

国泰货币市场证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2016年第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请已于2005年4月25日获中国证监会证监基金字[2005]66号文批准。

本基金的基金合同于2005年6月21日正式生效。

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“基金公司”）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审核同意，但中国证监会对本基金募集的核准，均不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理公司不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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。投资者投资于本基金，必须自担风险。

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人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。

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》。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年12月21日，投资组合报告为2016年3季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日。

第一节 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

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：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

法定代表人：唐建光

注册资本：1.1 亿元人民币

联系人：辛怡

联系电话：021-31089000, 4008888688

基金管理人股本结构如下：

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 2016 年 12 月 21 日，本基金管理人共管理 74 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长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。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

（一）董事会成员：

唐建光，董事长，大学本科，高级工程师。1982年1月至1988年10月在煤炭工业部基建司任工程师；1988年10月至1993年7月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长；1995年9月至1998年10月在煤炭部基建管理中心工作，先后任综合处处长、中心副主任；1998年10月至2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理；2005年1月起在中国建银投资有限责任公司任资产管理处置部总经理、高级业务总监。2010年11月至2014年10月任国泰基金管理有限公司监事会主席，2014年8月至2016年11月任公司党委书记，2015年8月起任公司董事长、法定代表人，2016年6月7日至2016年7月7日代任公司总经理。

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。

陈川，董事，博士研究生，经济师。2001年7月至2005年8月，在中国建设银行总行工作，历任中间业务部、投资银行部、公司业务部业务副经理、业务经理。2005年8月至2007年6月，在中国建银投资有限责任公司工作，历任投资银行部、委托代理业务部业务经理、高级副经理。2007年6月至2008年5月，在中投证券资本市场部担任执行总经理。2008年5月至2012年6月，在中国建银投资有限责任公司工作，历任投资银行部高级经理、投资部高级经理、企业管理部高级经理。2012年6月至2012年9月，任建投科信科技股份有限公司副总经理。2012年9月至2013年4月，任中建投租赁有限责任公司纪委书记、副总经理。2013年4月至2014年1月，任中国建银投资有限责任公司长期股权投资部总经理。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部业务总监。2014年5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。

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。

周向勇，董事，硕士研究生，20 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。

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。

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。

（二）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。2014 年 12 月起任公司监事。

刘顺君，监事，硕士研究生，高级经济师。1986 年 7 月至 2000 年 3 月在中国人民解放军军事经济学院工作，历任教员、副主任。2000 年 4 月至 2003 年 1 月在长江证券有限责任

公司工作，历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003年1月至2005年5月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005年6月起在中国电力财务有限公司工作，先后任金融租赁公司筹建处综合部主任，营业管理部主任助理，华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席，福建业务部副主任、主任，现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012年4月起任公司监事。

李辉，监事，大学本科。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。现任公司总经理助理。2013年11月起任公司职工监事。

束琴，监事，大专学历。1980年3月至1992年3月分别任职于人民银行安康地区分行和工商银行安康地区分行，1993年3月至2008年8月任职于陕西省住房资金管理中心。2008年8月加入国泰基金管理有限公司，先后担任行政管理部主管、总监助理。现任公司行政部副总监。2013年11月起任公司职工监事。

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。

（三）高级管理人员：

唐建光，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，14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。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，17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。

（四）本基金基金经理

1、现任基金经理

韩哲昊，男，硕士，6年证券从业经历，2010年9月至2011年9月在旻盛投资有限公司工作，任交易员。2011年9月加入国泰基金管理有限公司，历任债券交易员、基金经理助理。2015年6月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金和国泰信用债券型证券投资基金的基金经理，2015年7月起兼任国泰淘金互联网债券型证券投资基金和国泰创利债券型证券投资基金(原国泰6个月短期理财债券型证券投资基金)的基金经理，2016年12月起兼任国泰利是宝货币市场基金的基金经理。

2、历任基金经理情况

2005年5月至2005年10月由张顺太担任本基金的基金经理，2005年11月至2007年2月由林勇担任本基金的基金经理，2007年2月至2008年8月由高红兵担任本基金的基金经理。2008年9月至2010年9月由翁锡贊担任本基金的基金经理，2010年9月至2011年6月15日由翁锡贊、赵峰共同担任本基金的基金经理，2011年6月16日至2011年12月4日由赵峰担任本基金的基金经理，2011年12月5日至2012年1月8日由赵峰和胡永青共同担任本基金的基金经理，2012年1月9日起由胡永青担任本基金的基金经理。2012年12月3日起由胡永青和姜南林共同担任本基金的基金经理，2013年10月25日至2015年6月3日由姜南林担任本基金的基金经理，2015年6月4日起至2015年7月16日由姜南林和韩哲昊共同担任本基金的基金经理，2015年7月17日起至今由韩哲昊担任本基金的基金经理。

