

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： 王玉山

		电话：021-58870011	传真：021-68596916
		客服电话：400-700-9665	网址：www.ehowbuy.com
3	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
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	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	
6	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
7	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：www.1234567.com.cn
8	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
9	浙江金观诚财富	注册地址：杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 801	

	管理有限公司	法定代表人：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	

二、注册登记机构

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	办公地址：中国北京西城区金融大街27号投资广场22层	
		法定代表人：陈耀先	传真：010-58598907
		联系人：朱立元	电话：010-58598839

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	上海源泰律师事务 所	注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼	
		负责人：廖海	联系人：廖海
		电话：021-51150298	传真：021-51150398
		经办律师：廖海、田卫红	

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	
		法人代表：杨绍信	联系人：魏佳亮
		电话：021-61238888	传真：021-61238800
		经办注册会计师：汪棣、屈斯洁	

第四节 基金名称

国泰金鼎价值精选证券投资基金

第五节 基金类型和存续期限

- （一）基金的类别：混合型基金；
- （二）基金的运作方式：契约型开放式；
- （三）基金存续期限：不定期。

第六节 投资目标

本基金为价值精选混合型基金，以量化指标分析为基础，在严密的风险控制前提下，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

第七节 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%；债券资产的投资比例占基金资产的 0-60%，其中资产支持证券类资产的投资比例占基金资产净值的 0-10%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

第八节 投资策略

（一）大类资产配置

本基金的大类资产配置主要通过通过对宏观经济运行状况、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、债券及现金类资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足各类基金风险-回报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同，预测短期性回

报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

在定量分析方面，主要采用均衡市盈率预测模型，并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算 A 股市场理论上均衡的市盈率水平，然后将其与 A 股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较，来判定股票市场系统性风险的高低，最后则根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外，本基金还参照股息率、收益率差距表（1/PE-银行利率）等指标，来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面，主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析，并对根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面，主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

（二）股票资产投资策略

本基金以量化分析为基础，从上市公司的基本面分析入手，建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和 α 值，运用组合优化模型，积极创建并持续优化基金的股票组合，在有效控制组合总体风险的前提下，谋求超额收益。

基金股票池的建立

本基金采取自下而上的方法，从个股选择入手，根据个股的基本面信息，运用多因子模型，选取各行业中具有内在价值的个股组成基金的一级股票池；在一级股票池的基础上，运用现金流折现模型和个股超额收益分析，筛选个股组建基金的二级股票池。

1、一级股票池个股筛选

本基金在建立一级股票池时，是以行业为单位，按照不同行业各自的特点，选取不同的估值因子构建多因子估值模型，对行业内的个股进行估值。本基金的行业分类以天相行业分类标准为依据。

本基金在运用估值模型对行业内个股内在价值估值的基础上，选取各行业价值排名前1/3的个股组成基金的一级股票池。

2、二级股票池个股筛选

本基金二级股票池是以现金流折现模型和个股超额收益分析（个股的 α 值）做为筛选标准对基金一级股票池中的个股进行二次筛选。

本基金在运用现金流折现模型时，通过对上市公司未来业绩的预测和场景模拟等方法，估算个股的未来现金流；在折现因子的确定上，本基金运用加权平均资本成本模型（WACC），

充分考虑到股权成本和债券成本的差异和税务盾牌的作用，精确估算个股的折现值。对于周期性行业等现金流波动较大的行业，本基金在现金流折现的基础上，依据这类个股的市场表现，估算个股的 α 值，以 α 值作为二次选股的优先考虑因素。

本基金在一级股票池中选取折现值靠前的300个左右个股组成基金的二级股票池。

3、股票组合构建和调整

本基金在充分考虑个股内在价值和风险收益水平的基础上，在二级股票池中选取个股构建基金的股票组合，运用组合优化模型不断优化股票组合，以达到单位风险下的收益最大化。

（三）债券资产投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

1、收益率曲线配置具体策略

当预测收益率曲线平行上移或是陡峭化时，适当地降低债券组合的平均久期；当预测收益率曲线平行下移或是平坦化时，适当地增加债券组合的平均久期；当预测收益率曲线剧烈平行上移时，同时降低债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线剧烈平行下移时，同时增加债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线（正向或是反向）蝴蝶型变化时，适当地将债券组合进行子弹型或是哑铃型配置。

2、债券置换策略

本基金以利差分析为基础，当债券利差增大时，适当增加企业债和金融债的数量、减少国债的数量，当债券利差减小时，适当增加国债的数量、减少企业债和金融债的数量；债券组合的平均信用等级保持在投资级（A+级）以上。

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

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

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

（3）央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

（4）债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与申购情况发生变化，导致二级市场收

益率产生波动；

- (5) 由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；
- (6) 市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；
- (7) 单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

