

# 国泰双利债券证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

（2012 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

国泰双利债券证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2009 年 1 月 22 日证监许可[2009]75 号文核准募集。

基金管理人保证本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。

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，投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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积极管理风险，基金的特定风险等。国泰双利债券证券投资基金是债券基金，风险低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金投资于债券等固定收益类品种的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、权证等权益类品种的比例不超过基金资产的 20%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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对本基金业绩表现的保证。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财产，但不保证基金一定盈利，也不

保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和更新基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 3 月 11 日，投资组合报告为 2011 年 4 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 12 月 31 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）38561743

股本结构：

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

### （二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2012 年 3 月 11 日，本基金管理人共管理 3 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金(创新型封闭式)，

以及 19 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。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，20 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。

陈良秋，董事，大学本科。1993 年 7 月起在中国建设银行厦门市分行工作，历任业务科副经理、办公室副总经理、支行副行长、行长。2006 年 10 月起在中国建投工作，任企业管理部总经理助理、副总经理、投资部负责人，兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007 年 11 月起任公司董事。

徐志斌，董事，硕士研究生。2001 年 8 月起，先后在高盛集团工作，历任环球控制部

高级分析师、项目经理、团队经理；运营风险管理部总监、执行董事；市场风险管理部执行董事。2010 年 4 月起在中国建投风险管理部工作，2010 年 4 月起任中国建投风险管理部业务总监。2010 年 11 月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生，EFFAS 注册金融分析师。1993 年起历任 BOISSY GESTION SA (AZUR - GMF Group) 首席执行官、ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA 股票投资部总监、GENERALI FINANCES SA 副总经理/投资总监、GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A./GENERALI INVESTMENTS 首席执行官/投资总监、GENERALI INVESTMENTS 忠利投资董事会主席/首席执行官。并兼任 Generali Investments SICAV（卢森堡）主席、Generali Investments Deutschland 监事会主席、Generali Fund Management 副主席、Generali Investments SGR 副主席、THALIA SA (Lugano)、TENAX(UK)、Generali Hedge Fund SICAV(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）。1994 年起历任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理、忠利保险有限公司英国分公司、忠利亚洲中国地区总经理、中意财产保险有限公司董事、总经理，兼任中意人寿保险有限公司董事。2010 年 6 月起任公司董事。

张和之，董事，硕士研究生、高级会计师。曾任水利电力部机关财务处主任科员，能源部机关财务处副处长，电力部机关事务局经营财务处处长，国家电力公司中兴实业发展总公司副总经理、总会计师、副董事长、中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记（正局级）、正局级调研员。2004 年 2 月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，19 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党支部副书记、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、党委副书记。

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、执行院长。兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、中国法学会国际经济法学研究会常务副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、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、北京市华贸硅谷律师事务所兼职律师等职。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 月起任公司董事。

## 2、监事会成员

唐建光，监事会主席，大学本科。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 月进入中国建银投资有限责任公司，先后任资产处置部负责人、总经理、资产管理处置部总经理、负责人，现任中国建银投资有限责任公司企业管理部高级业务总监。2010 年 11 月起担任本公司监事会主席。

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。2010 年 6 月起任本公司监事。

李芝樑，监事，硕士研究生。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传部干事，中国电力财务有限公司债券基金部副经理、经理，投资银行部主任，发展研究中心主任兼董事会办公室常务副主任。现任中国电力财务有限公司董事会办公室主任。2004 年 2 月起任本公司监事。

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；2008 年 2 月至 2009 年 8 月任交易部总监；2009 年 9 月至 2011 年 6 月任研究部总监；2011 年 1 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。2011 年 4 月起任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理；2011 年 6 月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。2010 年 11 月起担任公司职工监事。

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，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。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，19 年证券从业经历。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。现任公司副总经理兼北京分公司总经理。

梁之平，本科，15 年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理，大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监，2008 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理兼财富管理中心总经理，2011 年 1 月至 2012 年 2 月兼任深圳分公司总经理，2010 年 4 月起任公司副总经理兼财富管理中心总经理。

李峰，硕士研究生，16 年银行证券基金从业经历。1996 年 5 月至 2003 年 6 月任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管，2003 年 7 月至 2005 年 5 月任国联安基金管理有限公司监察稽核专员，2005 年 5 月至 2007 年 3 月任信诚基金管理有限公司督察长，2007 年 4 月至 2009 年 1 月任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009 年 2 月加盟国泰基金管理有限公司，现任公司督察长。

### 4、本基金基金经理

#### （1）现任基金经理

胡永青，男，硕士研究生，8 年证券从业经历，2003 年 2 月至 2008 年 8 月就职于天安保险，任固定收益组合经理，2008 年 8 月至 2011 年 8 月就职于信诚基金，任投资经理，2011

