

# 国泰国证有色金属行业指数分级 证券投资基金更新招募说明书摘要

## (2017 年第一号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国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证监许可[2014]360 号文准予募集注册，并依据中国证券监督管理委员会机构部函[2015]379 号文进行募集。本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 30 日。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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险（有色 A 份额的本金及约定收益的风险、指数化投资风险、运作风险）等。

本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。国泰有色份额是本基金基础份额，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。有色 A 份额和有色 B 份额通过场内的国泰有色份额按照 1:1 的基金份额配比自动分离或分拆而来，按照基金合同的约定，具有与国泰有色份额不同的风险收益特征。有色 A 份额的预期风险和预期收益较低，有色 B 份额由于内含杠杆机制的设计，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金，其净值的变动幅度将大于国泰有色份额和有色 A 份额净值的变

动幅度，即有色 B 份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。有色 B 份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。有色 A 份额和有色 B 份额可通过基金合同约定的配对转换方式合并为场内的国泰有色份额，或通过基金合同约定的份额折算方式，折算为场内的国泰有色份额，从而体现出本基金基础份额的风险收益特征。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 30 日，投资组合报告为 2017 年 1 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日。

## 第一部分 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：陈勇胜

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：(021) 31089000, 4008888688

股权结构：

| 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 2017 年 3 月 30 日, 本基金管理人共管理 87 只开放式证券投资基金: 国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金(包括 2 只子基金, 分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金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、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金(由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰

生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰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、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰现金宝货币市场基金、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

### 三、主要人员情况

#### 1、董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982 年 2 月至 1992 年 10 月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年 11 月至 1998 年 1 月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理。1998 年 2 月至 2015 年 10 月在国泰基金管理有限公司工作，其中 1998 年 2 月至

1999年10月任总经理，1999年10月至2015年8月任董事长。2015年10月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016年8月至11月，在建投投资有限责任公司、建投传媒华文公司任监事长、纪委书记。2016年11月起任公司党委书记，2017年3月起任公司董事长、法定代表人。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006年7月起在中国建银投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。

傅敏，董事，大学本科，会计师。1979年12月至1988年3月，任冶金工业部西南地勘局财会处干部。1988年3月至2005年7月，在中国建设银行工作，历任财会部干部、人力资源部干部、副处长、处长、总经理助理。2005年7月至2011年3月在中国建银投资有限责任公司工作，历任人力资源部副总经理、业务总监。2011年6月至2016年11月，在中投发展有限责任公司工作，历任人力资源部总经理、总裁助理、工会主席、党委委员、副总裁、董事。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部专职董事。2017年3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。

董树梓，董事，大学本科，高级会计师。1983年7月至2002年3月，在山东临沂电业局工作，历任会计、科长、副总会计师。2002年3月至2003年2月，在山西鲁晋王曲发电

公司工作，任党组成员、总会计师。2003年2月至2008年3月，任鲁能集团经营考核与审计部总经理。2008年3月至2011年2月，任英大泰和人寿股份有限公司山东分公司总经理。2011年2月至今，在中国电力财务有限公司工作。历任审计部主任，公司党组成员、总会计师。2017年3月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，21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。

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。

杨小舟，独立董事，博士研究生，研究员。1981年7月至1985年7月，任南京林业大学（原南京林产工业学院）财务处会计员。1988年9月至1998年3月，在中国财政科学研究院（原财政部财政科学研究所）工作，历任实习研究员、助理研究员、副研究员、研究室主任。1998年3月至2000年3月，任长天国际科技有限公司财务总监。2000年3月至2002年4月，任福建实达集团股份有限公司财务总监。2002年6月至2005年5月，任同方股份有限公司副总裁。2005年12月起在中国财政科学研究院工作，任研究员，研究生部博士生导师。2017年3月起任公司独立董事。

