

本基金管理人的董事会和独立董事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约定,于2018年8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。

本报告期内未发生基金份额持有人投诉事项,未发生基金份额持有人投诉事项。

本报告期内未发生基金份额持有人投诉事项,未发生基金份额持有人投诉事项。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	股权投资	1,180,092,887.25	90.06
	其中:股票	1,180,092,887.25	90.06
2	固定收益投资	20,000,000.00	1.53
	其中:债券	20,000,000.00	1.53
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和拆借金融资产	98,008,256.81	7.53
7	合计	11,677,893.58	0.89
8	其他	3,211,079,094.41	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	921,204,457.69	73.25
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,981,764.50	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	-	-
J	金融业	231,379,421.71	18.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	6,956,329.96	0.55
O	医药服务业、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,569,893.52	0.92
S	基金	-	-
T	合计	1,180,092,887.25	93.89

(三) 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	601318	中国平安	1,909,326	124,086,668.26	9.82
2	300288	三安光电	5,340,227	124,077,884.52	9.81
3	000619	海螺水泥	189,388	123,727,016.64	9.84
4	000323	润兴股份	2,252,548	122,383,182.16	9.77
5	000668	泸州老窖	2,069,176	116,858,182.25	9.28
6	000939	华彬集团	2,626,174	113,027,884.76	8.99
7	600779	水井坊	2,975,025	109,760,853.60	8.72
8	601041	中国太保	1,679,126	66,598,000.86	4.53
9	000418	小天鹅A	861,478	66,476,837.62	4.51
10	000858	五粮液	606,194	40,226,370.24	3.20

(四) 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150207	15国债07	200,000	200,000,000.00	1.59

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150207	15国债07	200,000	200,000,000.00	1.59

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

3、其他各项资产投资

序号	名称	金额(元)
1	应收利息	280,501.73
2	存出保证金	10,178,496.14
3	应收股利	-
4	其他应收款	86,276.46
5	预付款项	36,540.22
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,667,983.56

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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。

第十二节 基金的投资

基金业绩截止日为2017年12月31日,并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守守诚、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定能盈利,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现。投资者投资,应事先了解投资,根据自身情况进行独立判断,自行承担投资风险。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

基金管理人依照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制、投资组合比例等进行投资,力求实现基金的投资目标,力争取得超越业绩比较基准的长期稳定回报。

1000万元(含)以上 1000元(单笔)

基金的申购费用由申请人承担,由基金管理人收取,用于市场推广、销售等各项费用。

(二) 本基金赎回费随基金持有时间的增加而递减,赎回费率为:

持有时间少于7天 1.5%;

持有时间超过7天(含)少于一年 0.5%;

持有时间超过一年(含)少于两年 0.2%;

持有时间超过两年(含) 0

(注:1年指365日,2年为730日,以此类推)。

赎回费用由赎回人承担,其中25%归基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关费用。

(三) 本基金对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

(四) 转换费

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出转入基金的申购费补差两部分构成,具体取费情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

(1) 转出基金赎回费:按转出基金正常赎回的赎回费率收取费用。其中25%归转出基金基金财产,其余作为注册登记费和相关的手续费。

(2) 转入基金申购补差费:按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率,补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额;转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的,补差费为零。

2.计算基金转换费用所涉及到的赎回费和申购费均采用当日费率。

注:转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

(四、不列入基金费用的项目

基金管理人及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资产的损失,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。基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等不列入基金费用。

五、基金管理人及基金托管人应遵守并履行法律法规、基金合同及托管协议的约定。

六、本基金运作过程中涉及的各项纳税义务,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十四节 对基金招募说明书更新后的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2018年1月31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“第一节 绪言”中的相关信息;

3、更新了“第二节 释义”中的相关信息;

4、更新了“第三节 基金管理人”中的相关信息;

5、更新了“第五节 相关服务机构”中的相关信息;

6、更新了“第七节 基金的投资”中与“基金的投资”中的相关信息;

7、更新了“第九节 基金的投资”中“基金的投资”中的相关信息;

8、更新了“第十节 基金的业绩”中的相关信息;

9、更新了“第十二节 基金费用估值”中的相关信息;

10、更新了“第十四节 基金费用与税收”中的相关信息;

11、更新了“第十六节 基金的信息披露”中的相关信息;

12、更新了“第十七节 风险揭示”中的相关信息;

13、更新了“第十八节 托管协议内容摘要”中的相关信息;

14、更新了“第二十一节 对基金份额持有人的服务”中的相关信息;

15、更新了“第二十二节 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全文,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 二〇一八年八月一日

关于光大证券股份有限公司 新增销售国泰结构转型灵活 配置混合型证券投资基金C类 份额并开通定期定额投资及 转换业务的公告

根据国泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)与光大证券股份有限公司(以下简称“光大证券”)签署的基金销售协议,光大证券决定自2018年8月1日起新增本

基金管理人管理的国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金C类份额(以下简称“本

基金,基金代码:000203)并开通定期定额投资及转换业务。投资者可通过光大证券办

理本基金的开户、申购、赎回、定期定额投资、转换等业务。具体公告如下:

一、适用范围

二、新增销售机构及具体联系方式

光大证券股份有限公司

地址:上海市浦东新区新闸路1508号3楼

客服电话:962520

网址:www.ebscn.com

三、投资者可通过以下途径咨询有关详情

国泰基金管理有限公司

客服电话:400-888-8888(免长途话费)·021-31089000