国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第二号）

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2015年10月9日证监许可【2015】2252号文注册募集，本基金的基金合同于2015年12月3日正式生效。

基金管理人保证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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

本基金投资于境外公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF）），基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有的基金份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：本基金特有风险（投资标的风险、主动管理风险、境外证券投资限制引致的风险）、境外投资风险（境外市场风险、汇率风险、政治风险、政府管制风险、税务风险、法律风险）、开放式基金风险（利率风险、流动性风险、信用风险、操作风险、会计核算风险、交易结算风险、技术系统运行风险、通讯风险、巨额赎回风险、不可抗力风险）等。

本基金主要投资于境外绝对收益型基金，属于证券投资基金中的预期风险和预期收益中等的品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行负担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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2018年12月3日，投资组合报告为2018年3季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。

一、基金名称

国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金

二、基金类型和存续期限

1、基金类型：基金中基金

2、基金运作方式：契约型、开放式

3、基金的存续期间：不定期

三、投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。

四、投资范围

本基金的投资范围为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的境外公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））、银行存款、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于境外公募基金资产的比例不低于基金资产的80%，投资于基金合同界定的绝对收益型基金占非现金基金资产的比例不低于80%。基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%（其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

五、投资策略

本基金通过定量和定性相结合的方式优选境外绝对收益型公募基金（以下简称“标的基金”），按照资产管理人、绝对收益目标的实现策略等角度适度分散本基金的配置，以期实现基金资产的稳健增值。

1、境外绝对收益型公募基金的界定

本基金管理人对境外绝对收益型公募基金的界定，主要依据标的基金的名称和投资目标，即1）基金名称中含绝对收益（absolute return/total return）字样；或2）以追求绝对收益为主要投资目标的基金，例如以追求在不同市场环境下获得长期正回报为投资目标的基金，以追求获得资产增值的同时实现风险最小化为投资目标的基金等。其实现绝对收益目标的策略包括但不限于：

① 多资产配置策略（Multi-Asset Allocation）

根据对市场环境的深入研究，通过在各资产类别中灵活配置，以期实现稳健的绝对收益。

② 全球配置策略（Global Allocation）

通过在全球各地区进行资产配置分散投资，以期获得稳健的风险回报率。

③ 市场中性策略（Market Neutral）

通过同时构建多头和空头头寸以对冲市场风险，以期在任何市场环境下均能获得稳定收益。

④ 长短仓对冲策略（Long/Short）

通过同时构建多头和空头来对冲一定的市场风险，但两者的比例相对比较灵活，以期实现相对稳健的投资收益。

⑤ 全球宏观策略（Global Macro）

利用宏观经济的基本原理来识别金融资产价格的失衡错配现象，在世界范围的外汇、股票、债券、期货、期权以及其他金融产品上进行资产配置，以期获得稳健的投资收益。

⑥ 事件驱动策略（Event driven）

通过分析重大事件发生前后对投资的标的的影响不同而进行投资，重大事件包括发生分拆、收购、合并、破产重组、财务重组、资产重组等。

⑦ 套利策略（Arbitrage）

通过对各种金融工具的研究，利用金融工具之间的价格不合理进行相应的套利，包括可转债套利、固定收益套利、期货套利、ETF套利等。

⑧ 多重策略（Multi-Strategy）

通过对上述多种策略的组合，平滑单一策略的风险，以期获得更稳健的投资收益。

随着新金融工具的增加，绝对收益目标实现策略的不断丰富、成熟，本基金管理人可相应丰富、增加标的基金。

2、基金投资策略

本基金通过定量分析策略和定性分析策略相结合的方式优选标的基金，通过分析各标的基金的费率水平、历史收益、夏普比率、历史回撤、波动率等量化指标，挑选出合适的基金组成标的基金池。再对标的基金池中的基金进行筛选和配置，通过深入了解标的基金的具体策略及投资领域，并对资产管理公司的历史、组织构架、以及标的基金投资经理的优势及稳定性进行分析，将资产分散投资于不同基金管理人、投资策略的基金，构建基金投资组合。