黄晓衡，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1975年7月至1991年6月，在中国建

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

## 2、监事会成员

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

Yezdi Phiroze Chinoy, 监事, 大学本科。1995年12月至2000年5月在Jardine Fleming India任公司秘书及法务。2000年9月至2003年2月,在Dresdner Kleinwort Benson任合规部主管、公司秘书兼法务。2003年3月至2008年1月任JP Morgan Chase India合规部副总经理。2008年2月至2008年8月任Prudential Property Investment Management Singapore法律及合规部主管。2008年8月至2014年3月任Allianz Global Investors Singapore Limited东南亚及南亚合规部主管。2014年3月17日起任Generali Investments Asia Limited首席执行官。2016年12月1日起任Generali Investments Asia Limited执行董事。2014年12月起任公司监事。

刘锡忠,监事,研究生。1989年2月至1995年5月,中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1995年6月至2005年6月,在华北电力集团财务有限公司工作,历任部门经理、副总经理。2005年7月起在中国电力财务有限公司工作,历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任,现任风险管理部主任。2017年3月起任公司监事。

邓时锋,监事,硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、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。

倪莹，监事，硕士研究生。1998年7月至2001年3月，任新晨信息技术有限责任公司项目经理。2001年3月加入国泰基金管理有限公司，现任信息技术部总监、运营管理部总监。2017年2月起任公司职工监事。

宋凯，监事，大学本科。2008年9月至2012年10月，任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012年12月加入国泰基金管理有限公司，现任纪检监察室副主任、审计部总监助理。2017年3月起任公司职工监事。

### 3、高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

陈星德，博士，15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。

李辉，大学本科，17年金融从业经历。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司，2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司，2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司，2005年7月至2007年7月任职于AIG集团，2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司，先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人，2015年8月至2017年2月任公司总经理助理，2017年2月起担任公司副总经理。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，18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

徐皓，硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师（国家一级），10年证券从业经历。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010年5月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011年6月至2014年1月担任上证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及国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理助理，2012年3月至2014年1月兼任中小板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的基金经理助理。2014年1月至2015年8月任国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2014年1月至2015年8月任中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2014年6月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2014年11月起兼任国泰纳斯达克100指数证券投资基金和纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2015年3月起兼任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2015年8月至2016年6月任国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（原中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金）的基金经理，2016年7月1日起任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（原国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金）的基金经理，2016年11月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017年3月起兼任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理。

##### (2) 历任基金经理

本基金自基金成立以来一直由徐皓担任基金经理，无基金经理改聘事宜。

#### 5、本基金投资决策委员会成员

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

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

陈星德：副总经理

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。

## 第二部分 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工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力争,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为一。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”。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、场外销售机构

##### (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<br>智能手机APP平台:iphone交易客户端、Android交易客户端<br>“国泰基金”微信交易平台 |                   |
|    |                  | 电话:021-31081738                                                                      | 联系人:李静姝           |

##### (2) 其他场外销售机构:

#### 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 |

|   |                |                                      |                      |
|---|----------------|--------------------------------------|----------------------|
|   | 有限公司           | 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        |
| 2 | 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  |
| 3 | 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         |
| 4 | 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      |
| 5 | 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      |
| 6 | 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<br>4008-888-108           | 网址：www.csc108.com    |
| 7 | 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 |
| 8 | 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                        |
| 9  | 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                       |
| 10 | 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                               |
| 11 | 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<br>4008895523 |
|    |              | 网址: www.swhysc.com                              |
| 12 | 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          |
| 13 | 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        |
| 14 | 光大证券股份有限公司   | 注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号                          |
|    |              | 法定代表人: 薛峰      联系人: 刘晨、李芳芳                      |
|    |              | 电话: 021-22169999      传真: 021-22169134          |
|    |              | 客服电话: 95525、10108998、400-888-8788               |
|    |              | 网址: www.ebscn.com                               |