年 8 月加入国泰基金管理有限公司，2011 年 12 月 5 日起担任国泰双利债券基金、国泰货币市场证券投资基金的基金经理。

## （2）历任基金经理

自基金合同生效至 2009 年 5 月，由林勇担任基金经理；2009 年 6 月 1 日至 2009 年 7 月 15 日，由林勇、赵峰共同担任基金经理；自 2009 年 7 月 16 日至 2009 年 9 月 9 日，由赵峰担任基金经理；自 2009 年 9 月 10 日至 2011 年 12 月 4 日，由赵峰、范迪钊共同担任基金经理；自 2011 年 12 月 5 日至 2012 年 1 月 8 日，由赵峰、范迪钊、胡永青共同担任基金经理；自 2012 年 1 月 9 日至 2012 年 2 月 9 日，由范迪钊、胡永青共同担任基金经理；自 2012 年 2 月 10 日至今，由胡永青担任基金经理。

## 5、投资决策委员会

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：

金旭女士：总经理

梁之平先生：副总经理兼财富管理中心总经理

张人蟠先生：总经理助理

周向勇先生：总经理助理

刘夫先生：投资副总监

沙骏先生：投资总监

张则斌先生：财富管理中心投资总监

黄焱先生：投资总监兼基金管理部总监

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：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

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：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

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 2011 年 9 月 30 日，中国建设银行资产总额 117,723.30 亿元，较上年末增长 8.90%。截至 2011 年 9 月 30 日止九个月，中国建设银行实现净利润 1,392.07 亿元，较上年同期增长 25.82%。年化平均资产回报率为 1.64%，年化加权平均净资产收益率为 24.82%。利息净收入 2,230.10 亿元，较上年同期增长 22.41%。净利差为 2.56%，净利息收益率为 2.68%，分别较上年同期提高 0.21 和 0.23 个百分点。手续费及佣金净收入 687.92 亿元，较上年同期增长 41.31%。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 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、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球 13 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 33 家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、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。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011 年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的 50 多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011 年“世界银行品牌 500 强”中位列第 10，较去年上升 3 位；在美国《财富》世界 500 强中排名第 108 位，较去年上升 8 位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），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，投资托管服务部副总经理，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，投资托管服务部副总经理，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。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保

基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 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。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

### 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 |                   |
|    |                  | 电话：021-38561759                   | 传真：021-68775881   |
|    |                  | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000  |                   |
|    |                  | 联系人：蔡丽萍                           | 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：王彬                            |                   |
| 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：021-38561739                   | 联系人：徐怡            |

##### 2、代销机构

| 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      |               |
|    |              | 法定代表人：肖钢                   | 联系人：客户服务中心    |
|    |              | 客服电话：95566                 | 网址：www.boc.cn |
| 2  | 中国建设银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号       |               |
|    |              | 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |               |
|    |              | 法定代表人：王洪章                  | 客服电话：95533    |
|    |              | 网址：www.ccb.com             |               |
| 3  | 中国农业银行股份     | 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：滕涛                         | 传真：010-85109219     |
|    |                | 网址：www.95599.cn                |                     |
| 4  | 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             |                     |
| 5  | 交通银行股份有限公司     | 注册地址：上海市银城中路 188 号             |                     |
|    |                | 法定代表人：胡怀邦                      | 客服电话：95559          |
|    |                | 联系人：曹榕                         | 电话：021-58781234     |
|    |                | 网址：www.bankcomm.com            |                     |
| 6  | 招商银行股份有限公司     | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦      |                     |
|    |                | 法定代表人：傅育宁                      | 联系人：邓炯鹏             |
|    |                | 电话：0755-83198888               | 传真：0755-83195109    |
|    |                | 客户服务热线：95555                   | 网址：www.cmbchina.com |
| 7  | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号         |                     |
|    |                | 办公地址：上海市中山东一路 12 号             |                     |
|    |                | 法定代表人：吉晓辉                      | 电话：021-61618888     |
|    |                | 联系人：汤嘉惠、虞谷云                    | 客户服务热线：95528        |
|    |                | 网址：www.spdb.com.cn             |                     |
| 8  | 华夏银行股份有限公司     | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号         |                     |
|    |                | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号         |                     |
|    |                | 法定代表人：吴建                       | 客服服务热线：95577        |
|    |                | 网址：www.hxb.com.cn              |                     |
| 9  | 中信银行股份有限公司     | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座  |                     |
|    |                | 法定代表人：孔丹                       | 联系人：丰靖              |
|    |                | 电话：010-65550827                | 传真：010-65550827     |
|    |                | 客服电话：95558                     | 网址：bank.ecitic.com  |
| 10 | 中国民生银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号          |                     |

