（上接B161版）

143	和耕传承基金销售有限公司	注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503 办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503 法定代表人：王旋 客服电话：4000-555-671 网址：www.hgccpb.com
144	腾安基金销售（深圳）有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦 法定代表人：刘明军 客服电话：95017 网址：tenganxinxi.com
145	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层 法定代表人：钱昊旻 客服电话：4008909998 网址：www.jnlc.com
146	北京百度百盈基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101 办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科大厦 法定代表人：张旭阳 客服电话：010-59922163 网址：www.baiyingfund.com

其中，浙商银行股份有限公司、昆仑银行股份有限公司、浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司只销售国泰金龙行业精选；兴业银行股份有限公司只销售国泰金龙债券（A类）和国泰金龙债券（C类）；民生证券股份有限公司和广发证券股份有限公司只销售国泰金龙行业精选和国泰金龙债券（A类）。

二、注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

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

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所

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

第四节 基金的名称

国泰金龙系列证券投资基金

第五节 基金的类型

契约性开放式

第六节 投资目标

（一）国泰金龙债券：

在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。

（二）国泰金龙行业混合

有效把握我国行业的发展趋势，精心选择具有良好行业背景的成长性企业，谋求基金资产的长期稳定增值。

第七节 投资范围

（一）国泰金龙债券：

本基金为开放式债券基金，投资范围为国内依法公开发行的各种固定收益类金融工具（包括资产支持证券和可分离转债等新的固定收益产品）和参与拟公开发行股票的申购及可转债转股后所持有的股票、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

（二）国泰金龙行业混合

本基金投资于国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。保持组合中股票投资比例不高于75%，债券的投资比例不低于20%，其余为现金。其中投资重点是预期具有良好发展态势的优势行业中的成长性上市公司，这部分投资比例将不低于本基金股票资产的80%。

第八节 投资策略

（一）国泰金龙债券

以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线策略等方法，实施积极的债券投资管理。在有效控制利率和信用风险的前提下，为投资者谋求稳定的低风险收益。

在投资策略上，将着重对中长期（3-5年）趋势的分析，防范和规避长期债券的利率风险。所考虑的长期因素有政策因素、国内外产业结构的变化以及利率的波动等。根据对长期趋势的预期来决定组合久期的总体变动范围，进行年度动态调整。根据周期性的经济因素决定短期内组合久期的变动范围。

可转换债券作为一种附带期权的债券品种，相应于股票而言，具有低风险低收益的特征。在承担相同风险的状况下，转债的收益较高。在可转债投资方面，本基金将积极参与一级市场的申购，投资转债二级市场时注重企业基本面的分析；短期投资上偏重转债的期权价值，中长期投资上以转债的期权价值和债券价值并重为策略。

（二）国泰金龙行业混合

本基金采取定量分析与定性分析相结合的方式，通过资产配置有效规避资本市场的系统性风险，通过行业精选，确定拟投资的优势行业及相应比例，通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

第九节 业绩比较基准

（一）国泰金龙债券

基金业绩比较基准=中证综合债指数收益率

（二）国泰金龙行业混合

本基金股票投资部分的业绩比较基准是上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均，债券投资部分的业绩比较基准是上证国债指数。

基金整体业绩比较基准=75%×[上证A股指数和深圳A股指数的总市值加权平均]+25%×[上证国债指数]。

根据本基金的投资策略、风险收益特征选择了本基金的业绩比较基准。

第十节 风险收益特征

（一）国泰金龙债券

属于收益稳定、风险较低的品种。

（二）国泰金龙行业混合

承担中等风险，获取相对超额回报。

第十一节 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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。

本投资组合报告所载数据截止2019年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

国泰金龙债券

（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	权益投资	5,629,734.96	4.14
	其中：股票	5,629,734.96	4.14
2	固定收益投资	121,191,579.60	89.13
	其中：债券	121,191,579.60	89.13
	资产支持证券	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	4,132,216.35	3.04
7	其他各项资产	5,011,007.56	3.69
8	合计	135,964,538.47	100.00