|    |                    |                                                         |                     |
|----|--------------------|---------------------------------------------------------|---------------------|
| 15 | 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    |
| 16 | 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：张佑君                                               | 联系人：侯艳红             |
|    |                    | 电话：010-60838888                                         | 传真：010-60836029     |
|    |                    | 网址：www.cs.ecitic.com                                    |                     |
| 17 | 中信证券（山东）<br>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 |
| 18 | 华泰证券股份有<br>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                                              |                     |
| 19 | 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：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    |
| 20 | 中泰证券股份有<br>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    |
| 21 | 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: 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                                                                                                |                       |
| 22 | 长城国瑞证券有<br>限公司   | 注册地址: 厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼                                                                                                  |                       |
|    |                  | 法定代表人: 王勇                                                                                                               | 联系人: 赵钦               |
|    |                  | 电话: 0592-5161642                                                                                                        | 传真: 0592-5161140      |
|    |                  | 客服电话: 0592-5163588                                                                                                      | 网址: www.xmzq.cn       |
| 23 | 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: 刘闻川              |
|    |                  | 电话: 021-68778081                                                                                                        | 传真 021-68778117       |
|    |                  | 客服电话: 400-820-9898                                                                                                      | 网址: www.cnhbstock.com |
| 24 | 中国国际金融股<br>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<br>28 层                                                                               |                       |
|    |                  | 法定代表人: 李剑阁                                                                                                              | 联系人: 罗文雯              |
|    |                  | 电话: 010-65051166                                                                                                        | 传真: 010-65051156      |
|    |                  | 网址: www.cicc.com.cn                                                                                                     |                       |
| 25 | 天相投资顾问有<br>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     |
| 26 | 信达证券股份有<br>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   |
| 27 | 中国民族证券有<br>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      |
| 28 | 华龙证券有限<br>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                       |                        |
| 29 | 西部证券股份有<br>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   |
| 30 | 平安证券股份有<br>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   |
| 31 | 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 |
| 32 | 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  |
| 33 | 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    |
| 34 | 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    |
| 35 | 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 |
| 36 | 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      |
| 37 | 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: www.swsc.com.cn                                |                       |
| 38 | 华安证券股份有限<br>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     |
| 39 | 华鑫证券有限责任<br>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                                |                       |
| 40 | 国金证券股份有限<br>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.gjzq.com.cn   |
| 41 | 中信期货股份有限<br>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                                |                     |
| 42 | 华西证券股份有<br>限公司       | 注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦                      |                     |
|    |                      | 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦                      |                     |
|    |                      | 法定代表人：杨炯洋                                         | 联系人：谢国梅             |
|    |                      | 联系电话：010-52723273                                 | 传真：028-86150040     |
|    |                      | 客户服务电话：95584                                      | 网址：www.hx168.com.cn |
| 43 | 江苏江南农村商业<br>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）<br>基金销售投资顾问<br>有限公司 | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室             |                      |
|    |                              | 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋                  |                      |
|    |                              | 法定代表人：汪静波                             | 联系人：李娟               |
|    |                              | 电话：021-38602377                       | 传真：021-38509777      |
|    |                              | 客服电话：400-821-5399                     | 网址：www.noah-fund.com |
| 2  | 上海好买基金销售<br>有限公司             | 注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号           |                      |
|    |                              | 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906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<br>销售有限公司           | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室        |                      |

|   |                  |                                      |                       |
|---|------------------|--------------------------------------|-----------------------|
|   |                  | 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F  |                       |
|   |                  | 法定代表人： 陈柏青                           | 联系人： 韩爱彬              |
|   |                  | 电话： 0571-28829790                    | 传真： 0571- 26698533    |
|   |                  | 客服电话： 4000-766-123                   | 网址： www.fund123.cn    |
| 4 | 深圳众禄金融控股股份有限公司   | 注册地址： 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801      |                       |
|   |                  | 办公地址： 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801      |                       |
|   |                  | 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     |                       |
|   |                  | 办公地址： 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层 |                       |
|   |                  | 法定代表人： 张跃伟                           | 联系人： 何昉               |
|   |                  | 电话： 021-58788678-8201                | 传真： 021—58787698      |
|   |                  | 客服电话： 400-820-2899                   | 网址： www.erichfund.com |
| 6 | 北京展恒基金销售有限公司     | 注册地址： 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号              |                       |
|   |                  | 法定代表人： 闫振杰                           | 联系人： 焦琳               |
|   |                  | 电话： 010-62020088-8288                | 传真： 010-62020088-8802 |
|   |                  | 客服电话： 4008886661                     |                       |
|   |                  | 网址： www.myfund.com                   |                       |
| 7 | 浙江同花顺基金销售有限公司    | 注册地址： 杭州市文二西路 1 号 903 室              |                       |
|   |                  | 办公地址： 杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼        |                       |
|   |                  | 法定代表人： 凌顺平                           | 联系人： 杨翼               |
|   |                  | 电话： 0571-88911818-8653               | 传真： 0571-86800423     |
|   |                  | 客服电话： 4008-773-772<br>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 号楼二层         |                       |
|   |                  | 办公地址： 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座              |                       |
|   |                  | 法定代表： 其实                             | 联系人： 朱钰               |

