

国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF） 更新招募说明书摘要

（2012 年第二号）

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）由金盛证券投资基金转型而成。依据中国证监会 2009 年 9 月 8 日证监许可[2009]925 号文核准的金盛证券投资基金基金份额持有人大会决议，金盛证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）”。自 2009 年 10 月 19 日起，由《金盛证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

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

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

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

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

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 **2012 年 10 月 19 日**，投资组合报告为 **2012 年 3 季度** 报告，有关财务数据和净值表现截止日为 **2012 年 6 月 30 日**。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

设立日期：**1998 年 3 月 5 日**

住所：上海市浦东新区世纪大道 **100 号** 上海环球金融中心 **39 楼**

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 **100 号** 上海环球金融中心 **39 楼**

法定代表人：陈勇胜

注册资本：**1.1 亿元**人民币

联系人：何晔

联系电话：**021-38569000，4008888688**

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

（二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 **2012 年 10 月 19 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 **26 只** 开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 **2 只** 子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 **300** 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 **100** 指数证券投资基金、国泰价值经典股

票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金。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。

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

林川，董事，博士研究生。2006 年 6 月至 2009 年 1 月在美国华盛顿互惠银行任高级计量分析师。2009 年 2 月至 2009 年 7 月在美国富升人寿保险任财务经理。2010 年 3 月起在中国建银投资有限责任公司风险管理部工作，现任中国建银投资有限责任公司风险管理部综合风险组负责人。2012 年 4 月起任公司董事。

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

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

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。**1994** 年 **3** 月至 **2002** 年 **2** 月在中国电力信托投资有限公司工作，历任经理部项目经理，证券部项目经理，北京证券营业部副经理，天津证券营业部副经理、经理。**2002** 年 **2** 月起在中国电力财务有限公司工作，先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记，现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。**2012** 年 **4** 月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，**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務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**起任公司独立董事。

韩少华，独立董事，大学专科，高级会计师。**1964年**起在中国建设银行河南省工作，历任河南省分行副处长、处长；南阳市分行行长、党组书记；分行总会计师。**2003年**至**2008年**任河南省豫财会计师事务所副所长。**2010年11月**起任公司独立董事。

2、监事会成员

唐建光，监事会主席，大学本科。**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。

刘顺君，监事，硕士研究生，高级经济师。**1986年7月至2000年3月**在中国人民解放军军事经济学院工作，历任教员、副主任。**2000年4月至2003年1月**在长江证券有限责任公司工作，历任投资银行总部业务主管、项目经理。**2003年1月至2005年5月**任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。**2005年6月**起在中国电力财务有限公司工作，先后任金融租赁公司筹建处综合部主任，营业管理部主任助理，华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席，福建业务部副主任、主任，现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。**2012年4月**起任公司监事。

沙旻，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。

林海中，硕士研究生，10年证券基金从业经历。2002年8月至2005年4月在中国证监会信息中心工作，历任专业助理、主任科员；2005年4月至2012年6月在中国证监会基金监管部工作，历任主任科员、副处长、处长。2012年6月起加盟国泰基金管理有限公司，2012年8月起任公司督察长。

4、本基金基金经理

（1）现任基金经理

张玮，男，硕士研究生，11年证券基金从业经历。2000年11月至2004年6月就职于申银万国证券研究所，任行业研究员。2004年7月至2007年3月就职于银河基金管理有限

公司，历任高级研究员、基金经理。2007 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹰增长股票的基金经理助理，2008 年 5 月起担任国泰金鹰增长股票的基金经理，2009 年 4 月至 2009 年 10 月兼任国泰金盛封闭的基金经理，2009 年 10 月起任国泰中小盘成长股票的基金经理，2012 年 3 月起兼任国泰成长优选股票型证券投资基金的基金经理，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任研究部副总监，2011 年 6 月起任研究部总监。2011 年 6 月至 2012 年 2 月兼任公司投资副总监，2012 年 2 月起兼任公司投资总监。