（五）投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司高级管理人员、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）

（六）上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

第二节 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。

中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2015 年连续三年荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金管理部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金管理处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 140 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资

基金共 332 只。

二、基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定, 守法经营、规范运作、严格监察, 确保业务的稳健运行, 保证基金财产的安全完整, 确保有关信息的真实、准确、完整、及时, 保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作, 对托管业务风险管理与内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处, 配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作, 独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系, 建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程, 可以保证托管业务的规范操作和顺利进行; 业务人员具备从业资格; 业务管理实行严格的复核、审核、检查制度, 授权工作实行集中控制, 业务印章按规程保管、存放、使用, 账户资料严格保管, 制约机制严格有效; 业务操作区专门设置, 封闭管理, 实施音像监控; 业务信息由专职信息披露人负责, 防止泄密; 业务实现自动化操作, 防止人为事故的发生, 技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统, 每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作, 并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时, 基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题, 电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题, 以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为, 书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第三节 相关服务机构

一、基金份额发售机构

(一) 直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司上海直销柜台	地址：上海市虹口区公平路 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 智能手机 APP 平台：iphone 交易客户端、Android 交易客户端 “国泰基金”微信交易平台	
		电话：021-31081738	联系人：李静姝

(二) 其他销售机构

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：易会满	电话：95588
		网址：www.icbc.com.cn	
2	中国农业银行股 份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
		办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
		法定代表人：周慕冰	客户服务电话：95599
		联系人：客户服务中心	传真：010-85109219
		网址：www.95599.cn	
3	中国银行股份 有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
		法定代表人：田国立	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址：www.boc.cn
4	中国建设银行股 份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 25 号	
		办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
		法定代表人：王洪章	客服电话：95533
		网址：www.ccb.com	

5	交通银行股份有限公司	注册地址: 上海市银城中路 188 号 法定代表人: 牛锡明 联系人: 张宏革 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	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
8	中信银行股份有限公司	注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 法定代表人: 孔丹 联系人: 丰靖 电话: 010-65550827 传真: 010-65550827 客服电话: 95558 网址: www.bank.ecitic.com
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: 洪崎 联系人: 王志刚、穆婷 电话: 010-58560666 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址: 北京市西城区金融大街 3 号 法定代表人: 李国华 客服电话: 95580 客服电话: 95580 网址: www.psbc.com
12	上海农村商业银行	注册地址: 上海市浦东新区浦东大道 981 号

	行股份有限公司	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	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
14	渤海银行股份有限公司	注册地址: 天津市河东区海河东路 218 号	
		法定代表人: 李伏安	联系人: 陈玮
		客服电话: 95541	传真: 022-58316259
		网址: www. cbhb. com. cn	
15	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: 叶旻
		电话: 0532-68629960	传真: 0532-85709725
		客服电话: 96588 (青岛) 400-669-6588 (全国)	
		网址: www. qdccb. com	
16	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	
17	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: 王璇 宋永成
		电话: 0755-25188269	传真: 0755-25188785
		客服电话: 4001961200	网址: www. 4001961200. com
18	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
19	哈尔滨银行股份	注册地址: 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号	

	有限公司	法定代表人: 郭志文 电话: 0451-86779608 客服电话: 95537 网址: www.hrbcom.cn	联系人: 吴昊、冯小航 传真: 0451-86779218
20	广州农村商业银行股份有限公司	注册地址: 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号 法定代表: 王继康 电话: 020-28852729 客服电话: 95313	联系人: 卢媛薇、陈捷 电话: 020-28852541 网址: www.grcbank.com
21	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 法定代表: 何沛良 电话: 0769-22866254	联系人: 林培珊、杨亢 电话: 0769-22866270 网址: www.drcbank.com
22	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 电话: 021-38676161 客服电话: 95521	联系人: 芮敏祺 传真: 021-38670161 网址: www.gtja.com
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: 王常青 电话: 010-85156398 客服电话: 95587 4008-888-108	联系人: 许梦园 传真: 010-65182261 网址: www.csc108.com
24	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 电话: 0755-82130833 客服电话: 95536	联系人: 周杨 传真: 0755-82133952 网址: www.guosen.com.cn
25	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 电话: 0755-82960167 网址: www.newone.com.cn	联系人: 黄婵君 传真: 0755-83734343