第九节 业绩比较基准

业绩比较基准：65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率

上证综合指数以上海证券交易所上市所有股票为样本，大部分为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，基本能够反映 A 股市场发展趋势。该指数具有较强的公正性与权威性，市场代表性较强；上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数，反映我国债券市场整体变动状况，具有较强的市场代表性。

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人在经过基金托管人同意后可以业绩比较基准进行适当调整，并在报中国证监会核准后，公告并予以实施。

第十节 风险收益特征

本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

第十一节 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 2013 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 2013 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	2,515,015,657.49	88.52
	其中：股票	2,515,015,657.49	88.52
2	固定收益投资	136,629,558.13	4.81
	其中：债券	136,629,558.13	4.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	186,246,572.53	6.56
6	其他各项资产	3,317,737.15	0.12
	合计	2,841,209,525.30	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	37,079,582.85	1.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,747,583,366.83	61.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	-	-
E	建筑业	50,912,669.08	1.80
F	批发和零售业	209,395,904.14	7.39
G	交通运输、仓储和邮政业	15,130,000.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	337,208,106.41	11.90
J	金融业	87,977,986.18	3.11
K	房地产业	1,125,000.00	0.04
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	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,603,042.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,515,015,657.49	88.78

（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	600518	康美药业	13,707,440	256,740,351.20	9.06
2	600887	伊利股份	4,742,622	211,900,350.96	7.48
3	600276	恒瑞医药	5,633,615	204,894,577.55	7.23
4	000538	云南白药	1,500,000	175,590,000.00	6.20
5	600597	光明乳业	6,619,991	156,165,587.69	5.51
6	600872	中炬高新	14,671,740	147,010,834.80	5.19
7	600511	国药股份	7,500,000	140,550,000.00	4.96
8	300168	万达信息	2,800,000	98,476,000.00	3.48
9	300188	美亚柏科	5,386,652	89,418,423.20	3.16
10	300182	捷成股份	2,215,501	82,261,552.13	2.90

（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	103,016,500.00	3.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	33,613,058.13	1.19
8	其他	-	-
	合计	136,629,558.13	4.82

（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	019219	12国债19	600,000	59,970,000.00	2.12
2	110015	石化转债	343,160	33,591,932.40	1.19
3	019307	13国债07	300,000	30,027,000.00	1.06
4	019302	13国债02	130,000	13,019,500.00	0.46
5	128002	东华转债	170	21,125.73	0.00

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）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。

（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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）投资组合报告附注

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

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

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	712,303.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,517,689.49
5	应收申购款	87,744.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	3,317,737.15

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	33,591,932.40	1.19

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

第十二节 基金的业绩

基金业绩截止日为2013年6月30日，并经基金托管人复核。

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

阶段	净值增长率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
2007年4月11日至 2007年12月31日	58.30%	1.69%	32.70%	1.41%	25.60%	0.28%

2008年度	-53.83%	2.33%	-47.00%	1.84%	-6.83%	0.49%
2009年度	84.39%	1.48%	48.51%	1.23%	35.88%	0.25%
2010年度	10.11%	1.22%	-8.02%	0.92%	18.13%	0.30%
2011年度	-23.76%	0.93%	-13.17%	0.75%	-10.59%	0.18%
2012年度	-5.06%	0.96%	3.57%	0.71%	-8.63%	0.25%
2013年上半年	13.85%	1.17%	-7.77%	0.81%	21.62%	0.36%
2007年4月11日至 2013年6月30日	22.30%	1.49%	-20.31%	1.18%	42.61%	0.31%

第十三节 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- （一）基金管理人的管理费；
- （二）基金托管人的托管费；
- （三）基金财产拨划支付的银行费用；
- （四）基金合同生效后的信息披露费用；
- （五）基金份额持有人大会费用；
- （六）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （七）基金的证券交易费用；
- （八）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；
- （九）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列支，法律法规另有规定时从其规定。

三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- （一）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，支付日期顺延。

（二）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

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，支付日期顺延。

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

四、不列入基金费用的项目

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

五、基金管理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

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

第十四节 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的

要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2013年5月25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“释义”部分中《基金法》及《销售办法》含义；
- 3、更新了“第三节 基金管理人”中的相关信息；
- 4、更新了“第四节 基金托管人”中的相关信息；
- 5、更新了“第五节 相关服务机构”中的相关信息；
- 6、更新了“第十节 基金的投资”中基金投资组合报告，数据截止至2013年9月30日；
- 7、更新了“第十一节 基金的业绩”，数据截止至2013年6月30日；
- 8、更新了“第二十三节 对基金份额持有人的服务”中的相关信息；
- 9、更新了“第二十四节 其他应披露的事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站 www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇一三年十一月二十三日