1）定量分析策略

本基金对标的基金的费用、收益和风险进行定量分析，选择成立时间较长或有较长的可回溯历史业绩的标的基金。主要关注以下几个定量指标：

①费率水平（Expense Ratio）

考察基金的管理费（Management Fee）、申购费（Front Load/Initial Charge等）、赎回费（Redemption Fee/Exit Charge等）、业绩提成（Performance Fee）和销售费用（Distribution Fee）等，选择综合费率较低的标的基金。

②收益分析（Performance Analysis）

分析基金在不同市场环境下的历史收益表现，包括历史收益（Return）和夏普比率（Sharp Ratio）等，分析基金的收益表现是否和基金的投资目标、投资策略相符合。

③风险分析（Risk Analysis）

分析基金的历史回撤（Drawdown）和波动率（standard deviation），选择总体投资风险水平适当可控的基金。

2）定性分析策略

本基金主要从资产管理公司和投资经理两个角度对标的基金进行定性分析，主要关注以下定性指标：

①资产管理公司（Asset Management Company）

考察资产管理公司的历史变迁（History）、组织构架（Organization）、产品优势（Advantages）等。选择成立时间较长、组织构架较为稳定、资产规模较大、在行业内有一定的影响力的资产管理公司。

②投资经理（Portfolio Manager/Team）

考察投资经理的投资理念（Investment Philosophy）和投资优势、稳定性、从业经验、所管理其他基金的状况等。选择投资经理投资理念和投资优势较为鸿晰，稳定性较高，从业经验丰富的投资经理。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为美国3个期国债到期收益率+3%。

本基金定位为追求绝对收益回报的基金产品，以美国3年期国债到期收益率上浮3%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整，调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒介上予以公告。

七、风险收益特征

本基金主要投资于境外绝对收益型基金，属于证券投资基金中的预期风险和预期收益中等的品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

八、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23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2018年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

九、基金的业绩

基金业绩截止日为2018年6月30日。

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。

国泰全球绝对收益人民币份额：

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
2015年12月3日至2015年12月31日	1.30%	0.13%	0.34%	0.92%	0.96%	-0.79%
2016年度	0.00%	0.29%	4.00%	1.00%	-4.00%	-0.71%
2017年度	-3.46%	0.26%	4.57%	0.67%	-8.03%	-0.41%
2018年上半年	1.02%	0.29%	2.70%	0.65%	-1.68%	-0.36%
2015年12月3日至2018年6月30日	-1.20%	0.27%	11.61%	0.82%	-12.81%	-0.55%

国泰全球绝对收益美元份额：

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
2015年12月3日至2015年12月31日	-0.20%	0.06%	0.34%	0.92%	-0.54%	-0.86%
2016年度	-6.41%	0.19%	4.00%	1.00%	-10.41%	-0.81%
2017年度	2.57%	0.12%	4.57%	0.67%	-2.00%	-0.55%
2018年上半年	-0.31%	0.17%	2.70%	0.65%	-3.01%	-0.48%
2015年12月3日至2018年6月30日	-4.50%	0.16%	11.61%	0.82%	-16.11%	-0.66%

2015年12月3日为基金合同生效日。

十、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

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

成立时间：1998 年3 月5 日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：（021）31089000，4008888688

股权结构：

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2018年12月3日，本基金管理人共管理96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）（由金鹰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证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰文体商品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、国泰信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、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、国泰国证医药卫生行业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（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴盛灵活配置混合型证券投资基金、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、国泰鑫森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、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、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、国泰利是定货币市场基金、国泰金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（ODII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰沪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、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祥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。

三、主要人员情况

1、董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982年1月至1992年10月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992年11月至1998年2月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理。1998年3月至2015年10月在国泰基金管理有限公司工作，其中1998年3月至1999年10月任总经理，1999年10月至2015年8月任董事长。2015年1月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任纪委书记，2015年3月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任董事长，2016年8月至11月，在建投投资有限责任公司、建投传媒华交公司任监事长、纪委书记。2016年11月起任公司党委书记，2017年3月起任公司董事长、法定代表人。