		客服电话: 400-888-8111/95565
26	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
27	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
28	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 4008895523
		网址: www.swhysc.com
		注册地址: 福建省福州市湖东路 268 号证券大厦
29	兴业证券股份有限公司	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
		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
30	万联证券有限责任公司	法定代表人: 张建军 联系人: 甘蕾
		电话: 020-38286026 传真: 020-38286588
		客服电话: 400-888-8133 网址: www.wlzq.com.cn
		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
31	民生证券股份有限公司	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.msqq.com
32	东吴证券股份有	注册地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

	限公司	法定代表人: 范力 电话: 0512-62938521 全国客服电话: 95330	联系人: 陆晓 传真: 0512-65588021 网址: www.dwzq.com.cn
33	东方证券股份有限公司	注册地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层	
		法定代表人: 潘鑫军	联系人: 吴宇
		电话: 021-63325888	传真: 021-63326173
		客服电话: 95503	网址: www.dfzq.com.cn
34	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
35	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	
36	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	
37	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
38	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
39	中信证券股份有限公司	注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座	
		法定代表人: 张佑君	
		电话: 010-60838888	
		网址: www.cs.ecitic.com	
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	
		电话: 022-28451861	
		客服电话: 400-651-5988	网址: www.bhzq.com
41	中信证券(山东)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	
		电话: 0532-85023924	
		客服电话: 95548	网址: www.citicssd.com
42	华泰证券股份有限公司	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	
		电话: 0755-82492193	
		客服电话: 95597	
43	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: 崔少华	
		电话: 027-65799999	
		客服电话: 95579	网址: www.95579.com
44	国海证券股份有限公司	注册地址: 广西桂林市辅星路 13 号	
		法定代表人: 张雅锋	联系人: 牛孟宇

		电话: 0755-83709350	传真: 0755-83704850
		客服电话: 95563	网址: www.ghzq. com. cn
45	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	
46	中泰证券股份有限公司	注册地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号	
		办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号	
		法定代表人: 李玮	联系人: 吴阳
		电话: 0531-68889155	传真: 0531-68889185
		客服电话: 95538	网址: www. zts. com. cn
47	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: 王连志	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	
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: 王旭华
		电话: 0471-4972343	传真: 0471-4961259
		客服电话: 0471-4961259	网址: www. cnht. com. cn
49	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
50	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: 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		
51	长城国瑞证券有限公司	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: 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	
52	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	
53	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	
54	中国国际金融股份有限公司	注册地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 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		
55	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	
56	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	
57	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
58	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
59	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	
60	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
61	西部证券股份有限公司	注册地址: 陕西省西安市东新街 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
62	平安证券股份有限公司	注册地址: 深圳市福田中心区金田路 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
63	德邦证券股份有限公司	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: 朱磊
		电话: 021-68761616	传真: 021-68767880
		客服电话: 4008888128	网址: www.tebon.com.cn
64	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: 王宜四	联系人: 史江蕊

		电话: 010-64818301	传真: 010-64818443
		客服电话: 400-88-95335	网址: www.avicsec.com
65	东海证券股份有限公司	注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层	
		法定代表人: 刘化军	联系人: 李涛
		电话: 0519-88157761	传真: 0519-88157761
		客服电话: 400-888-8588	网址: www.longone.com.cn
66	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
67	山西证券股份有限公司	注册地址: 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼	
		法定代表人: 侯巍	联系人: 郭熠
		电话: 0351-8686659	传真: 0351-8686619
		客服电话: 400-666-1618、95573	
		网址: www.i618.com.cn	
68	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
69	华融证券股份有限公司	注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号	
		法定代表人: 宋德清	联系人: 黄恒
		电话: 010-58568235	传真: 010-58568062
		客服电话: 010-58568118	网址: www.hrsec.com.cn
70	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
71	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
72	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
73	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
74	中银国际证券有限责任公司	注册地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层	
		法定代表人: 许刚	联系人: 王炜哲
		电话: 021-20328309	传真: 021-50372474
		客服电话: 4006208888	网址: www.bocichina.com
75	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
76	西南证券股份有限公司	注册地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号	
		法定代表人: 余维佳	联系人: 张煜
		电话: 023-63786141	传真: 023-63786212
		网址: www.swsc.com.cn	
77	国都证券股份有限公司	注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	
		法定代表人: 常喆	联系人: 黄静
		电话: 010-84183333	传真: 010-84183311-3389
		客服电话: 4008188118	网址: www.guodu.com
78	开源证券有限责任公司	注册地址: 西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
		法定代表人: 李刚	联系人: 王姣
		电话: 029-68633210	客服电话: 400-860-8866
		网址: www.kysec.cn	