|    |                |                                 |                      |
|----|----------------|---------------------------------|----------------------|
|    |                | 法定代表人：董文标                       | 联系人：董云巍、吴海鹏          |
|    |                | 电话：010-58351666                 | 传真：010-83914283      |
|    |                | 客服电话：95568                      | 网址：www.cmbc.com.cn   |
| 11 | 北京银行股份有限公司     | 注册地址：北京市西城区金融大街 17 号首层          |                      |
|    |                | 法定代表人：闫冰竹                       | 联系人：王曦               |
|    |                | 电话：010-66223584                 | 传真：010-66226045      |
|    |                | 客服电话：010-95526                  |                      |
|    |                | 网址：www.bankofbeijing.com.cn     |                      |
| 12 | 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      |
| 13 | 深圳农村商业银行股份有限公司 | 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |                      |
|    |                | 法定代表人：李伟                        | 联系人：曾明 宋永成           |
|    |                | 电话：0755-25188269                | 传真：0755-25188785     |
|    |                | 客服电话：4001961200                 | 网址：www.961200.net    |
| 14 | 大连银行股份有限公司     | 注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼  |                      |
|    |                | 法定代表人：陈占维                       | 联系人：李鹏               |
|    |                | 电话：0411-82308602                | 传真：0411-82311420     |
|    |                | 客服电话：400-664-0099               | 网址：www.bankofdl.com  |
| 15 | 洛阳银行股份有限公司     | 注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口           |                      |
|    |                | 法定代表人：王建甫                       | 联系人：胡艳丽              |
|    |                | 电话：0379-65921977                | 传真：0379-65920155     |
|    |                | 客服电话：0379-96699                 |                      |
|    |                | 网址：www.bankofluoyang.com.cn     |                      |
| 16 | 杭州银行股份有限公司     | 注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦          |                      |
|    |                | 法定代表人：吴太普                       | 联系人：严峻               |
|    |                | 电话：0571-85163127                | 传真：0571-85179591     |
|    |                | 客服电话：400-888-8508               | 网址：www.hzbank.com.cn |
| 17 | 渤海银行股份有限公司     | 注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号        |                      |

|    |              |                                                                                                      |                      |
|----|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|
|    |              | 法定代表人：刘宝凤                                                                                            | 联系人：王宏               |
|    |              | 电话：022-58316666                                                                                      | 传真：022-58316259      |
|    |              | 客服电话：400-888-8811                                                                                    | 网址：www.cbhb.com.cn   |
| 18 | 青岛银行股份有限公司   | 注册地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦                                                                             |                      |
|    |              | 法定代表人：郭少泉                                                                                            | 联系人：滕克               |
|    |              | 电话：0532-85709732                                                                                     | 传真：0532-85709725     |
|    |              | 客服电话：96588（青岛）400-669-6588（全国）                                                                       |                      |
|    |              | 网址：www.qdccb.com                                                                                     |                      |
| 19 | 中国中投证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层<br>01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元 |                      |
|    |              | 法定代表人：龙增来                                                                                            | 联系人：刘毅               |
|    |              | 电话：0755-82023442                                                                                     | 客服电话：400-600-8008    |
|    |              | 网址：www.china-invs.cn                                                                                 |                      |
| 20 | 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      |
| 21 | 宏源证券股份有限公司   | 注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路 233 号                                                                          |                      |
|    |              | 法定代表人：冯戎                                                                                             | 联系人：李巍               |
|    |              | 电话：010-88085858                                                                                      | 传真：010-88085195      |
|    |              | 客服电话：400-800-0562                                                                                    | 网址：www.hysec.com     |
| 22 | 万联证券有限责任公司   | 注册地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层                                                                        |                      |
|    |              | 法定代表人：张建军                                                                                            | 联系人：罗创斌              |
|    |              | 电话：020-37865070                                                                                      | 传真：020-22373718-1013 |
|    |              | 客服电话：400-888-8133                                                                                    | 网址：www.wlzq.com.cn   |
| 23 | 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                                                                                             | 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    |
| 24 | 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                  |                      |
| 25 | 中国银河证券股份<br>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：顾伟国                         | 联系人：田薇               |
|    |                  | 电话：010-66568430                   | 传真：010-66568990      |
|    |                  | 网址：www.chinastock.com.cn          |                      |
| 26 | 中信金通证券有限<br>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：丁思聪              |
|    |                  | 电话：0571-87112510                  | 客服电话：0571-96598      |
|    |                  | 网址：www.bigsun.com.cn              |                      |
| 27 | 申银万国证券股份<br>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 |
| 28 | 东方证券股份有限<br>公司   | 注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层 |                      |
|    |                  | 法定代表人：王益民                         | 联系人：吴宇               |
|    |                  | 电话：021-63325888                   | 传真：021-63326173      |
|    |                  | 客服电话：95503                        | 网址：www.dfzq.com.cn   |
| 29 | 东吴证券股份有限<br>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   |
| 30 | 广发证券股份有限<br>公司   | 注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼      |                      |
|    |                  | 办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、41 和 42 楼   |                      |
|    |                  | 法定代表人：王志伟                         | 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 | 国盛证券有限责任<br>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                              |                    |
| 32 | 民生证券有限责任公司   | 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.msza.com    |
| 33 | 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  |
| 34 | 光大证券股份有限公司   | 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号                           |                    |
|    |              | 法定代表人：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                                |                    |
| 35 | 中信万通证券有限责任公司 | 注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室       |                    |
|    |              | 办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061） |                    |
|    |              | 法定代表人：张智河                                       | 联系人：吴忠超            |
|    |              | 电话：0532-85022273                                | 传真：0532-85022605   |
|    |              | 客服电话：0532-96577                                 | 网址：www.zxwt.com.cn |
| 36 | 中信证券股份有限公司   | 注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层                |                    |
|    |              | 法定代表人：王东明                                       | 联系人：陈忠             |
|    |              | 电话：010-84588888                                 | 传真：010-84865560    |
|    |              | 网址：www.ecitic.com                               |                    |
| 37 | 华泰证券有限责任公司   | 注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦                      |                    |

