

# 国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF） 更新招募说明书

摘要(2013年第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

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成。依据中国证监会 2009 年 9 月 8 日证监许可[2009]925 号文核准的金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议，金盛证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”。自 2009 年 10 月 19 日起，由《金盛证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

投资有风险，投资人集中申购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于集中申购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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

绩表现的保证。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2013 年 10 月 19 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。

## 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

设立日期：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 19 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、国泰国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、国泰国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

#### 1、董事会成员

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经理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。

## 2、监事会成员

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)、Generland(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。

沙骏，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。

### 3、高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

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。

#### 4、本基金基金经理

##### (1) 现任基金经理

张玮，男，硕士研究生，14年证券基金从业经历。2000年11月至2004年6月就职于申银万国证券研究所，任行业研究员。2004年7月至2007年3月就职于银河基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理。2007年3月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹰增长股票的基金经理助理，2008年5月起担任国泰金鹰增长股票的基金经理，2009年4月至2009年10月兼任国泰金盛封闭的基金经理，2009年10月起任国泰中小盘成长股票的基金经理，2012年3月起兼任国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理，2010年7月至2011年6月任研究部副总监，2011年6月起任研究部总监。2011年6月至2012年2月兼任公司投资副总监，2012年2月起兼任公司投资总监。

周伟锋，硕士研究生，2002年7月至2006年8月在中国航天科技集团西安航天发动机厂担任技术员，2006年9月至2008年6月在上海财经大学学习，获应用经济学硕士学位，2008年7月加入国泰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、基金经理助理，2012年1月起任国泰金鹰增长证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理助理，2013年6月13日起任国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)的基金经理。

##### (2) 历任基金经理

自本基金成立起由张玮担任基金经理，自2013年6月13日起由张玮和周伟锋共同担任基金经理。

#### 5、本基金投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司总经理、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

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、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经营历史，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。

## 2、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。

### 3、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。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

## 3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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

#### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

### 三、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            |

##### 2、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      | 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号           |                 |

|    |                    |                             |                     |
|----|--------------------|-----------------------------|---------------------|
|    | 份有限公司              | 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<br>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<br>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<br>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<br>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  | 中国民生银行股<br>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 | 北京银行股份有<br>限公司     | 注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层       |                     |
|    |                    | 法定代表人：闫冰竹                   | 联系人：谢小华             |
|    |                    | 电话：010-66223587             | 传真：010-66226045     |
|    |                    | 客服电话：010-95526              |                     |
|    |                    | 网址：www.bankofbeijing.com.cn |                     |
| 11 | 杭州银行股份有<br>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 | 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               |                      |
|    |                | 法定代表人：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   |
| 13 | 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      |
| 14 | 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    |
| 15 | 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 |
| 16 | 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              |                      |
| 17 | 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             |                      |
| 18 | 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                         |                      |
| 19 | 申银万国证券股份有限公司   | 注册地址：上海市常熟路 171 号                        |                      |
|    |                | 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 |
| 20 | 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                       |                      |
| 21 | 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                     |                      |
| 22 | 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   |
| 23 | 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     |
| 24 | 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   |
| 25 | 东方证券股份有        | 注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层        |                      |

|    |                |  |                    |
|----|----------------|--|--------------------|
|    | 限公司            | 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 |
| 26 | 上海证券有限责<br>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  |
| 27 | 国盛证券有限责<br>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                                 |                    |
| 28 | 光大证券股份有<br>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                                   |                    |
| 29 | 宏源证券股份有<br>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   |
| 30 | 广发证券股份有<br>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   |
| 31 | 中信证券股份有<br>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                            |                    |
| 32 | 渤海证券股份有<br>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    |
| 33 | 中信万通证券有<br>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 |
| 34 | 华泰证券有限责<br>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                                      |                    |
| 35 | 长江证券股份有<br>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   |
| 36 | 中原证券股份有<br>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                                |                    |
| 37 | 齐鲁证券有限公<br>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    |
| 38 | 安信证券股份有<br>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 |
| 39 | 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    |
| 40 | 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    |
| 41 | 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. 13.<br>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  |                       |
| 42 | 厦门证券有限公<br>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        |
| 43 | 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 57<br>层   |                       |
|    |                  | 法定代表人：陈林   | 联系人：刘闰川               |
|    |                  | 电话：021-68778081  | 传真 021-68778117       |
|    |                  | 客服电话：400-820-9898  | 网址：www.cnhbstock.com  |

|    |              |                                   |                    |
|----|--------------|-----------------------------------|--------------------|
| 44 | 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                |                    |
| 45 | 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 |
| 46 | 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   |
| 47 | 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 |
| 48 | 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   |
| 49 | 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                 |                    |
| 50 | 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 |
| 51 | 西部证券股份有      | 注册地址：陕西省西安市东大街232号信托大厦16-17楼      |                    |