（二）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	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,629,734.96	4.19
J	金融业	-	-
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、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、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	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,629,734.96	4.19

（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	300059	东方财富	290,492	5,629,734.96	4.19

（四）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	7,097,160.00	5.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	36,726,500.00	27.31
	其中：政策性金融债	36,726,500.00	27.31
4	企业债券	61,810,602.10	45.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	15,557,317.50	11.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,191,579.60	90.13

（五）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	180406	18农发06	200,000	21,190,000.00	15.76
2	136093	15华信债	400,000	11,456,000.00	8.52
3	180313	18进出13	100,000	10,139,000.00	7.54
4	136459	16上港02	100,000	9,991,000.00	7.43
5	136168	16建发01	100,000	9,947,000.00	7.40

（六）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。

（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

本基金本报告期末未持有贵金属。

（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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

（十一）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（除“华信国际集团”违规外）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。

根据2018年6月19日上海证券交易所出具《监管警示函》（上证监（2018）9号），上海华信国际集团有限公司未在规定时间之前披露2017年年度报告，违反了《上海证券交易所公司债券上市规则》第1.5条、第3.2.2条的相关规定。现对公司予以书面警示，并责令公司拟积极推进2017年年度报告编制工作并尽快完成披露。

根据2018年5月24日上海证监局发布《关于对上海华信国际集团有限公司采取责令改正措施的决定。根据行政监管措施(沪证监决〔2018〕36号)信息显示，2018年4月27日，上海华信国际集团有限公司发布《关于预计无法按期披露2017年年度报告的风险提示公告》称，因公司面临重大不确定性事项，预计无法按照原定时间披露2017年年度报告。截至5月24日，仍未披露2017年年度报告。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第113号)第四十二条、四十三条的规定。按照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条、第六十五条的规定，现要求公司高度重视上述问题，切实整改，按规定履行信息披露义务。

根据2018年4月27日安徽监管局出具的《行政监管措施决定书——关于对上海华信国际集团有限公司采取警示函措施的决定》（〔2018〕6号）和《行政监管措施决定书--关于对安徽华信国际控股股份有限公司采取警示函措施的决定》（〔2018〕7号）公司违反了《上市公司信息披露管理办法》第四十六条规定和第三十条规定。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定，安徽监管局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，本基金管理人将继续对该公司进行跟踪。

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	3,446.79
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,324,527.92
5	应收申购款	746,542.85
6	其他应收款	436,490.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,011,007.56

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	113013	国君转债	3,729,915.00	2.77
2	113516	吴银转债	2,474,800.00	1.84
3	128026	众兴转债	192,099.60	0.14

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。

国泰金龙行业混合

（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	权益投资	1,660,908,248.08	74.87
	其中：股票	1,660,908,248.08	74.87
2	固定收益投资	506,631,500.00	22.84
	其中：债券	506,631,500.00	22.84
	资产支持证券	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	37,873,782.31	1.71
7	其他各项资产	12,944,258.67	0.58
8	合计	2,218,357,789.06	100.00

（二）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	采矿业	-	-
C	制造业	1,142,090,414.28	56.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	453,335,513.98	22.26
J	金融业	21,585,089.82	1.06
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、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,897,230.00	2.16
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,660,908,248.08	81.56

（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	000661	长春高新	539,891	171,140,048.09	8.40
2	002475	立讯精密	5,520,611	136,911,152.80	6.72
3	600271	航天信息	3,894,035	108,760,397.55	5.34
4	600845	宝信软件	3,306,934	108,599,712.56	5.33
5	600570	恒生电子	1,178,097	103,154,173.32	5.07
6	002916	深南电路	799,587	99,476,618.67	4.88
7	603228	景旺电子	1,517,773	98,807,022.30	4.85
8	300451	创业慧康	3,794,100	95,231,910.00	4.68
9	000858	五粮液	862,484	81,935,980.00	4.02
10	000063	中兴通讯	2,674,900	78,107,080.00	3.84