79	华安证券股份有限公司	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
80	华鑫证券有限责任公司	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: 王逍 电话: 021-64339000 客服电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918 网址: www.cfsc.com.cn
81	国金证券股份有限公司	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
82	中信期货股份有限公司	注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座 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
83	申万宏源西部证券有限公司	注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区 (新市区) 北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人: 李季 联系人: 王怀春 电话: 0991-2307105 传真: 0991-2301927 客服电话: 4008000562 网址: www.hysec.com
84	华西证券股份有限公司	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
85	华泰联合证券有限责任公司	注册地址: 广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 (01A, 02-04), 17A, 18A, 24A-26A	
		法定代表人: 吴晓东	客服电话: 0755-82492010
		网址: www.lhzq.com	
86	九州证券股份有限公司	注册地址: 青海省西宁市中区西大街 11 号工商银行 3 楼	
		法定代表人: 曲国辉	客服电话: 95305
		网址: www.jzsec.com	
87	杭州联合农村商业银行股份有限公司	注册地址: 杭州市建国中路 99 号	
		法定代表: 张晨	联系人: 仇侃宁
		电话: 0571-87923225	传真: 0571-87923214
		客服电话: 96592	网址: www.urcb.com
88	包商银行股份有限公司	注册地址: 内蒙古包头市钢铁大街 6 号	
		法定代表: 李镇西	法定代表: 刘芳
		电话: 0472-5189051	电话: 0472-5189057
		客服电话: 96016 (北京、内蒙古地区)	
		网址: www.bsb.com.cn	
89	山东寿光农村商业银行股份有限公司	注册地址: 山东寿光市银海路 19 号	
		法定代表: 颜廷军	联系人: 周淑贞
		电话: 0536-5293756	传真: 0536-5293756
		客服电话: 0536-96633	
90	晋商银行股份有限公司	注册地址: 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座	
		法定代表: 阎俊生	
		客服电话: 95105588	网址: www.jshbank.com
91	宁波银行股份有限公司	注册地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号	
		法定代表人: 陆华裕	
		客服电话: 95574	
		网址: www.nbcb.com.cn	
92	张家港农村商业	注册地址: 张家港市人民中路 66 号	

	银行股份有限公司	法定代表: 王自忠	联系人: 朱芳
		电话: 0512-96065	客服电话: 0512-96065
		传真: 051256968259	
		网址: www.zrcbank.com	
93	恒丰银行股份有限公司	地址: 山东省烟台市芝罘区南大街 248 号	
		法定代表: 蔡国华	
		客服电话: 400-813-8888	
		网址: www.egbank.com	
94	昆仑银行股份有限公司	注册地址: 新疆克拉玛依市世纪大道 7 号	
		法定代表人: 蒋尚军	联系人: 张碧华、王翔宇
		客服电话: 4006696569	传真: 010-89025421
		网址: www.klb.cn	
95	广发银行股份有限公司	注册地址: 广东省越秀区东风东路 713 号	
		法定代表人: 杨明生	
		电话: 020-38322888	传真: 020-87310955
		客服电话: 400-830-8003	
		网址: www.cgbchina.com.cn	
96	苏州银行股份有限公司	注册地址: 江苏省苏州工业园区钟园路 728 号	
		法定代表人: 王兰凤	
		电话: 0512-69868365	传真: 0512-69868370
		客服电话: 0512-96067	
		网址: www.suzhoubank.com	
97	浙江泰隆商业银行股份有限公司	地址: 浙江省台州市路桥区南官大道 188 号泰隆大厦	
		法定代表人: 王钧	
		网站: www.zjt1cb.com	
		客户服务电话: 400-88-96575 0576-96575	
98	江苏江南农村商业银行股份有限公司	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.
99	浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司	注册地址: 浙江省绍兴市柯桥笛扬路 1363 号
		法定代表: 俞俊海 联系人: 孟建潮
		电话: 0575-84788101 传真: 0575-84788134
		客服电话: 0575-81105323
		网址: www.borf.cn