|    |            |                                      |                      |
|----|------------|--------------------------------------|----------------------|
|    |            | 办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦           |                      |
|    |            | 法定代表人：吴万善                            | 联系人：张小波              |
|    |            | 电话：025-84457777                      | 网址：www.htzq.com.cn   |
|    |            | 客服电话：95597                           |                      |
| 38 | 长江证券股份有限公司 | 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦               |                      |
|    |            | 法定代表人：胡运钊                            | 联系人：李良               |
|    |            | 电话：021-63219781                      | 传真：021-51062920      |
|    |            | 客服电话：95579                           | 网址：www.95579.com     |
| 39 | 国海证券有限责任公司 | 注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号                   |                      |
|    |            | 法定代表人：张雅锋                            | 联系人：武斌               |
|    |            | 电话：0755-83707413                     | 传真：0755-83700205     |
|    |            | 客服电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）      |                      |
|    |            | 网址：www.ghzq.com.cn                   |                      |
| 40 | 渤海证券股份有限公司 | 注册地址：天津市经济技术开发区第一大街 29 号             |                      |
|    |            | 办公地址：天津市河西区宾水道 3 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      |
| 41 | 中原证券股份有限公司 | 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号               |                      |
|    |            | 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 层          |                      |
|    |            | 法定代表人：石保上                            | 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                     |                      |
| 42 | 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 |
| 43 | 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：黄健               |



|    |            |                                            |                       |
|----|------------|--------------------------------------------|-----------------------|
|    |            | 电话：0755-82943666                           | 传真：0755-82943636      |
|    |            | 网址：www.newone.com.cn                       |                       |
|    |            | 客服电话：400-888-8111\95565                    |                       |
| 44 | 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    |
| 45 | 齐鲁证券有限公司   | 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号                     |                       |
|    |            | 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号                     |                       |
|    |            | 法定代表人：李玮                                   | 联系人：吴阳                |
|    |            | 电话：0531-68889155                           | 传真：0531-68889752      |
|    |            | 客服电话：95538                                 | 网址：www.qlzq.com.cn    |
| 46 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |                       |
|    |            | 法定代表人：牛冠兴                                  | 联系人：陈剑虹               |
|    |            | 联系电话：0755-82825551                         | 传真：0755-82558355      |
|    |            | 客服电话：400-800-1001                          | 网址：www.essence.com.cn |
| 47 | 东莞证券有限责任公司 | 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼               |                       |
|    |            | 法定代表人：游锦辉                                  | 联系人：梁健伟               |
|    |            | 电话：0769-22119341                           | 传真：0769-22116999      |
|    |            | 客服电话：0769-961130                           | 网址：www.dgzq.com.cn    |
| 48 | 恒泰证券股份有限公司 | 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号                 |                       |
|    |            | 法定代表人：庞介民                                  | 联系人：常向东               |
|    |            | 电话：0471-4913998                            | 传真：0471-4930707       |
|    |            | 客服电话：0471-4961259                          | 网址：www.cnht.com.cn    |
| 49 | 世纪证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼          |                       |
|    |            | 法定代表人：卢长才                                  | 联系人：王飞                |
|    |            | 电话：0755-83199511                           | 客服电话：0755-83199511    |
|    |            | 传真：0755-83199545                           | 网址：www.cscs.com.cn    |
| 50 | 厦门证券有限公司   | 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼                      |                       |
|    |            | 法定代表人：傅毅辉                                  | 联系人：卢金文               |