（四）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	49,889,000.00	2.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	456,742,500.00	22.43
	其中：政策性金融债	456,742,500.00	22.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	506,631,500.00	24.88

（五）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	160215	16国开15	1,200,000	120,108,000.00	5.90
2	140219	14国开19	1,100,000	110,869,000.00	5.44
3	190201	19国开01	700,000	70,000,000.00	3.44
4	150303	15进出03	500,000	50,520,000.00	2.48
5	160415	16农发15	300,000	30,009,000.00	1.47

（六）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。

（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

本基金本报告期末未持有贵金属。

（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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

（十一）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（除“恒生电子”公告其违规情况外），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。

杭州恒生电子股份有限公司于2018年3月10日和2018年7月21日分别公告控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司涉及行政处罚事项进展公告。

2018年3月8日，恒生网络收到北京市西城区人民法院《执行通知书》、《报告财产令》、《执行裁定书》主要内容分别如下：恒生网络与证监会一案裁决已经生效，恒生网络未在规定时间内履行义务，证监会向西城法院申请强制执行，依法冻结被执行人财产。

2018年7月19日，恒生网络收到西城法院出具的《失信决定书》以及《限制消费令》（两个文件的签署时间为2018年6月12日）。主要内容分别如下：将杭州恒生网络技术服务有限公司纳入失信被执行人名单。根据规定，恒生网络及其法定代表人宗梅苓被下达了限制消费令。

本基金管理人此前投资恒生电子股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。该情况发生后，本基金管理人就恒生电子处罚事项进行了及时分析和研究，认为恒生电子在积极配合监管机构处理处罚事项后续事宜，事件对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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	1,494,784.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,440,783.94
5	应收申购款	2,008,690.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,944,258.67

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

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 基金的业绩

基金业绩截止日为2018年12月31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系列基金的招募说明书。

一、国泰金龙债券A类

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）
2003年12月5日至2003年12月31日	0.50%	0.10%	1.09%	0.09%	-0.59%	0.01%
2004年度	-1.07%	0.27%	-1.95%	0.13%	0.88%	0.14%
2005年度	5.70%	0.19%	12.24%	0.10%	-6.54%	0.09%
2006年度	11.40%	0.25%	1.68%	0.05%	9.72%	0.20%
2007年度	7.93%	0.10%	-0.98%	0.05%	8.91%	0.05%
2008年度	11.61%	0.17%	9.69%	0.10%	1.92%	0.07%
2009年度	2.41%	0.24%	0.27%	0.06%	2.14%	0.18%
2010年度	8.48%	0.31%	2.00%	0.07%	6.48%	0.24%
2011年度	-6.65%	0.36%	3.79%	0.06%	-10.44%	0.30%
2012年度	9.33%	0.07%	4.03%	0.04%	5.30%	0.03%
2013年度	2.93%	0.10%	1.78%	0.05%	1.15%	0.05%
2014年度	12.48%	0.16%	9.41%	0.16%	3.07%	0.00%
2015年度	10.27%	0.13%	6.15%	0.07%	4.12%	0.06%
2016年度	2.94%	0.07%	2.12%	0.08%	0.82%	-0.01%
2017年度	1.56%	0.07%	0.28%	0.05%	1.28%	0.02%
2018年度	1.39%	0.17%	8.12%	0.06%	-6.73%	0.11%
自2003年12月5日至2018年12月31日	116.37%	0.20%	77.58%	0.08%	38.79%	0.12%