（2）历任基金经理

自本基金成立以来一直由张玮担任基金经理，无基金经理更换事项。

5、本基金投资决策委员会成员

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

投资决策委员会成员组成如下：

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

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

刘夫先生：投资副总监

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	中国农业银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号
		办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号
		法定代表人：蒋超良 客户服务电话： 95599

		联系人：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	客户服务热线：95577
		网址：www.hxb.com.cn	
9	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
10	北京银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层	
		法定代表人：闫冰竹	联系人：谢小华
		电话：010-66223587	传真：010-66226045

		客服电话：010-95526
		网址：www.bankofbeijing.com.cn
11	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
12	中国中投证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元
		法定代表人：龙增来 联系人：刘毅
		电话：0755-82023442 客服电话：400-600-8008
		网址：www.china-invs.cn
13	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号
		法定代表人：万建华 联系人：芮敏祺
		电话：021-38676161 传真：021-38670161
		客服电话：400-888-8666 网址：www.gtja.com
14	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
15	万联证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层
		法定代表人：张建军 联系人：罗创斌
		电话：020-38286651 传真：020-22373718-1013
		客服电话：400-888-8133 网址：www.wlzq.com.cn
16	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
		法定代表人：王常青 联系人：魏明
		电话：010-85130588 传真：010-65182261
		客服电话：400-888-8108 网址：www.csc108.com
17	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	
18	中国银河证券股份 有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
		法定代表人：陈有安	联系人：田薇
		电话： 010-66568430	传真： 010-66568990
		客服电话： 400-8888-888	
		网址： www.chinastock.com.cn	
19	中信证券（浙江） 有限责任公司	注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦 19 楼	
		法定代表人：沈强	联系人：周妍
		电话： 0571-86078823	客服电话： 0571-96598
		网址： www.bigsun.com.cn	
20	申银万国证券股份 有限公司	注册地址：上海市常熟路 171 号	
		法定代表人：丁国荣	联系人：邓寒冰
		电话： 021-54033888	传真： 021-54038844
		客服电话： 021-962505	网址： www.sw2000.com.cn
21	东方证券股份有 限公司	注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层- 29 层	
		法定代表人：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
22	东吴证券股份有 限公司	注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层	
		法定代表人：吴永敏	联系人：方晓丹
		电话： 0512-65581136	传真： 0512-65588021
		客服电话： 0512-33396288	网址： www.dwzq.com.cn
23	广发证券股份有 限公司	注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（ 4301-4316 房）	
		办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼	
		法定代表人：孙树明	联系人：黄岚
		电话： 020-87555888	传真： 020-87555305

		客服电话：95575	网址：www.gf.com.cn
24	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号	
		办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼	
		法定代表人：曾小普	联系人：徐美云
		电话：0791-6285337	传真：0791-6288690
		网址：www.gsstock.com	
25	民生证券股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层	
		法定代表人：余政	联系人：赵明
		电话：010-85127622	传真：010-85127917
		客服电话：400-619-8888	网址：www.msza.com
26	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
27	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	
28	中信万通证券有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室	
		办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）	
		法定代表人：杨宝林	联系人：吴忠超
		电话：0532-85022326	传真：0532-85022605
		客服电话：0532-96577	网址：www.zxwt.com.cn
29	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	

30	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	
31	长江证券股份有 限公司	注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
		法定代表人：胡运钊	联系人：李良
		电话： 027-65799999	传真： 027-85481900
		客服电话： 95579	网址： www.95579.com
32	渤海证券股份有 限公司	注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室	
		办公地址：天津市河西区宾水道 8 号	
		法定代表人：杜庆平	联系人：王兆权
		电话： 022-28451861	传真： 022-28451892
		客服电话： 400-651-5988	网址： www.bhzq.com
33	中原证券股份有 限公司	注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号	
		办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 层	
		法定代表人：菅明军	联系人：程月艳、耿铭
		电话： 0371-65585670	传真： 0371-65585665
		客服电话： 400-813-9666/0371-967218	
		网址： www.ccnew.com	
34	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
35	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	

36	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.xyjq.com.cn
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
42	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