|    |                      |                                    |                        |
|----|----------------------|------------------------------------|------------------------|
|    |                      | 电话: 021-54509977                   | 传真: 021-64383798       |
|    |                      | 客服电话: 4001818188                   | 网址: www.1234567.com.cn |
| 9  | 众升财富(北京)<br>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     |                        |
|    |                      | 办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08        |                        |
|    |                      | 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<br>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: 李兴春                         | 联系人: 叶志杰               |
|    |                      | 电话: 021-50583533                   | 传真: 021-50583633       |
|    |                      | 客服电话: 400-921-7755                 |                        |
|    |                      | 网址: www.leadfund.com.cn            |                        |
| 11 | 嘉实财富管理有限<br>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)<br>信息科技有限公司 | 办公地址: 北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208 |                        |
|    |                      | 办公地址: 北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208   |                        |
|    |                      | 法定代表人: 吴雪秀                         | 联系人: 徐越                |
|    |                      | 客服电话: 400-001-1566                 | 联系电话: 010-88312877     |
|    |                      | 网址: www.yilucaifu.com              |                        |
| 13 | 北京增财基金销售<br>有限公司     | 办公地址: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号     |                        |
|    |                      | 客户服务热线: 400-001-8811               |                        |
|    |                      | 公司网站: www.zcvc.com.cn              |                        |
| 14 | 上海汇付金融服务<br>有限公司     | 注册地址: 上海市黄浦区中山南路100号19层            |                        |
|    |                      | 办公地址: 上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼       |                        |
|    |                      | 法定代表人: 金佶                          | 联系人: 陈云卉               |

|    |                  |                                    |                  |
|----|------------------|------------------------------------|------------------|
|    |                  | 客服电话：400-821-3999                  |                  |
|    |                  | 手机客户端：天天盈基金                        |                  |
| 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09单元      |                  |
|    |                  | 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼          |                  |
|    |                  | 法定代表人：鲍东华                          |                  |
|    |                  | 客户服务电话：400-821-9031                |                  |
|    |                  | 网站：www.lufunds.com                 |                  |
| 16 | 北京钱景财富投资管理有限公司   | 注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012      |                  |
|    |                  | 法定代表人：赵荣春                          |                  |
|    |                  | 电话：010-57418829                    | 传真：010-57569671  |
|    |                  | 客服电话：400-893-6885                  |                  |
|    |                  | 网址：www.qianjing.com                |                  |
| 17 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司              |                  |
|    |                  | 公司地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层       |                  |
|    |                  | 客户服务电话：400-166-1188                |                  |
|    |                  | 法定代表人：张彦                           | 联系人：文雯           |
|    |                  | 电话：010-83363101                    |                  |
|    |                  | 网址：8.jrj.com.cn                    |                  |
| 18 | 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            |                  |
| 19 | 深圳富济财富管理有限公司     | 注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室 |                  |
|    |                  | 办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室 |                  |
|    |                  | 法定代表：刘鹏宇                           | 联系人：杨涛           |
|    |                  | 电话：0755-83999907-815               | 传真：0755-83999926 |