|    |                |  |                       |
|----|----------------|--|-----------------------|
|    | 限公司            | 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   |
| 52 | 德邦证券有限<br>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   |
| 53 | 中航证券有限公<br>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    |
| 54 | 东海证券股份有<br>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 |
| 55 | 方正证券股份有<br>限公司 | 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层          |                       |
|    |                | 法定代表人：雷杰                                 | 联系人：郭瑞军               |
|    |                | 电话：0731-85832503                         | 传真：0731-85832214      |
|    |                | 客服电话：95571                               | 网址：www.foundersc.com  |
| 56 | 山西证券股份有<br>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                       |                       |
| 57 | 湘财证券有限责<br>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       |
| 58 | 华融证券股份有        | 注册地址：北京市西城区金融大街 8 号                      |                       |

|    |                  |   |                      |
|----|------------------|---|----------------------|
|    | 限公司              | 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  |
| 59 | 日信证券有限<br>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   |
| 60 | 江海证券有限公<br>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   |
| 61 | 广州证券有限责<br>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    |
| 62 | 天源证券经纪有<br>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   |
| 63 | 浙商证券股份有<br>限公司   | 注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7        |                      |
|    |                  | 法定代表人：吴承根                               | 联系人：毛亚莉              |
|    |                  | 电话：021-64318893                         | 传真：021-64713795      |
|    |                  | 客服电话：967777                             | 网址：www.stocke.com.cn |
| 64 | 中银国际证券有<br>限责任公司 | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层         |                      |
|    |                  | 法定代表人：许刚                                | 联系人：王炜哲              |
|    |                  | 电话：021-20328309                         | 传真：021-50372474      |
|    |                  | 客服电话：4006208888                         | 网址：www.bocichina.com |
| 65 | 新时代证券有限<br>责任公司  | 注册地址：北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层             |                      |
|    |                  | 法定代表人：马金声                               | 联系人：孙恺               |
|    |                  | 电话：010-83561149                         | 传真：010-83561094      |

|    |                |                                       |                       |
|----|----------------|---------------------------------------|-----------------------|
|    |                | 客服电话：4006989898                       | 网址： www.xsdzq.cn      |
| 66 | 西南证券股份有<br>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            |                       |
| 67 | 国都证券有限责<br>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     |
| 68 | 开源证券有限责<br>任公司 | 注册地址： 西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层          |                       |
|    |                | 法定代表人： 李刚                             | 联系人： 王姣               |
|    |                | 电话： 029-68633210                      | 客服电话： 400-860-8866    |
|    |                | 网址： www.kysec.cn                      |                       |
| 69 | 宁波银行股份有<br>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

|   |                              |                                       |                       |
|---|------------------------------|---------------------------------------|-----------------------|
| 1 | 诺亚正行（上海）<br>基金销售投资顾<br>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<br>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<br>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：周嫵旻               |
|   |               | 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                                 | 法定代表：陆彬彬              |
|   |               | 电话：0571-56028617                         | 电话：0571-56028617      |
|   |               | 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<br>有限责任公司 | 办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层 |                 |
|    |                    | 法定代表人：金颖                 | 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  | 上海市锦天城律师<br>事务所 | 注册地址：上海市浦东新区花园桥路33号花旗集团大厦14楼 |                  |
|    |                 | 负责人：史焕章                      | 联系人：刘峰、孙亦涛       |
|    |                 | 电话：021-6105-9000             | 传真：021-6105-9100 |
|    |                 | 经办律师：刘峰、孙亦涛                  |                  |

(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<br>师事务所（特殊普<br>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                   |                 |

## 四、基金名称

国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)

## 五、基金类型和存续期限

- 1、基金的类别：股票型基金；
- 2、基金的运作方式：契约型开放式；
- 3、基金存续期限：不定期。

## 六、投资目标

本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

## 七、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有高成长性和良好基本面的中小盘成长股票。

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

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

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

## 八、投资策略

基金管理人在构建投资组合的过程中，遵循以下投资策略：

### 1、资产配置策略

根据宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、

证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结合基金合同的资产配置范围、组合投资止损点，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置初始比例，再进行综合的对比分析和评估后作出大类资产配置方案。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：

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

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

## 2、股票投资策略

### （1）股票选择过程

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

### （2）成长型股票筛选

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

### （3）相对价值评估分析

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

### （4）实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过上市公司的上游供货商、下游客户、竞争对手和业务合作伙伴，以及税务、海关等行政管理部门对调研结论进行核实。

### （5）建立投资组合

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立买入和卖出股票名单，并选择合理时机，稳步建立投资组合。在建立投资组合过程中，本基金还将注重投资对象的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