43	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	
44	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
45	天相投资顾问有限公司	注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701	
		法定代表人：林义相	联系人：林爽
		电话：010-66045608	传真：010-66045527
		客服电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
46	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
47	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
48	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	
49	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
50	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
51	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	
52	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
53	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
54	中航证券有限公司	注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
		法定代表人：杜航	联系人：戴蕾
		电话：0791-86768681	传真：0791-86770178
		客服电话：400-8866-567	网址：www.avicsec.com
55	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
56	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
57	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
58	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
59	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：宋德清	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
60	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
61	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
62	广州证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼，20 楼	
		法定代表人：刘东	联系人：林洁茹
		电话：020-88836655	传真：020-88836654
		客服电话：020-961303	网址： www.gzs.com.cn
63	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
64	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
65	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元	
		法定代表人: 薛峰	联系人: 张玉静
		电话: 0755-33227953	传真: 0755-82080798
		客服电话: 4006-788-877	
		网址: www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com	
66	浙商证券股份有限公司	注册地址: 浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7	
		法定代表人: 吴承根	联系人: 毛亚莉
		电话: 021-64318893	传真: 021-64713795
		客服电话: 967777	网址: www.stocke.com.cn
67	新时代证券有限责任公司	注册地址: 北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层	
		法定代表人: 马金声	联系人: 孙恺
		电话: 010-83561149	传真: 010-83561094
		客服电话: 4006989898	网址: www.xsdzq.cn
68	西南证券股份有限公司	注册地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号	
		法定代表人: 余维佳	联系人: 张婷
		电话: 023-63786220	传真: 023-63786212
		网址: http://www.swsc.com.cn	
69	中银国际证券有限责任公司	注册地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层	
		法定代表人: 许刚	联系人: 李丹
		电话: 021-20328216	传真: 021-50372474
		客服电话: 4006208888	网址: www.bocichina.com
70	上海好买基金销售有限公司	注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室	
		法定代表人: 杨文斌	联系人: 李华鋆
		电话: 58870011	传真: 021-68596916
		客服电话: 400-700-9665	网址: www.ehowbuy.com
71	杭州数米基金销售有限公司	注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号	
		法定代表人: 陈柏青	联系人: 周熾旻
		电话: 0571-28829790	传真: 0571- 26698533
		客服电话: 4000-766-123	网址: www.fund123.cn

72	上海长量基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	
		法定代表人：张跃伟	联系人：沈雯斌
		电话： 021-58788678	传真： 021-58788678-8101
		客服电话： 400-089-1289	网址： www.erichfund.com

（二）注册登记机构

序号	机构名称	机构信息	
1	中国证券登记结算有限责任公司	办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层	
		法定代表人：金颖	传真： 010-58598907
		联系人：朱立元	电话： 010-58598839

（三）出具法律意见书的律师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	上海市锦天城律师事务所	注册地址：上海市浦东新区花园桥路 33 号花旗集团大厦 14 楼	
		负责人：史焕章	联系人：刘峰、孙亦涛
		电话： 021-6105-9000	传真： 021-6105-9100
		经办律师：刘峰、孙亦涛	

（四）审计基金财产的会计师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	普华永道中天会计师事务所有限公司	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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

契约型开放式基金

六、投资目标

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

七、投资范围

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

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

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

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

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

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

八、投资策略

基金管理人在构建投资组合的过程中，遵循以下投资策略：

1、资产配置策略

根据宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平，结

合基金合同的资产配置范围、组合投资止损点，借助风险收益规划模型，得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置初始比例，再进行综合的对比分析和评估后作出大类资产配置方案。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：

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

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

2、股票投资策略

（1）股票选择过程

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

（2）成长型股票筛选

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

（3）相对价值评估分析

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

（4）实地调研

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

（5）建立投资组合

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

3、债券投资策略

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

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

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

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

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

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

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

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

央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

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

由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；

市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；

单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

4、权证投资策略

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

5、资产支持证券投资策略

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

九、业绩比较基准

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

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

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

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 2 个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