|    |                    |                                                     |                  |
|----|--------------------|-----------------------------------------------------|------------------|
|    |                    | 客服电话: 0755-83999907                                 |                  |
|    |                    | 网址: www.jinqianwo.cn                                |                  |
| 20 | 珠海盈米财富管理<br>有限公司   | 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491                         |                  |
|    |                    | 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203单元           |                  |
|    |                    | 法定代表人: 肖雯                                           | 联系人: 李孟军         |
|    |                    | 电话: 18500050725                                     | 传真: 021-63333390 |
|    |                    | 客服电话: 020-89629099                                  |                  |
|    |                    | 网址: www.yingmi.cn                                   |                  |
| 21 | 北京新浪仓石基金<br>销售有限公司 | 注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室 |                  |
|    |                    | 办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室 |                  |
|    |                    | 法定代表人: 李昭琛                                          | 联系人: 付文红         |
|    |                    | 电话: 010-62676405                                    | 传真: 010-82607151 |
|    |                    | 客服电话: 010-62675369                                  |                  |
|    |                    | 网址: www.xincai.com                                  |                  |
| 22 | 北京汇成基金销售<br>有限公司   | 注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108                         |                  |
|    |                    | 法定代表人: 王伟刚                                          | 联系人: 丁向坤         |
|    |                    | 电话: 010-56282140                                    | 传真: 010-62680827 |
|    |                    | 客服电话: 400-619-9059                                  |                  |
|    |                    | 网址: www.hcjijin.com                                 |                  |
| 23 | 北京创金启富投资<br>管理有限公司 | 注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A                          |                  |
|    |                    | 法定代表人: 梁蓉                                           | 联系人: 李婷婷         |
|    |                    | 电话: 010-66154828                                    | 传真: 010-63583991 |
|    |                    | 客服电话: 400-6262-818                                  |                  |
|    |                    | 网址: www.5irich.com                                  |                  |
| 24 | 北京蛋卷基金销售<br>有限公司   | 注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507                 |                  |
|    |                    | 办公地址: 北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507                        |                  |
|    |                    | 法定代表人: 钟斐斐                                          | 联系人: 戚晓强         |
|    |                    | 电话: 010-61840688                                    | 传真: 010-61840699 |

|    |                 |                                         |            |
|----|-----------------|-----------------------------------------|------------|
|    |                 | 客服电话：4000618518                         |            |
|    |                 | APP 下载网址：danjuanapp.com                 |            |
| 25 | 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 | 注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06 |            |
|    |                 | 办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院              |            |
|    |                 | 法定代表人：江卉                                | 联系人：赵德赛    |
|    |                 | 电话：010-89188343                         | 客服电话：95118 |
|    |                 | 网址：fund.jd.com                          |            |

## 2、场内销售机构

场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金有色 A 份额和有色 B 份额上市交易后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金有色 A 份额和有色 B 份额的上市交易。

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

## 二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿



#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：李一

经办注册会计师：许康玮、李一

### 第四部分 基金的名称

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金

### 第五部分 基金类型和存续期限

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

### 第六部分 投资目标

本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 第七部分 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，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，且不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证投资不高于基金资产净值的 3%。

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

## 第八部分 投资策略

### 1、股票投资策略

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

在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### 2、债券投资策略

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

### 3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

### 4、基金管理人运用基金财产的决策程序

#### (1) 投资依据

- 1) 有关法律、法规、基金合同等的相关规定;
- 2) 经济运行态势和证券市场走势。

#### (2) 投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;确定基金的投资策略和在不同阶段的重大资产

配置比例,包括大类资产配置比例(股票、转债及其他债券)以及各类属资产内部行业比例等;审批基金经理提出的投资组合计划和重大单项投资。基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

### (3) 投资程序

1) 金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标,结合公司内外研究报告,对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算与归因分析,依此提出研究分析报告。

2) 投资决策委员会依据金融工程部、研究开发部等部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

3) 基金经理以基金合同、投资决策委员会决议、金融工程部和研究开发部研究报告等为依据建立基金的投资组合。

4) 交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。

5) 金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。稽核监察部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

6) 基金经理结合个券的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和稽核监察部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整。

7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在招募说明书中更新。

## 第九部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:国证有色金属行业指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的

指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

## 第十部分 风险收益特征

本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。

运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额。其中国泰有色份额为普通的股票型指数基金份额，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；有色 A 份额的预期风险和预期收益较低；有色 B 份额采用了杠杆式的结构，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