|    |              |                                       |                      |
|----|--------------|---------------------------------------|----------------------|
|    |              | 电话：0592-5161642                       | 传真：0592-5161140      |
|    |              | 客服电话：0592-5163588                     | 网址：www.xmzq.cn       |
| 51 | 华宝证券有限责任公司   | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层     |                      |
|    |              | 法定代表人：陈林                              | 联系人：刘闻川              |
|    |              | 电话：021-68778081                       | 传真 021-68778117      |
|    |              | 客服电话：400-820-9898                     | 网址：www.cnhbstock.com |
| 52 | 英大证券有限责任公司   | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层            |                      |
|    |              | 法定代表人：赵文安                             | 联系人：王睿               |
|    |              | 电话：0755-83007069                      | 传真：0755-83007167     |
|    |              | 客服电话：400-869-8698                     | 网址：www.ydsc.com.cn   |
| 53 | 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                    |                      |
| 54 | 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   |
| 55 | 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：010-66045500      |
|    |              | 客服电话：010-66045678                     | 网址：www.txsec.com     |
| 56 | 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   |
| 57 | 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      |
| 58 | 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                 |                       |
| 59 | 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    |
| 60 | 西部证券股份有限公司 | 注册地址：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼  |                       |
|    |            | 法定代表人：刘建武                         | 联系人：冯萍                |
|    |            | 电话：029-87406488                   | 传真：029-87406387       |
|    |            | 客服电话：95582                        | 网址：www.westsecu.com   |
| 61 | 德邦证券有限责任公司 | 注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼       |                       |
|    |            | 法定代表人：姚文平                         | 联系人：罗芳                |
|    |            | 电话：021-68761616                   | 传真：021-68767981       |
|    |            | 客服电话：4008888128                   | 网址：www.tebon.com.cn   |
| 62 | 中航证券有限公司   | 注册地址：南昌市抚河北路 291 号                |                       |
|    |            | 法定代表人：杜航                          | 联系人：余雅娜               |
|    |            | 电话：0791-6768763                   | 传真：0791-6789414       |
|    |            | 客服电话：400-8866-567                 | 网址：www.avicsec.com    |
| 63 | 东海证券有限责任公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼  |                       |
|    |            | 法定代表人：朱科敏                         | 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 |
| 64 | 方正证券股份有限公司 | 注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层   |                       |
|    |            | 法定代表人：雷杰                          | 联系人：郭瑞军               |
|    |            | 电话：0731-85832503                  | 传真：0731-85832214      |
|    |            | 客服电话：95571                        | 网址：www.foundersc.com  |

|    |            |                                 |                     |
|----|------------|---------------------------------|---------------------|
| 65 | 山西证券股份有限公司 | 注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼     |                     |
|    |            | 法定代表人：侯巍                        | 联系人：郭熠              |
|    |            | 电话：0351-8686659                 | 传真：0351-8686619     |
|    |            | 客服电话：400-666-1618               | 网址：www.i618.com.cn  |
| 66 | 湘财证券有限责任公司 | 注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼 |                     |
|    |            | 法定代表人：林俊波                       | 联系人：钟康莺             |
|    |            | 电话：021-68634518                 | 传真：021-68865680     |
|    |            | 客服电话：400-888-1551               | 网址：www.xcsc.com     |
| 67 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区月坛北街 26 号            |                     |
|    |            | 法定代表人：丁之锁                       | 联系人：陶颖              |
|    |            | 电话：010-58568040                 | 传真：010-58568062     |
|    |            | 客服电话：010-58568118               | 网址：www.hrsec.com.cn |
| 68 | 日信证券有限责任公司 | 注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号          |                     |
|    |            | 法定代表人：孔佑杰                       | 联系人：陈韦杉             |
|    |            | 电话：010-66413306                 | 传真：010-66412537     |
|    |            | 客服电话：010-88086830               | 网址：www.rxzq.com.cn  |
| 69 | 江海证券有限公司   | 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号        |                     |
|    |            | 法定代表人：孙名扬                       | 联系人：张宇宏             |
|    |            | 电话：0451-82336863                | 传真：0451-82287211    |
|    |            | 客服电话：400-666-2288               | 网址：www.jhzq.com.cn  |
| 70 | 广州证券有限责任公司 | 注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼 |                     |
|    |            | 法定代表人：刘东                        | 联系人：林洁茹             |
|    |            | 电话：020-88836999                 | 传真：020-88836654     |
|    |            | 客服电话：020-961303                 | 网址：www.gzs.com.cn   |
| 71 | 天源证券经纪有限公司 | 注册地址：青海省西宁市长江路 53 号             |                     |
|    |            | 法定代表人：林小明                       | 联系人：王斌              |
|    |            | 电话：0755-33331188                | 传真：0755-33329815    |
|    |            | 客服电话：4006543218                 | 网址：www.tyzq.com.cn  |