十、风险收益特征

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

十一、基金投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于**2012年10月22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**2012年9月30日**，本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	576,477,517.93	83.73
	其中：股票	576,477,517.93	83.73
2	固定收益投资	56,200,192.15	8.16
	其中：债券	56,200,192.15	8.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	5,040,127.56	0.73
	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	45,469,563.41	6.60
6	其他各项资产	5,279,589.55	0.77
7	合计	688,466,990.60	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	31,840,800.00	4.65

C	制造业	281,515,043.69	41.08
C0	食品、饮料	41,661,742.96	6.08
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	42,703,425.38	6.23
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,818,863.62	2.75
C5	电子	4,158,000.00	0.61
C6	金属、非金属	61,209,527.80	8.93
C7	机械、设备、仪表	34,670,166.40	5.06
C8	医药、生物制品	78,293,317.53	11.42
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	52,510,435.20	7.66
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	7,920,000.00	1.16
H	批发和零售贸易	47,420,703.64	6.92
I	金融、保险业	27,122,880.00	3.96
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	60,957,316.60	8.89
L	传播与文化产业	67,190,338.80	9.80
M	综合类	-	-
	合计	576,477,517.93	84.12

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	300058	蓝色光标	3,154,476	67,190,338.80	9.80
2	600660	福耀玻璃	7,685,600	54,106,624.00	7.90
3	300043	星辉车模	2,552,506	42,703,425.38	6.23
4	002140	东华科技	1,816,228	42,499,735.20	6.20
5	600335	国机汽车	3,005,408	28,431,159.68	4.15
6	002567	唐人神	1,785,758	23,429,144.96	3.42

7	600518	康美药业	1,395,858	22,082,473.56	3.22
8	600489	中金黄金	1,200,000	21,828,000.00	3.19
9	601318	中国平安	502,000	21,053,880.00	3.07
10	600572	康恩贝	2,135,865	19,778,109.90	2.89

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,916,800.00	6.70
	其中：政策性金融债	45,916,800.00	6.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,190,000.00	1.49
6	中期票据	-	-
7	可转债	93,392.15	0.01
8	其他	-	-
9	合计	56,200,192.15	8.20

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	120228	12 国开 28	300,000	29,904,000.00	4.36
2	120305	12 进出 05	160,000	16,012,800.00	2.34
3	041261006	12 渝外贸 CP001	100,000	10,190,000.00	1.49
4	125887	中鼎转债	890	93,392.15	0.01

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	779,270.90
2	应收证券清算款	3,542,082.98
3	应收股利	67,770.00
4	应收利息	856,486.85
5	应收申购款	33,978.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,279,589.55

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125887	中鼎转债	93,392.15	0.01

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2012 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009 年 10 月 19 日至 2009 年 12 月 31 日	9.84%	0.53%	12.03%	1.47%	-2.19%	-0.94%
2010 年度	8.20%	1.34%	8.44%	1.38%	-0.24%	-0.04%
2011 年度	-21.74%	1.21%	-27.53%	1.17%	5.79%	0.04%
2012 年上半年	-2.45%	1.30%	4.99%	1.29%	-7.44%	0.01%

2009 年 10 月 19 日至 2012 年 6 月 30 日	-9.26%	1.24%	-7.57%	1.30%	-1.69%	-0.06%
--------------------------------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

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

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

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

（四）不列入基金费用的项目

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

（五）基金管理费和基金托管费的调整

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

（六）与基金销售有关的费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“十、基金份额的申购、赎回与转换”中的“**（六）**申购与赎回的费率”与“**（七）**申购份数与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

（七）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对**2012**年**6**月**2**日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、**在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期。
- 2、**更新了“三、基金管理人”中的相关内容。
- 3、**更新了“五、相关服务机构”中销售机构相关信息。
- 4、**更新了“十一、基金的投资”中基金投资组合报告，更新至**2012**年**9**月**30**日；

- 5、更新了“十二、基金的业绩”，更新至**2012年6月30日**；
- 6、更新了“二十三 对基金份额持有人的服务”的相关内容；
- 7、更新了“二十五 其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

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

国泰基金管理有限公司

二〇一二年十二月一日