## 第十一部分 基金投资组合报告

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 2017 年 4 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 2017 年 3 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目              | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资            | 1,531,773,160.82 | 93.16        |
|    | 其中：股票           | 1,531,773,160.82 | 93.16        |
| 2  | 固定收益投资          | -                | -            |
|    | 其中：债券           | -                | -            |
|    | 资产支持证券          | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资           | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资         | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产        | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融 | -                | -            |

|   |              |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
|   | 资产           |                  |        |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 107,212,614.97   | 6.52   |
| 7 | 其他资产         | 5,197,174.57     | 0.32   |
| 8 | 合计           | 1,644,182,950.36 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### (2) 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —                | —            |
| B  | 采矿业              | 571,251,864.50   | 35.35        |
| C  | 制造业              | 960,521,296.32   | 59.43        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —                | —            |
| E  | 建筑业              | —                | —            |
| F  | 批发和零售业           | —                | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —                | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —                | —            |
| J  | 金融业              | —                | —            |
| K  | 房地产业             | —                | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —                | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —                | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —                | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —                | —            |
| P  | 教育               | —                | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —                | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —                | —            |
| S  | 综合               | —                | —            |
|    | 合计               | 1,531,773,160.82 | 94.78        |

## 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### (1) 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 601899 | 紫金矿业 | 31,559,002 | 106,669,426.76 | 6.60         |
| 2  | 601600 | 中国铝业 | 18,003,666 | 83,717,046.90  | 5.18         |

|    |        |      |            |               |      |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
| 3  | 600547 | 山东黄金 | 2,132,706  | 76,308,220.68 | 4.72 |
| 4  | 600111 | 北方稀土 | 5,812,361  | 70,387,691.71 | 4.36 |
| 5  | 600489 | 中金黄金 | 5,265,987  | 61,717,367.64 | 3.82 |
| 6  | 002460 | 赣锋锂业 | 1,488,473  | 61,518,589.09 | 3.81 |
| 7  | 000630 | 铜陵有色 | 17,934,212 | 56,851,452.04 | 3.52 |
| 8  | 002340 | 格林美  | 6,320,314  | 51,889,777.94 | 3.21 |
| 9  | 000060 | 中金岭南 | 4,480,981  | 49,918,128.34 | 3.09 |
| 10 | 600219 | 南山铝业 | 15,230,491 | 49,803,705.57 | 3.08 |

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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序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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告为未未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执

行。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

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

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

(3) 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 531,881.44   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 26,195.68    |
| 5  | 应收申购款   | 4,639,097.45 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,197,174.57 |

(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) 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

②期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 第十二部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2016年12月31日，并经基金托管人复核。

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

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

|                            |         |       |         |       |        |       |
|----------------------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 2015年3月30日至<br>2015年12月31日 | -22.75% | 3.46% | -15.94% | 3.12% | -6.81% | 0.34% |
| 2016年度                     | -6.79%  | 2.09% | -4.43%  | 2.09% | -2.36% | 0.00% |
| 2015年3月30日至<br>2016年12月31日 | -28.00% | 2.77% | -19.66% | 2.59% | -8.34% | 0.18% |

注：2015年3月30日为基金合同生效日。

## 第十三部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、基金上市费及年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券/期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金证券/期货账户的开户费用、银行账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初3个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费



本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、标的指数使用许可费

本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元（基金合同生效日所在季度除外）。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用许可费每日计提，按季支付。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人可根据指数使用许可协议，对上述计提标准和计提方式进行合理变更，此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在更新招募说明书或其他公告中披露基金最新适用的计提标准和计提方法。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十四部分 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 11 月 12 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，更新了基金合同生效日及招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容；
- 3、更新了“第五部分 相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 4、更新了“第十部分 国泰有色份额的申购、赎回与转换”中的相关内容；
- 5、更新了“第十三部分 基金的投资”中基金的投资组合报告，更新至 2017 年 3 月 31 日；
- 6、更新了“第十四部分 基金的业绩”中的相关内容，更新至 2016 年 12 月 31 日；
- 7、更新了“第二十八部分 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](http://www.gtfund.com)。

国泰基金管理有限公司  
二零一七年五月十三日