### 3、债券投资策略

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

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

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

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

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

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

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

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

央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

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

由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；

市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；

单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

#### 4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

## 九、业绩比较基准

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

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

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

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对

业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

## 十、风险收益特征

本基金是股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司，属于高风险的证券投资基金品种。

## 十一、基金投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于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。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 692,470,341.41 | 89.90        |
|    | 其中：股票             | 692,470,341.41 | 89.90        |
| 2  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 4  | 买入返售金融资产          | 5,000,000.00   | 0.65         |
|    | 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      | 69,986,085.49  | 9.09         |
| 6  | 其他各项资产            | 2,777,481.64   | 0.36         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 7 | 合计 | 770,233,908.54 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 3,708,000.00   | 0.49         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 301,810,017.93 | 39.59        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,202,245.60  | 1.47         |
| E  | 建筑业              | 33,972,267.24  | 4.46         |
| F  | 批发和零售业           | 81,448,539.90  | 10.68        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,539,000.00   | 0.60         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,520,490.20  | 2.82         |
| J  | 金融业              | 21,284,500.00  | 2.79         |
| K  | 房地产业             | 9,290,205.98   | 1.22         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 87,105,667.20  | 11.42        |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,040,486.25   | 0.92         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,111,200.00   | 0.15         |
| 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        | 108,437,721.11 | 14.22        |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 692,470,341.41 | 90.82        |

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 300058 | 蓝色光标 | 1,110,000 | 74,370,000.00 | 9.75         |
| 2  | 300147 | 香雪制药 | 2,991,138 | 66,074,238.42 | 8.67         |
| 3  | 600335 | 国机汽车 | 3,940,654 | 58,203,459.58 | 7.63         |
| 4  | 300043 | 星辉车模 | 3,540,000 | 57,277,200.00 | 7.51         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 5  | 300027 | 华谊兄弟 | 600,000   | 46,728,000.00 | 6.13 |
| 6  | 600660 | 福耀玻璃 | 3,889,500 | 33,294,120.00 | 4.37 |
| 7  | 601928 | 凤凰传媒 | 2,300,885 | 31,913,274.95 | 4.19 |
| 8  | 002022 | 科华生物 | 1,615,309 | 27,056,425.75 | 3.55 |
| 9  | 601933 | 永辉超市 | 1,650,929 | 23,245,080.32 | 3.05 |
| 10 | 600572 | 康恩贝  | 1,644,724 | 22,565,613.28 | 2.96 |

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、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。

#### 9、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。

## 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) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 164,496.49   |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,135,372.67 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 15,203.38    |
| 5  | 应收申购款   | 462,409.10   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,777,481.64 |

(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  | 300043 | 星辉车模 | 57,277,200.00  | 7.51         | 重大资产重组   |

## 十二、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<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-----------------------------|---------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2009年10月19日至<br>2009年12月31日 | 9.84%   | 0.53%         | 12.03%         | 1.47%             | -2.19% | -0.94% |
| 2010年度                      | 8.20%   | 1.34%         | 8.44%          | 1.38%             | -0.24% | -0.04% |
| 2011年度                      | -21.74% | 1.21%         | -27.53%        | 1.17%             | 5.79%  | 0.04%  |
| 2012年度                      | 0.70%   | 1.20%         | 1.79%          | 1.21%             | -1.09% | -0.01% |
| 2013年上半年                    | 13.67%  | 1.41%         | -0.86%         | 1.13%             | 14.53% | 0.28%  |
| 2009年10月19日至<br>2013年6月30日  | 6.48%   | 1.24%         | -11.16%        | 1.25%             | 17.64% | -0.01% |

### 十三、基金的费用与税收

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市初费及上市月费；
- 4、基金财产拨划支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

#### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

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

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

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。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

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。

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

### （四）不列入基金费用的项目

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

### （五）基金管理费和基金托管费的调整

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

### （六）与基金销售有关的费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明

书“十、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（六）申购与赎回的费率”与“（七）申购份数与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

#### （七）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十四、对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6月2日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了“二、释义”部分中《基金法》及《销售办法》含义；
- 3、更新了“三、基金管理人”中的相关内容；
- 4、更新了“四、基金托管人”中的相关内容；
- 5、更新了“五、相关服务机构”中销售机构的相关信息及审计基金财产的会计师事务所名称；
- 6、更新了“十一、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“十二、基金的业绩”，数据截止至2013年6月30日；
- 8、更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”的相关内容；
- 9、更新了“二十五、其他应披露的事项”，新增了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

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

国泰基金管理有限公司

二〇一三年十二月二日