国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2018年12月10日
公告日期:2018年12月5日

一、重要声明与提示

《国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》）和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资人详细查阅刊登在2018年8月17日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）
2、基金类型:股票型
3、基金运作方式:契约型上市开放式
4、基金存续期限:不定期
5、基金份额的申购与赎回
投资人可通过场外或场内两种方式申购或赎回基金份额（基金代码:501309）。
办理基金份额场内申购、赎回业务的销售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位。办理基金份额场外申购、赎回业务的机构为基金管理人的直销机构及其他场外销售机构。
6、跨系统转托管:基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转托管的行为。
7、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:
份额简称:港股通，交易代码:501309
8、基金份额总额:截至2018年12月3日,本基金的份额总额为226,064,924.81份
9、基金份额净值:截至2018年12月3日,本基金的份额净值为1.0009元
10、本次上市交易的份额总额:截至2018年12月3日,本次上市交易的份额总额为72,059,169.00份
11、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
12、上市交易日期:2018年12月10日
13、基金管理人:国泰基金管理有限公司
14、基金托管人:招商银行股份有限公司
15、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况
1、本基金募集申请的注册机构和注册文号:中国证监会证监许可【2018】345号
2、基金合同生效日:2018年11月6日
3、基金运作方式:契约型上市开放式
4、基金合同期限:不定期
5、发售日期:2018年8月22日至2018年10月31日
6、发售份额:100亿人民币
7、发售方式:本基金通过场内、场外两种方式公开发售
8、发售机构
（1）场内发售机构
本基金场内销售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。
（2）场外发售机构
1）直销机构:国泰基金管理有限公司。
2）其他场外销售机构:
北京汇成基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、泰诚财富基金销售（大连）有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、通华财富（上海）基金销售有限公司、汇付基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、上海挑石财富基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、招商银行股份有限公司、北京创金启富基金销售有限公司、平安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、中万宏源证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中万宏源西部证券有限公司

9、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
10、认购资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为225,955,789.89元人民币,折合基金份额225,955,789.89份;认购资金在募集期间产生的银行利息共计109,134.92元人民币,折合基金份额109,134.92份,已分别计入各基金份额持有人的基金账户,归各基金份额持有人所有。上述资金总额已于2018年11月5日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11、基金备案情况
本基金于2018年11月5日验资完毕,2018年11月5日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续,并于2018年11月6日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日:2018年11月6日。
13、基金合同生效日的基金份额总额:226,064,924.81份
（二）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2018]148号
2、上市交易日期:2018年12月10日
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。投资人在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、上市交易份额简称:港股通
5、交易代码:501309
6、本次上市交易份额:72,059,169.00份
7、基金资产净值的披露:每个工作日成国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的次日公布该日的基金份额净值，并按照上海证券交易所的规定在上海证券交易所行情发布系统进行揭示。
8、未上市交易份额的流通规定:
未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。本基金的转托管业务将于2018年12月10日起开始办理,具体详见本基金管理人的相关公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）持有人户数
截至2018年12月3日,本基金的场内基金份额持有人户数:286户,平均每户持有的场内基金份额:251,955.14份;本基金的场外基金份额持有人总户数:895户,平均每户持有的场外基金份额:172,073.47份。
（二）持有人结构
截至2018年12月3日,场内基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为10,506,032.00份,占本次上市交易基金份额比例为14.58%;个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为61,553,137.00 份,占本次上市交易基金份额比例为85.42%。
（三）场内前十名基金份额持有人的情况:
截至2018年12月3日,场内前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	上海奉贤住宅建设有限公司	6,503,972.00	9.03%
2	纪巧慧	5,723,375.00	7.94%
3	安徽皖信人力资源管理有限公司	4,002,060.00	5.55%
4	王晓松	4,000,000.00	5.55%
5	陈广才	2,999,540.00	4.16%
6	赵丹辰	2,249,607.00	3.12%
7	刘臻	1,999,990.00	2.78%
8	徐惠君	1,289,994.00	1.80%
9	王巧华	1,119,856.00	1.55%
10	刘晓平	1,099,297.00	1.53%
合计		30,997,771.00	43.01%

（四）基金管理人的从业人员持有本基金的情况:
截至2018年12月3日,基金管理人的从业人员持有本基金的情况如下表。

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	340.99	0.00002%

（五）基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人，以及本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间情况:
截至2018年12月3日,基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人,以及本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间情况如下表。

项目	持有本基金份额总量的数量区间（万份）
基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金	0
本基金基金经理持有本基金	0

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、基本信息
名称:国泰基金管理有限公司
设立日期:1998年3月5日
住所:中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室
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:陈勇胜
总经理:周向勇
注册资本:壹亿壹千万元人民币
设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]5号
营业执照统一社会信用代码:91310000063183949 17Y
经营范围:基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务
联系人:辛怡
联系电话:021-31089000,400-888-8688
股东及出资比例