方志斌，董事，硕士研究生。2005年7月至2008年7月，任职宝钢国际经营财务部。2008年7月至2010年2月，任职金茂集团财务总部。2010年3月至今，在中国建银投资有限责任公司工作，历任长期股权投资部助理业务经理、业务经理，战略发展部业务经理、处长。2014年4月至2015年11月，任建投华科投资有限责任公司董事。2014年2月至2017年11月，任中国投资咨询有限责任公司董事。2017年12月起任公司董事。

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，战略发展部处长、现任战略发展部总经理助理。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年至1994年任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994年至1996年任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996年至1998年任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998年至2017年任忠利亚洲中国地区总经理；2002年至今任中意人寿保险有限公司董事；2007年至今任中意财产保险有限公司董事；2007年至2017年任中意财产保险有限公司总经理；2013年至今任中意资产管理有限公司董事；2017年至今任忠利集团大中华区股东代表。2010年6月起任公司董事。

吕胜，董事，硕士。1991年7月至1994年6月，在水利水电规划设计总院任科员。1994年6月至1997年1月，在电力工业部经济调节司任副主任科员、主任科员。1997年1月至2003年1月，在国家电力公司财务与资产管理部任一级职员、副处长。2003年1月至2008年1月，在国家电网公司建设运行部任处长。2008年1月至2008年8月，在国网信息通信有限公司任总会计师、党组成员。2008年8月至2017年12月在英大泰和财产保险股份有限公司任总会计师、党组成员。2017年12月至今，在中国电力财务有限公司任总会计师、党委委员。2018年3月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，22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月在中国建银投资有限责任公司工作，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，先后任助教、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。

常瑞明，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起在工商银行工作，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。

黄晓衡，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1975年7月至1991年6月，在中国建设银行江苏省分行工作，先后任职于计划处、信贷处、国际业务部，历任副处长、处长。1991年6月至1993年9月，任中国建设银行伦敦代表处首席代表。1993年9月至1994年7月，任中国建设银行纽约代表处首席代表。1994年7月至1999年3月，在中国建设银行总行工作，历任国际部副总经理、资金计划部总经理、会计部总经理。1999年3月至2010年1月，在中国国际金融有限公司工作，历任财务总监、公司管委会成员、顾问。2010年4月至2012年3月，任汉石投资管理有限公司（香港）董事总经理。2013年8月至2016年1月，任中金基金管理有限公司独立董事。2017年3月起任公司独立董事。

吴群，独立董事，博士研究生，高级会计师。1986年6月至1999年1月在中国财政研究院研究生部会计教研室工作，历任讲师、副研究员、副主任、主任。1991年起兼任中国财政研究院研究生部（财政部财政科研所研究生部）硕士生导师。1999年1月至2003年6月在沪江德勤北京分所工作，历任技术部/企业风险管理部高级经理、总监，管理咨询部总监。2003年6月至2005年11月，在中国电子产业工程有限公司工作，担任财务部总经理。2014年9月至2016年7月兼任中国上市公司协会军工委员会副会长，2016年8月起兼任中国上市公司协会军工委员会顾问。2005年11月至2016年7月在中国电子信息产业集团有限公司工作，历任审计部副主任、资产部副主任（主持工作）、主任。2012年3月至2016年7月，担任中国电子信息产业集团有限公司总经济师。2003年1月至2016年11月，在中国电子信息产业集团有限公司所投资的境内外多个公司担任董事、监事。2017年5月起兼任首钢科技（北京）有限公司独立董事。2017年10月起任公司独立董事。

2、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2017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。2016年12月1日起任Generali Investments Asia Limited执行董事。2014年12月起任公司监事。

刘锡忠，监事，研究生。1989年2月至1995年5月，中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1996年6月至2005年6月，在华北电力集团财务有限公司工作，历任部门经理、副总经理。2005年7月起在中国电力财务有限公司工作，历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任，现任风险管理部主任。2017年3月起任公司监事。