（二）注册登记机构

| 序号 | 机构名称 | 机构信息 |
|----|------|------|
|----|------|------|

|   |            |                                  |                 |
|---|------------|----------------------------------|-----------------|
| 1 | 国泰基金管理有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼  |                 |
|   |            | 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                        | 传真：021-38561800 |
|   |            | 联系人：何晔                           |                 |
|   |            | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 |                 |

（三）出具法律意见书的律师事务所

| 序号 | 机构名称      | 机构信息                      |                 |
|----|-----------|---------------------------|-----------------|
| 1  | 上海源泰律师事务所 | 注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼 |                 |
|    |           | 负责人：廖海                    | 联系人：廖海          |
|    |           | 电话：021-51150298           | 传真：021-51150398 |
|    |           | 经办律师：廖海、安冬                |                 |

（四）审计基金财产的会计师事务所

| 序号 | 机构名称             | 机构信息                             |                 |
|----|------------------|----------------------------------|-----------------|
| 1  | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 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：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 |                 |
|    |                  | 法人代表：杨绍信                         | 联系人：单峰          |
|    |                  | 电话：021-61238888                  | 传真：021-61238800 |
|    |                  | 经办注册会计师：汪棣、单峰                    |                 |

## 四、基金名称

国泰双利债券证券投资基金

## 五、基金类型

契约型开放式基金

## 六、投资目标

通过主要投资于债券等固定收益类品种，在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，力争为基金份额持有人谋求较高的当期收入和投资总回报。

## 七、投资理念

价格终将反映价值。

## 八、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、上市的国债、金融债、公司债、企业债、可转换公司债券(含可分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据等固定收益类品种，还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票、权证等以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券等固定收益类品种的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、权证等权益类品种的比例不超过基金资产的 20%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金对固定收益类品种的投资，将重点关注流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。本基金对股票等权益类品种的投资，将重点关注兼具稳定的高分红能力、良好盈利增长能力的上市公司股票，以增强本基金的股息收益和资本增值能力。

## 九、投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。

### 2、固定收益类资产投资策略

#### （1）久期调整策略

利率变化是影响债券价格的重要因素，本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析，预测

未来的利率变化趋势。在利率变化方向判断的基础上，确定恰当的久期目标，合理控制利率风险。在预期利率整体上升时，降低组合的平均久期；在预期利率整体下降时，提高组合的平均久期。

#### （2）收益率曲线策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

#### （3）债券类属配置策略

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究不同类型的债券品种、不同市场上债券品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

#### （4）骑乘策略

债券投资收益的来源主要由两大部分组成，第一部分是票息收入，第二部分是资本利得收入。在票息收入固定的情况下，通过主动式债券投资的管理，尽可能多的获取资本利得收入是提高本基金收益的重要手段。而资本利得收入主要是通过债券收益率下降取得的，因此本基金可以通过骑乘策略在个券收益率下降时获得资本利得。

#### （5）息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上也就是国债回购放大套利策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

#### （6）利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势作出判断，进而相应的进行债券置换。

#### （7）信用策略

本基金管理人将建立内部信用评级制度，包括发行人主体评级和债券评级。内部评级系统分为企业基本素质、财务结构、偿债能力、经营能力、经营效益以及发展前景等六方面构成。研究员将根据国民经济运行的周期阶段，分析企业的市场地位、管理水平、发展趋势、财务状况和长期、短期流动性指标等情况，结合债券担保条款、抵押品估值及债券其他要素，最后综合评价出债券发行人信用风险、评价债券的信用级别。同时结合收益率曲线形变判断，

不同信用等级产品利差变动判断以及单个券种信用等级变动的判断等来挖掘特定类别资产或特定券种的投资价值。

#### （8）可转换公司债券投资策略

可转换公司债券(含可分离交易的可转换公司债券)兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上,利用可转换公司债券定价模型进行估值分析,投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换公司债券,获取稳健的投资回报。

#### （9）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。

### 3、股票投资策略

#### （1）新股申购策略

在股票发行市场上,股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差,从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股申购所获得的股票,将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低,确定继续持有或者卖出。

#### （2）股票二级市场投资策略

本基金股票二级市场的投资策略,采用定量和定性分析相结合的方法,自下而上精选出兼具稳定的高分红能力、良好盈利增长能力的上市公司股票,以增强本基金的股息收益和资本增值能力。