二、国泰金龙债券C类

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）
2003年12月5日至2003年12月31日	0.50%	0.10%	1.09%	0.09%	-0.59%	0.01%
2004年度	-1.07%	0.27%	-1.95%	0.13%	0.88%	0.14%
2005年度	5.70%	0.19%	12.24%	0.10%	-6.54%	0.09%
2006年度	11.40%	0.25%	1.68%	0.05%	9.72%	0.20%
2007年度	7.93%	0.10%	-0.98%	0.05%	8.91%	0.05%
2008年度	11.41%	0.17%	9.69%	0.10%	1.72%	0.07%
2009年度	1.93%	0.24%	0.27%	0.06%	1.66%	0.18%
2010年度	8.00%	0.31%	2.00%	0.07%	6.00%	0.24%
2011年度	-7.05%	0.36%	3.79%	0.06%	-10.84%	0.30%
2012年度	9.38%	0.07%	4.03%	0.04%	5.35%	0.03%
2013年度	2.44%	0.10%	1.78%	0.05%	0.66%	0.05%
2014年度	12.29%	0.16%	9.41%	0.16%	2.88%	0.00%
2015年度	9.86%	0.13%	6.15%	0.07%	3.71%	0.06%
2016年度	2.67%	0.07%	2.12%	0.08%	0.55%	-0.01%
2017年度	1.19%	0.06%	0.28%	0.05%	0.91%	0.01%
2018年度	1.48%	0.18%	8.12%	0.06%	-6.64%	0.12%
自2003年12月5日至2018年12月31日	109.90%	0.20%	77.58%	0.08%	32.32%	0.12%

注：经中国证监会批准，国泰金龙债券于2008年6月3日刊登公告，自2008年6月5日起增加收取销售服务费的C类收费模式。

三、国泰金龙行业混合

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）
2003年12月5日至2003年12月31日	0.80%	0.25%	3.10%	0.83%	-2.30%	-0.58%
2004年度	-0.47%	0.88%	-12.48%	1.00%	12.01%	-0.12%
2005年度	5.75%	0.92%	-2.09%	1.02%	7.84%	-0.10%
2006年度	112.20%	1.00%	101.68%	1.07%	10.52%	-0.07%
2007年度	139.67%	1.90%	72.23%	1.65%	67.44%	0.25%
2008年度	-50.06%	2.18%	-53.30%	2.13%	3.24%	0.05%
2009年度	72.69%	1.36%	54.75%	1.42%	17.94%	-0.06%
2010年度	10.00%	1.19%	-11.76%	1.06%	21.76%	0.13%
2011年度	-18.92%	0.97%	-16.25%	0.86%	-2.67%	0.11%
2012年度	-12.18%	1.10%	3.17%	0.81%	-15.35%	0.29%
2013年度	12.41%	1.24%	-3.98%	0.84%	16.39%	0.40%
2014年度	8.59%	1.15%	38.54%	0.81%	-29.95%	0.34%
2015年度	81.47%	2.65%	12.91%	1.83%	68.56%	0.82%
2016年度	3.34%	1.64%	-8.71%	1.14%	12.05%	0.50%
2017年度	21.08%	0.93%	3.79%	0.44%	17.29%	0.49%
2018年度	-37.29%	1.31%	-18.21%	0.94%	-19.08%	0.37%
自2003年12月5日至2018年12月31日	462.84%	1.45%	95.75%	1.22%	367.09%	0.23%

第十三节 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（一）与基金运作有关的费用包括：

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、销售服务费；

4、投资交易费用；

5、基金信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、与基金相关的会计师费和律师费；

8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金运作费用计提原则、计提方法、计提标准和支付方式

1、计提原则：本系列基金旗下各基金发生的各项费用由各基金资产分别承担。各基金共同发生的费用，按相关协议规定或按各基金的基金资产净值占本系列基金总的资产净值的比例分摊。

2、基金管理人的基金管理费

(1) 基金管理人的基金管理费按各基金资产净值的一定年费率计提，具体为：

1) 国泰金龙债券：0.6%；

基金合同生效日起半年后（含半年），经基金托管人核对，如当日本基金的基金份额累计资产净值低于1.00元时，基金管理人将从下一日起暂停收取管理费，在当日累计基金份额资产净值低于基金份额面值期间，如遇法定节假日，同样暂停收取基金管理费。直至本基金累计资产净值高于1.00元（含）后，基金管理人恢复收取基金管理费。