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月至2018年3月任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2009年5月至2018年3月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月至2018年3月兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。2017年7月起任权益投资总监。2015年8月起任公司职工监事。

倪鎏，监事，硕士研究生。1998年7月至2001年3月，任新晨信息技术有限责任公司项目经理。2001年3月加入国泰基金管理有限公司，历任信息技术部总监、运营管理部总监，现任公司总经理助理。2017年2月起任公司职工监事。

宋凯，监事，大学本科。2008年9月至2012年10月，任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012年12月加入国泰基金管理有限公司，历任审计部总监助理、纪检监察室副主任，现任审计部总监、风险管理部总监。2017年3月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

陈勇胜，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。

李辉，大学本科，18年金融从业经历。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月任职于中资人寿保险有限公司，2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司，2006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，2015年8月至2017年2月任公司总经理助理，2017年2月起担任公司副总经理。

封雪梅，硕士研究生，20年金融从业经历，曾就职于中国工商银行北京分行营业部、大成基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司，2015年1月至2018年7月在国寿安保基金管理有限公司工作，任总经理助理，2018年7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，19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，担任公司督察长。

4、本基金基金经理

（1）现任基金经理

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（ODII）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。

（2）历任基金经理

本基金自合同生效起至今一直由吴向军担任本基金的基金经理。

5、本基金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，审议开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：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

吴晨：固收投资总监、绝对收益投资（事业）部总监

邓时锋：权益投资总监、权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：海外投资总监、国际业务部总监

胡松：养老金投资总监、养老金及专户投资（事业）部总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

十一、基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费（其中包含境外托管人的托管费）；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金进行外汇兑换交易的相关费用；

9、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（合称“税收”）；

10、基金的开户费用、账户维护费用；

11、因更换境外托管人（由于基金托管人的原因更换境外托管人除外）而进行的资产转移所产生的费用；

12、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费（其中包含境外托管人的托管费）

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.28%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.28%÷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

基金托管费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3－12项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

基金管理人和基金托管人可根据基金运作情况调低基金管理费率和基金托管费率，无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规和境外市场所在地的相关法律法规执行。

十二、基金托管人

一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰千玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾壹万贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外兰奥机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至2018年9月30日，中国银行已托管679只证券投资基金，其中境内基金642只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

十三、境外托管人

一、中银香港概况

名称：[中国银行(香港)有限公司]

住所：[香港中环花园道1号中银大厦]

办公地址：[香港中环花园道1号中银大厦]

法定代表人：[高迎欣总裁]

成立时间：[1964年10月16日]

组织形式：[股份有限公司]

存续期间：[持续经营]

联系人：[黄晚仪副总经理托管业务主管]

联系电话：[852-3982-6753]

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）早于1964年成立，并在2001年10月1日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司（“中银香港(控股)”）-则于2001年2日在香港注册成立，并于2002年7月25日开始在香港联合交易所主板上市，2002年12月2日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至2017年末，中银香港(控股)有限公司的总资产超过23,399亿港元，资本总额超过2,417.4亿港元，总资本比率为21.76%。中银香港(控股)的财务实力及双A级信用评级，可媲美不少大型全球托管银行，其最新信评如下(截至2017年12月31日):

	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
展望	稳定	稳定	稳定

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础，且连续四年成为“亚太及香港区最稳健银行”（银行间杂志），并三度获得“香港区最佳银行”（银行家杂志）等。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一。目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类QDII及其各类产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于2006年被委任为国内首只银行类QDII产品之境外托管行，于2007年被委任为国内首只券商类QDII集成计划之境外托管行，另于2010年服务市场首宗的跨境QDII-ETF等；至于服务境外机构客户方面亦成就显著：

在“债券通”的领域=）自开通至今，持续维持最大的市场份额

在人民币合格境外机构投资者(RQFII)的领域=）成为此类人民币产品