##### 1) 红利上市公司筛选

本基金综合考察上市公司分红记录和分红预期等指标来筛选红利股。具体选股标准包括满足以下一项或多项特征的股票:

- ① 在过去 3 年中至少有 2 年实施分红;
- ② 过去 2 年平均股息率高于市场平均水平;
- ③ 预期股息率高于市场平均水平的上市公司。

符合上述特征之一的上市公司,构成本基金的红利股股票池。



## 2) 盈利能力分析

本基金管理人认为，企业在行业中的相对竞争优势是企业保持持续优于行业平均盈利水平的坚实基础，而企业的盈利增长能力必将在其股票价格上得到反映。因而，本基金将通过企业竞争优势分析和财务指标分析，在红利股股票池内，筛选出兼具良好盈利增长能力的上市公司，并且在它们的股票价格没有反映出它们的价值时作投资布局，以增强本基金的股息收益和资本增值能力。

本基金将从企业的公司治理、管理层、发展战略、市场份额、成本控制、技术水平及创新能力、政策因素等多方面，考察企业在行业中的竞争优势。在上述分析的基础上，本基金还将考察企业的现金流、主营业务利润率、资产负债结构、净资产收益率等财务指标，从中挑选出指标值优于同行业平均水平的上市公司，构建本基金的备选股票池。

## 3) 相对价值评估

在本基金备选股票池范围内，本基金利用相对价值评估，形成可投资的股票组合。相对价值评估主要从市场整体估值比较、国际估值比较两个角度进行。市场整体估值比较着重考察公司估值相比较市场整体估值水平的折溢价幅度；国际估值比较则将国内公司的有关估值与国际公司相应指标进行比较。通过上述两个角度的估值比较，重点选择估值水平相对较低的个股进行投资。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、权证投资策略

本基金的权证投资将以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

## 十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中证全债指数收益率×90% + 上证红利指数收益率×10%

本基金为债券基金，债券组合的业绩基准采用了中证全债指数。中证全债指数作为中证指数有限公司提供的中证系列指数之一，具有一定的优势和市场影响力。中证全债指数从上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场选择国债、金融债及企业债组成样本券，能够

较好的反映债券市场变动的全貌，市场代表性较强，比较适合作为本基金债券组合的业绩比较基准。股票组合的业绩基准采用了上证红利指数。上证红利指数挑选在上海证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 50 只股票作为样本，以反映上海证券市场高红利股票的整体状况和走势，因此该指数与本基金重点投资于“红利股”的理念是相符的，比较适合作为本基金股票组合的业绩比较基准。

将来如有更合适的指数推出，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前 2 日在至少一种指定媒体上进行公告并报中国证监会备案。

## 十一、风险收益特征

本基金为债券基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

## 十二、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 2012 年 1 月 18 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 2011 年 12 月 31 日。

### 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    | 45,000.00        | 0.00         |
|    | 其中：股票   | 45,000.00        | 0.00         |
| 2  | 固定收益投资  | 1,246,861,616.00 | 77.65        |
|    | 其中：债券   | 1,246,861,616.00 | 77.65        |
|    | 资产支持证券  | -                | -            |
| 3  | 金融衍生品投资 | -                | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 4 | 买入返售金融资产          | 146,000,459.00   | 9.09   |
|   | 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      | 112,615,658.62   | 7.01   |
| 6 | 其他各项资产            | 100,287,375.13   | 6.25   |
| 7 | 合计                | 1,605,810,108.75 | 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       | -         | -            |
| B   | 采掘业            | -         | -            |
| C   | 制造业            | 45,000.00 | 0.00         |
| C0  | 食品、饮料          | 45,000.00 | 0.00         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | -         | -            |
| C2  | 木材、家具          | -         | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | -         | -            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | -         | -            |
| C5  | 电子             | -         | -            |
| C6  | 金属、非金属         | -         | -            |
| C7  | 机械、设备、仪表       | -         | -            |
| C8  | 医药、生物制品        | -         | -            |
| C99 | 其他制造业          | -         | -            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -         | -            |
| E   | 建筑业            | -         | -            |
| F   | 交通运输、仓储业       | -         | -            |
| G   | 信息技术业          | -         | -            |
| H   | 批发和零售贸易        | -         | -            |
| I   | 金融、保险业         | -         | -            |
| J   | 房地产业           | -         | -            |
| K   | 社会服务业          | -         | -            |
| L   | 传播与文化产业        | -         | -            |
| M   | 综合类            | -         | -            |

|  |    |           |      |
|--|----|-----------|------|
|  | 合计 | 45,000.00 | 0.00 |
|--|----|-----------|------|