2) 国泰金龙行业混合：1.5%。

(2) 在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值乘以该基金的年费率计提。计算方法如下：

H=E×R÷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

R为基金管理费年费率

(3) 基金管理费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从各基金资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。

3、基金托管人的基金托管费

(1) 基金托管人的基金托管费按各基金基金资产净值的一定年费率计提，具体为：

国泰金龙债券：0.2%；

国泰金龙行业混合：0.25%。

(2) 在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值乘以年费率计提。计算方法如下：

H=E×R÷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

R为基金托管费年费率

(3) 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5个工作日内从各基金资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。

4、销售服务费

国泰金龙债券A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额计提的销售服务费年费率最高不超过0.3%，基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整对C类各级基金份额计提的销售服务费率。销售服务费将专门用于国泰金龙债券C类基金份额的销售与C类基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.3%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。

5、本条第（一）款第4至第8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期各基金费用。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费

国泰金龙债券（A类）：

申购金额	申购费率
50万元以下	0.8%
50万元（含）-200万	0.6%
200万元（含）-500万元	0.3%
500万元（含）以上	500元（单笔）

国泰金龙债券（C类）：申购费率为0

国泰金龙行业混合：

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户范围包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金的养老金客户申购费率如下：

申购金额	申购费率
50万元以下	0.48%
50万元（含）-200万	0.24%
200万元（含）-500万元	0.12%
500万元（含）以上	按笔收取，1000元/笔

除养老金客户外的其他投资人申购本基金的申购费率如下：

申购金额	申购费率
50万元以下	1.2%
50万元（含）-200万	0.8%
200万元（含）-500万元	0.6%
500万元（含）以上	按笔收取，1000元/笔

2、赎回费率

赎回费由赎回人承担，在扣除注册登记费和其他必要的手续费后，如有余额，剩余部分归入基金资产。从2004年7月1日起，依照《证券投资基金销售管理办法》，本系列基金各基金赎回费的75%作为手续费扣除，余额25%归入基金资产。本系列基金各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1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

国泰金龙债券（A类）和国泰金龙行业混合赎回费率相同，具体赎回费率（按持有时间D）：

赎回申请份额持有时间（D）	赎回费率
D<7日	1.5%
7日≤D<1年	0.2%
1年≤D<2年	0.1%
D≥2年	0

国泰金龙债券（C类）赎回费率（按持有时间D）：

赎回申请份额持有时间（D）	赎回费率
D<7日	1.5%
7日≤D<30天	0.1%
D≥30天	0

注：1年=365天，2年=730天，以此类推。

3、销售服务费

销售服务费年利率为0.3%（每日从C类基金资产中计提）

4、转换费率

(1) 国泰金龙系列基金内转换费率

基金份额持有人持有的国泰金龙行业混合转换为国泰金龙债券时，免收基金转换费。基金份额持有人持有的国泰金龙债券转换为国泰金龙行业混合时，持有期超过90日（含）的，免收基金转换费；持有期小于90日，基金份额持有人需支付基金转换金额0.3%的基金转换费。国泰金龙债券A类和C类之间不能转换。

(2) 与其他基金间转换费率

A、基金转换费用由转出基金的赎回费和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取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份额持有人承担。

a、转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时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。

b、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的，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。

B、计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

5、申购与赎回申请的款项支付和使用方式

申购采用全额交款方式，投资者申购申请被销售机构受理后，销售机构负责将投资者申购款项全额扣减。本基金的申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等费用，不列入基金资产。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项自T日起7个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及本招募说明书有关规定处理。本系列基金各基金的赎回费在扣除注册登记费和其他必要的手续费后，剩余部分全部归入基金资产，归入基金资产的赎回费比例不得低于赎回费总额的25%。

三、不得列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管