2、第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息	
1	诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司	注册地址: 上海市虹口区飞虹路 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	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股权置地大厦 8 楼 801	
		办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股权置地大厦 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: 何昳
		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 0571-88920897 网址: www.5ifund.com
8	江苏金百临投资咨 询有限公司	注册地址: 无锡市滨湖区锦溪路 99 号
		法定代表: 费晓燕 联系人: 袁丽萍
		电话: 0510-82758877 传真: 0510-88555858
		客服电话: 0510-9688988 网址: www.jsjbl.com
9	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
10	众升财富(北京) 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: 李招弟	联系人: 李艳
		电话: 010-59497361	传真: 010-64788016
		客服电话: 400-059-8888	
11	上海利得基金销售有限公司	注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室	
		法定代表: 盛大	联系人: 叶志杰
		电话: 021-50583533	传真: 021-50583633
		客服电话: 400-067-6266	
		网址: www.leadfund. com. cn	
12	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	注册地址: 北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室	
		办公地址: 北京市海淀区中关村东路 1 号院 8 号楼 C 座 1701 室	
		法定代表: 齐凌峰	联系人: 阮志凌
		电话: 010-82151989	传真: 010-82158830
		客服电话: 400-158-5050	网址: www.9ifund. com
13	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址: 杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦)1 幢 10 楼 1001 室	
		办公地址: 杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富	
		法定代表: 徐黎云	联系人: 孙成岩
		电话: 0571-88337888	传真: 0571-56899710
		客服电话: 400-068-0058	
14	嘉实财富管理有限公司	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: 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	
15	宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809	
		法定代表: 沈伟桦	联系人: 王巨明
		电话: 010-52858244	传真: 010-85894285

		客服电话: 400-6099-200	网址: www.yixinfund.com
16	一路财富(北京)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	
17	北京增财基金销售有限公司	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	
18	上海联泰资产管理有限公司	注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室	
		办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层	
		法定代表人: 燕斌	联系人: 兰敏
		电话: 021-52822063	传真: 021-52975270
		客服电话: 400-166-6788	网址: www.66zichan.com
19	上海汇付金融服务有限公司	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	网址: tty.chinapnr.com
		手机客户端: 天天盈基金	
20	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	
21	泰诚财富基金销售(大连)有限公司	注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号	
		法定代表人: 林卓	
		电话: 0411-88891212	传真: 0411-84396536

		客服电话: 4006411999 网址: www.taichengcaifu.com
22	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
23	北京乐融多源投资咨询有限公司	注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙楼 2 层 222 单元
		办公地址: 北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层
		法定代表人: 董浩
		客户服务电话: 400-068-1176
		网址: www.hongdianfund.com
24	北京微动利投资管理有限公司	注册地址: 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室
		法定代表人: 梁洪军
		客户服务电话: 400-819-6665
		网址: www.buyforyou.com.cn
25	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
26	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
27	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: 齐小贺
		联系人: 杨涛
		电话: 0755-83999907-815
		传真: 0755-83999926
28	珠海盈米财富管理有限公司	客服电话: 0755-83999907
		网址: www.jinqianwo.cn
		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: 肖雯
		联系人: 李孟军
29	北京新浪仓石基金销售有限公司	电话: 18500050725
		传真: 021-63333390
		客服电话: 020-89629099
		网址: www.yingmi.cn
		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
30	上海万得投资顾问有限公司	法定代表: 李昭琛
		联系人: 付文红
		电话: 010-62676405
		传真: 010-82607151
31	北京汇成基金销售有限公司	客服电话: 010-62675369
		网址: www.xincai.com
		注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
		法定代表: 王廷富
		联系人: 姜吉灵
		电话: 021-51327185
		传真: 021-50710161
		客服电话: 400-821-0203
		注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
		法定代表: 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.fundzone.cn
32	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
		法定代表: 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
33	北京格上富信投资顾问有限公司	注册地址: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
		办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
		法定代表: 李悦章 联系人: 曹庆展
		电话: 010-68983311 传真: 010-65983333
		客服电话: 400-066-8586
		网址: www.igesafe.com

