国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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：中国建设银行股份有限公司
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：2017年4月21日
公告日期：2017年4月18日

一、重要声明与提示

《国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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，国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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。

本基金托管人中国建设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中证国有企业改革指数证券投资基金（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2017年3月7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《国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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：501020）。
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：国企改，交易代码：501020
8、基金份额总额：截至2017年4月14日，本基金的份额总额为235,363,435.66份
9、基金份额净值：截至2017年4月14日，本基金的份额净值为1.0006元
10、本次上市交易的份额总额：截至2017年4月14日，本次上市交易的份额总额为164,805,206.00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：2017年4月21日
13、基金管理人：国泰基金管理有限公司
14、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
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[2016]292号
2、基金合同生效日：2017年3月29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：2017年3月10日至2017年3月24日
6、发售价格：1.00元人民币
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：浙江同花顺基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、深圳富济财富管理有限公司、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、上海联泰资产管理有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、北京乐融多源投资咨询有限公司、上海汇付金融服务有限公司、北京汇成基金销售有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中泰证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、中信期货有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司
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235,286,699.92元人民币，折合基金份额235,286,699.92份；认购资金在募集期间产生的银行利息共计76,735.74元人民币，折合基金份额76,735.74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2017年3月29日全额划入本基金在基金托管人中国建设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2017年3月29日验资完毕，2017年3月29日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2017年3月29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：2017年3月29日。
13、基金合同生效日的基金份额总额：235,363,435.66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[2017]99号
2、上市交易日期：2017年4月21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：国企改
5、交易代码：501020
6、本次上市交易份额：164,805,206.00份
7、基金资产净值的披露：每个工作日由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2017年4月21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2017年4月14日，本基金的场内基金份额持有人户数：1,192户，平均每户持有的场内基金份额：138,259.40份；本基金的场外基金份额持有人总户数：806户，平均每户持有的场外基金份额：87,541.23份。
（二）持有人结构
截至2017年4月14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20,196,396.00份，占本次上市交易基金份额比例为12.25%；个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为144,608,810.00份，占本次上市交易基金份额比例为87.75%。
（三）场内前十名基金份额持有人的情况：
截至2017年4月14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	都邦财产保险股份有限公司－传统保险产品	10,004,400.00	6.07%
2	华宝证券有限责任公司	7,999,360.00	4.85%
3	曹希同	2,000,080.00	1.21%
4	刘波	1,968,064.00	1.19%
5	赖淑君	1,299,058.00	0.79%
6	王颖	999,675.00	0.61%
7	潘明明	999,630.00	0.61%
8	蔡晓晓	999,630.00	0.61%
9	黄洁静	999,630.00	0.61%
10	管跃武	999,630.00	0.61%
11	诸葛忆军	999,630.00	0.61%
12	叶琴仙	999,630.00	0.61%
13	郦金花	999,630.00	0.61%
14	胡聪聪	999,630.00	0.61%
15	王爱美	999,630.00	0.61%
16	徐菊如	999,630.00	0.61%
17	梅筱仙	999,630.00	0.61%
18	马国维	999,630.00	0.61%
19	许水仙	999,630.00	0.61%
20	龚香芽	999,630.00	0.61%
21	杜晓红	999,630.00	0.61%
22	项丹娟	999,630.00	0.61%
23	邵玉芳	999,630.00	0.61%
24	谢元禄	999,630.00	0.61%
25	梁勇军	999,630.00	0.61%
26	曹旸	999,630.00	0.61%
27	林寿康	999,630.00	0.61%
28	林新村	999,630.00	0.61%
29	张国安	999,630.00	0.61%
30	王建锋	999,630.00	0.61%
31	丘卫婷	999,630.00	0.61%
32	周之庭	999,630.00	0.61%
合计		50,261,017.00	30.58%

（四）基金管理人的从业人员持有本基金的情况：
截至2017年4月14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	198.53	0.0001%

（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2017年4月14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：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：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：91310000631834917Y
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、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资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2017年3月31日，公司正式员工254人，其中55.5%（141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2017年3月31日，本基金管理人共管理88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、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鼎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、国泰保本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、国泰纳斯达克100指数证券投资基金（LOF）、国泰纳斯达克100指数人民币证券投资基金、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分级证券投资基金（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、国泰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰现金宝货币市场基金、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）、国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金。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
徐皓，硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师（国家一级），10年证券基金从业经历。曾任职于中国工商银行总行资产托管部，2010年5月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011年6月至2014年1月担任上证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及国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理助理，2012年3月至2014年1月兼任中小板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的基金经理助理。2014年1月至2015年8月兼任国泰中小板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的基金经理，2014年1月至2015年8月兼任中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2014年6月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2014年11月起兼任国泰纳斯达克100指数证券投资基金和纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2015年3月起兼任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2015年8月至2016年6月兼任国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（原中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金）的基金经理，2016年7月1日起兼任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（原国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金）的基金经理，2016年11月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017年3月起兼任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理。
（二）基金托管人
1、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：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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：田青
联系电话：(010)6759 5096
中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。
2015年末，本集团资产总额18.35万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款和垫款总额10.49万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67万亿元，增长5.96%。净利润2,289亿元，增长0.28%；营业收入6,052亿元，增长6.09%，其中，利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率15.39%，主要财务指标领先同业。
物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达1.45万个，综合营销团队2.15万个，综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%，较上年提升7.55个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。
转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张，消费交易额2.22万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销1,316亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元，增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。
2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并获家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。
中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。
2、主要人员情况
赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、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。
张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部，公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
3、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2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国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。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。
（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：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
经办注册会计师：许康玮、李一
联系人：李一

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
国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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
国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）2017年4月14日资产负债表（未经审计）如下：

国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）
2017年4月14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2017年4月14日
资产：	
银行存款	15,139,686.25
结算备付金	347,826.09
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	165,000,000.00
应收证券清算款	55,058,292.19
应收利息	53,735.97
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	235,599,540.50
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	51,597.64
应付托管费	15,479.29
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	22,014.32
其他负债	7,950.24
负债合计	97,041.49
所有者权益：	
实收基金	235,363,435.66
未分配利润	139,063.35
所有者权益合计	235,502,499.01
负债和所有者权益总计	235,599,540.50

注：报告截止日2017年4月14日，本基金份额净值：1.0006元，本基金份额总额：235,363,435.66份。

八、基金投资组合

截至2017年4月14日，国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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	165,000,000.00	70.03
	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	15,487,512.34	6.57
6	其他各项资产	55,112,028.16	23.39
7	合计	235,599,540.50	100.00

（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）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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	55,058,292.19
3	应收股利	
4	应收利息	53,735.97
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	55,112,028.16

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：本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
（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

国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）基金合同已于2017年3月29日正式生效，基金管理人于2017年3月30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《国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）注册的批复文件
（二）《国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
（三）《国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
（四）《国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（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
2017年4月18日

附件基金合同摘要
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构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）依照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、转融通证券出借；
（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