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%

2、内部组织结构及职能
公司建立并完善了科学的治理结构,目前有独立董事4名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会,对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督;
在组织结构方面,公司设立的执行委员会、投资决策委员会、市场管理工作委员会、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资、市场工作和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任,既相互独立,又相互合作和制约,形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系;
公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念,形成了诚信为本和稳健经营的企业文化;
公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。
3、人员情况
截至2018年9月30日,公司正式员工260人,其中61.15%（159人）的员工具有硕士及以上学历。
4、信息披露负责人:李永梅
咨询电话:400-888-8688
5、基金管理业务情况
截至2018年9月30日,本基金管理人共管理93只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰金龙行业证券投资基金、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）、国泰盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰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)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来,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、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、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、国泰安康灵活配置混合型证券投资基金（原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、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰汇源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债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,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

6、本基金基金经理
吴向军，硕士研究生,14年证券基金从业经历。2004年6月至2007年6月在美国Avera Global Partners工作，担任股票分析师;2007年6月至2011年4月美国Security Global Investors工作,担任高级分析师。2011年5月起加盟国泰基金管理有限公司,2013年4月起任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年8月至2017年12月兼任国泰美国房地产开发股票型证券投资基金的基金经理,2015年7月起任国泰纳斯达克100指数证券投资基金和国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理,2015年12月起任国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金的基金经理,2017年9月起兼任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）的基金经理,2018年5月起兼任纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2018年11月起兼任国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2015年8月至2016年6月任国际业务部副总监,2016年6月至2018年7月任国际业务部副总监（主持工作）,2017年7月起任海外投资总监,2018年7月起任国际业务部总监。

（二）基金托管人
1、基本情况
名称:招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755-83199084
传真:0755-83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕
2、发展概况
招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌（股票代码:600036）,是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码:3968）,10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2018年6月30日,本集团总资产65,373.40亿元人民币,高级法下资本充足率15.08%,权重法下资本充足率12.44%。
2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经投中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工82人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。
招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值,独创“63托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。
招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获得该奖项的托管银行;“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理[金贝奖]“最佳资产托管银行”;2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”,2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项,同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖,5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。
3、主要人员情况
李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士,吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局港口控股有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局仓储物流投资控股有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。
田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。
王良先生,本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长（主持工作）;2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理;2015年1月起担任本行副行长;2016年11月起兼任本行董事会秘书。
姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。
4、基金托管业务经营情况
截至2018年6月30日,招商银行股份有限公司累计托管389只开放式基金。
（三）基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元
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:魏佳亮
经办注册会计师:许康玮、魏佳亮

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要请见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金自基金合同生效至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）2018年12月3日资产负债表（未经审计）如下:

国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）
2018年12月3日资产负债表

（除特别注明外,金额单位为人民币元）

资产	本期末2018年12月3日
资产:	
银行存款	226,064,924.81
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	389,627.64
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	226,454,152.45
负债与持有人权益	
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	125,474.27
应付托管费	33,469.79
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	29,999.76
其他负债	-
负债合计	188,943.81
所有者权益:	
实收基金	226,064,924.81
未分配利润	200,283.82
所有者权益合计	226,265,208.64
负债和所有者权益总计	226,454,152.45

注:报告截止日2018年12月3日,本基金份额净值:1.0009元,本基金份额总额:226,064,924.81份。

八、基金投资组合
截至2018年12月3日,国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）的投资组合如下:
（一）报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	226,454,152.45	100
6	其他各项资产	-	-
7	合计	226,454,152.45	100

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
2、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
1、期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
2、期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
（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
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
（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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
（七）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
注:本基金本报告期末未持有权证。
（八）报告期末本基金投资股指期货交易情况说明
注:截至本报告期末,本基金未进行股指期货交易。
（九）投资组合报告附注
1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
2、基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。
3、其他各项资产构成:
注:本基金本报告期末未持有其他资产。
4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。
5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
九、重大事件揭示
国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）基金合同已于2018年11月6日正式生效,基金管理人于2018年11月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站（www.gtfund.com）上刊登《国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）基金合同生效公告》。
十、基金管理人承诺
本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。
十一、基金托管人承诺
基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
（一）严格遵守《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,如发现基金管理人违反法律法规、本基金《基金合同》和《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。
（三）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。
十二、备查文件目录
以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资人可在办公时间免费查阅。
（一）中国证监会关于准予国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）注册的批复文件
（二）《国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）基金合同》;
（三）《国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）招募说明书》;
（四）《国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）托管协议》;
（五）法律意见书;
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照;
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照;
（八）中国证监会要求的其他文件。

国泰基金管理有限公司
2018年12月5日

附件基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务
1、基金管理人的权利
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
（1）依法募集资金;
（2）自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
（4）销售基金份额;
（5）按照规定召集基金份额持有人大会;
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资人的利益;
（7）在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
（8）选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
（11）在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
（12）依据法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
（13）在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
（14）以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;
（16）在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则;
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、基金管理人的义务
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
（1）依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜;
（2）办理基金备案手续;
（3）自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
（7）依法接受基金托管人的监督;
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
（10）编制季度、半年度和年度基金报告;
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
（12）保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
（14）按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上,法律法规另有规定的从其规定;
（17）确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
（18）组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
（23）以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议;
（26）建立并保存基金份额持有人名册;
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
3、基金托管人的权利
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
（1）自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资人的利益;
（4）根据相关市场规则,为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户,为基金办理证券交易资金清算;
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会;
（6）在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
4、基金托管人的义务
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:
（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
（2）设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同