二、注册登记人

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: 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层
		法定代表人: 唐建光 传真: 021-31081800
		联系人: 辛怡
		客户服务专线: 400-888-8688, 021-31089000

三、募集成立出具法律意见的律师事务所和经办律师

序号	机构名称	机构信息
1	北京市金杜律师事务所	注册地址: 北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
		负责人: 王玲 联系人: 靳庆军、宋萍萍
		电话: 010-58785588 传真: 010-58785599
		经办律师: 靳庆军、宋萍萍

四、会计师事务所和经办注册会计师

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：胡逸嵘

经办注册会计师：许康玮、胡逸嵘

第四节 基金的名称

国泰货币市场证券投资基金

第五节 基金的类型

契约型开放式

第六节 投资目标

在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。

第七节 投资范围和投资对象

本基金投资于具有良好流动性货币市场工具，主要包括以下：现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

第八节 投资理念

价格终将反映价值，即在市场定价的不均衡中寻求投资收益和组合流动性的均衡。

第九节 投资策略

本基金主要为投资者提供流动性现金管理工具，主要结合短期利率变动，合理安排债券组合期限和类属比例，在保证本金安全性、流动性的前提下，获得超过基准的较高收益。根据对宏观经济指标长期趋势的判断、市场预期相对于趋势偏离的程度和各类金融工具的流动性特征，决定组合中债券与其他资产的比例分布。考虑法律法规的相关规定、各类属资产的到期收益率、税收、相对收益差额及不同类属资产的流动性指标等因素决定债券组合的类属配置。通过期限配置和收益率曲线配置来建立债券组合。

第十节 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：同期 7 天通知存款利率（税后）。

注：本基金管理人于 2008 年 12 月 29 日在《中国证券报》刊登了《关于变更国泰货币市场证券投资基金业绩比较基准和修改基金合同的公告》，本基金管理人经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案同意后，决定变更本基金的业绩比较基准，同时修改本基金合同的相关内容。

自 2009 年 1 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由原约定的“一年期银行定期储蓄存款的税后利率[即 $(1 - \text{利息税率}) * \text{一年期银行定期储蓄存款利率}$]”，变更为：“同期 7 天通知存款利率（税后）”。

上述业绩比较基准的变更主要是基于本基金定位于现金管理的工具，采用同期 7 天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准，更能体现本基金良好的流动性。

上述变更事项对本基金投资及基金份额持有人利益无不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

第十一节 风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合型基金。

第十二节 基金投资组合报告

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 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 2016 年 9 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	10,831,702,791.62	43.16
	其中：债券	10,831,702,791.62	43.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,063,407,077.01	4.24
	其中：买断式回购的买入返售	351,106,968.56	1.40
3	银行存款和结算备付金合计	12,717,114,263.60	50.68
4	其他各项资产	481,933,008.74	1.92
5	合计	25,094,157,140.97	100.00

（二）报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	13.44	
	其中：买断式回购融资	0.04	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,391,393,272.90	15.66
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

(三) 基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余期限未超过 120 天。

2、报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	32.10	15.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	17.83	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	30.41	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	6.91	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天（含）—397 天（含）	26.43	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		113.68	15.66

(四) 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余期限未超过 240 天。

(五) 报告期末按券种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	1, 128, 643, 870. 20	5. 21
	其中：政策性金融债	1, 128, 643, 870. 20	5. 21
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	4, 901, 864, 810. 53	22. 64
6	中期票据	—	—
7	同业存单	4, 801, 194, 110. 89	22. 18
8	其他	—	—
9	合计	10, 831, 702, 791. 62	50. 03
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

(六) 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140201	14国开01	5, 800, 000	585, 250, 333. 95	2. 70
2	011699344	16兗州煤业SCP002	4, 000, 000	399, 959, 759. 13	1. 85
3	011699173	16兗州煤业SCP001	3, 500, 000	349, 682, 388. 19	1. 62
4	011698464	16苏交通SCP014	3, 000, 000	299, 871, 477. 26	1. 39
5	111697427	16江阴农村商业银行CD007	3, 000, 000	299, 603, 052. 19	1. 38
6	111697479	16贵阳银行CD038	3, 000, 000	291, 245, 888. 35	1. 35
7	160204	16国开04	2, 800, 000	279, 946, 528. 78	1. 29
8	011699037	16同煤SCP001	2, 000, 000	199, 984, 447. 73	0. 92
9	011699533	16兗州煤业SCP004	2, 000, 000	199, 936, 892. 99	0. 92
10	011698465	16平安不动SCP001	2, 000, 000	199, 811, 284. 66	0. 92