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      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 002650 | 加加食品 | 1,500 | 45,000.00 | 0.00         |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 101,528,311.50   | 6.55         |
| 2  | 央行票据      | 338,222,000.00   | 21.80        |
| 3  | 金融债券      | 89,407,000.00    | 5.76         |
|    | 其中：政策性金融债 | 89,407,000.00    | 5.76         |
| 4  | 企业债券      | 500,347,043.40   | 32.26        |
| 5  | 企业短期融资券   | 181,452,000.00   | 11.70        |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债       | 35,905,261.10    | 2.31         |
| 8  | 其他        | -                | -            |
| 9  | 合计        | 1,246,861,616.00 | 80.38        |

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

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 1101094 | 11央行票据94 | 1,200,000 | 115,968,000.00 | 7.48         |
| 2  | 1101096 | 11央行票据96 | 1,000,000 | 96,640,000.00  | 6.23         |
| 3  | 010203  | 02国债(3)  | 835,410   | 83,666,311.50  | 5.39         |
| 4  | 1180170 | 11新光债    | 800,000   | 79,752,000.00  | 5.14         |
| 5  | 1101088 | 11央行票据88 | 800,000   | 77,304,000.00  | 4.98         |

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、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   | 304,594.39     |
| 2  | 应收证券清算款 | 880,827.89     |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 15,979,904.04  |
| 5  | 应收申购款   | 83,122,048.81  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 100,287,375.13 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)       | 占基金资产净 |
|----|--------|------|---------------|--------|
| 1  | 110013 | 国投转债 | 26,419,240.80 | 1.70   |
| 2  | 113001 | 中行转债 | 4,729,000.00  | 0.30   |
| 3  | 110011 | 歌华转债 | 3,298,338.00  | 0.21   |
| 4  | 125887 | 中鼎转债 | 937,080.80    | 0.06   |
| 5  | 110078 | 澄星转债 | 521,601.50    | 0.03   |

(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<br>公允价值(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限情况<br>说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 002650 | 加加食品 | 45,000.00          | 0.00             | 新股流通受限       |

### 十三、基金的业绩

本基金业绩截止日为 2011 年 12 月 31 日，并经基金托管人复核。

本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。

（一）国泰双利债券 A

| 阶段                                  | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2009 年 3 月 11 日至 2009 年 12 月 31 日   | 10.17% | 0.26%     | 5.03%      | 0.22%         | 5.14%  | 0.04% |
| 2010 年度                             | 9.05%  | 0.28%     | 0.44%      | 0.17%         | 8.61%  | 0.11% |
| 2011 年度                             | -4.79% | 0.34%     | 3.31%      | 0.17%         | -8.10% | 0.17% |
| 自 2009 年 3 月 11 日至 2011 年 12 月 31 日 | 14.38% | 0.30%     | 8.99%      | 0.19%         | 5.39%  | 0.11% |

（二）国泰双利债券 C

| 阶段                                  | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2009 年 3 月 11 日至 2009 年 12 月 31 日   | 9.87%  | 0.25%     | 5.03%      | 0.22%         | 4.84%  | 0.03% |
| 2010 年度                             | 8.43%  | 0.27%     | 0.44%      | 0.17%         | 7.99%  | 0.10% |
| 2011 年度                             | -5.18% | 0.34%     | 3.31%      | 0.17%         | -8.49% | 0.17% |
| 自 2009 年 3 月 11 日至 2011 年 12 月 31 日 | 12.96% | 0.29%     | 8.99%      | 0.19%         | 3.97%  | 0.10% |

## 十四、基金费用与税收

（一）基金运作费用

1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）销售服务费；
- （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。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法

规另有规定时从其规定。

### 3、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 0.7%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 0.2%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）销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类不收取销售服务费，C 类销售服务费年费率为 0.4%。

C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

R 为 C 类基金份额适用的销售服务费率

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，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。

（4）除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，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。

#### 4、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。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管、销售服务费。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。

### （二）基金销售费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“（十一）认购费用”以及“（十三）认购份数的计算”中的相关规定。

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“八、基金份额的申购与赎回”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。

### （三）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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2011年10月25日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期。
- 2、在“二、释义”部分，更新了“《销售办法》”的释义；
- 3、更新了“三、基金管理人”的相关信息。
- 4、更新了“四、基金托管人”的相关信息。
- 5、更新了“五、相关服务机构”的相关信息。
- 6、更新了“九、基金的投资”中基金投资组合报告，相关内容为本基金2011年4季度报告内容。
- 7、更新了“十、基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核。
- 8、更新了“二十、托管协议的内容摘要”中的法定代表人信息。



9、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中的相关信息。

10、更新了“二十二、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

二〇一二年四月二十四日