(七) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0. 25(含)-0. 5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0. 1261%
报告期内偏离度的最低值	0. 0427%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0788%
------------------------	---------

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

(八) 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。

(九) 投资组合报告附注

1、基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

2、本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本未超过基金资产净值的 20%。

3、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内受到公开谴责、处罚的情况。

4、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	105,775,772.09
4	应收申购款	375,888,552.85
5	其他应收款	268,683.80
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	481,933,008.74

第十三节 基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 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	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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
2005 年 6 月 21 日至 2005 年 12 月 31 日	0.9621%	0.0043%	0.9567%	0.0000%	0.0054%	0.0043%
2006 年度	1.7532%	0.0039%	1.8799%	0.0003%	-0.1267%	0.0036%
2007 年度	3.2968%	0.0084%	2.7850%	0.0019%	0.5118%	0.0065%
2008 年度	2.8041%	0.0044%	3.7621%	0.0012%	-0.9580%	0.0032%
2009 年度	1.5294%	0.0054%	1.3500%	0.0000%	0.1794%	0.0054%
2010 年度	1.8245%	0.0044%	1.3500%	0.0000%	0.4745%	0.0044%
2011 年度	3.0368%	0.0057%	1.4597%	0.0001%	1.5771%	0.0056%
2012 年度	3.5940%	0.0052%	1.4139%	0.0002%	2.1801%	0.0050%
2013 年度	3.8584%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	2.5084%	0.0024%
2014 年度	4.2115%	0.0046%	1.3500%	0.0000%	2.8615%	0.0046%
2015 年度	3.8662%	0.0040%	1.3500%	0.0000%	2.5162%	0.0040%
2016 年上半年	1.3651%	0.0017%	0.6713%	0.0000%	0.6938%	0.0017%
自 2005 年 6 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日	37.1805%	0.0064%	19.6787%	0.0022%	17.5018%	0.0042%

第十四节 基金的费用和税收

一、基金费用的种类

- 基金管理人的管理费；
- 基金托管人的托管费；
- 基金投资交易费用；
- 基金合同生效后与基金相关的基金信息披露费用；

- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、基金销售服务费，具体计提办法按中国证监会的具体规定及基金合同约定执行；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

二、基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

- 1、费率：年费率 0.33%
- 2、计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

- 3、计提方式与支付方式：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 2 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、休息日等，支付日期顺延。

（二）基金托管人的基金托管费

- 1、费率：年费率 0.10%
- 2、计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

- 3、计提方式与支付方式：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，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（三）基金的销售服务费

- 1、费率：年费率 0.25%
- 2、计提标准：基金销售服务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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

3、计提方式与支付方式：基金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基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人指定的基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（四）其他费用

本节第一条第 3、4、5、6、8 款约定的费用，根据相关法律法规、基金合同及其他相关合同，按照费用实际支出金额，列入当期基金费用。

三、基金费率的调整

基金管理人、基金托管人和基金销售机构可磋商酌情调整基金管理费、托管费和销售服务费费率。调高该费率的，必须符合相关法律法规及基金合同的约定；调低费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于调整后新费率实施日前三个工作日在至少一种指定报刊和网站等媒介刊登公告。

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事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效之前的费用，包括但不限于律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产列支。国家另有规定的除外。

五、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十五节 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《证券投资基金销售管理方法》、《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8月4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“第三节 基金管理人”中的相关信息；
- 3、更新了“第四节 基金托管人”中的相关信息；
- 4、更新了“第五节 相关服务机构”中的相关信息；
- 5、更新了“第八节 基金份额的申购、赎回与转换”中的相关信息；
- 6、更新了“第九节 基金的投资”中的基金投资组合报告为本基金2016年3季度报告内容；
- 7、更新了“第十节 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“第二十一节 对基金份额持有人的服务”中的相关内容；
- 9、更新了“第二十二节 其他应披露的事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

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

国泰基金管理有限公司

二〇一七年一月二十六日