国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

（2013年第一号）

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
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2011年7月14日证监许可【2011】1094号文核准募集。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为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，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中出现的风险主要分为三类，一是境外投资产品风险，包括海外市场风险、汇率风险、法律和政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、流动性风险、信用风险、操作或技术风险、会计核算风险、税务风险等；三是本基金的特有风险，包括基金中基金产品特有风险、所投资ETF基金的对手方风险、基金资产整体波动率无法控制在目标水平的风险、投资对象资产数量与资产规模有限引致的特殊风险、上市交易及外汇额度限制引致的特殊风险。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。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并不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人建议投资人根据自身的风险偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2013年5月3日，投资组合报告为2013年1季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日。

一、基金名称

国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）

二、基金类型

1、基金的类别：基金中基金（FOF）

2、基金的运作方式：上市契约型开放式

三、投资目标

本基金通过在大宗商品各品种间的分散配置以及在商品类、固定收益类资产间的动态配置，力求在有效控制基金资产整体波动性的前提下分享大宗商品市场增长的收益。

四、投资理念

利用各商品品种价格走势之间的不一致性，通过分散投资降低风险，并根据商品类资产的历史波动性动态调整固定收益类资产的配置比例，以求将基金资产的整体波动性控制在特定水平以内，在有效控制投资风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

五、投资范围

本基金的投资范围包括法律法规允许的、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公募基金（包括ETF）、债券、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%（若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取消后的规定执行）；投资于基金（含ETF）的资产不低于基金资产的60%，其中不低于80%投资于商品类基金。

商品类基金包括跟踪综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的ETF；业绩比较基准90%以上基于综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的共同基金。

当法律法规或监管机构允许基金投资于商品期货或其它品种时，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更上述比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

六、投资策略

本基金的投资策略为首先确定基准配置比例，包括商品类、固定收益类资产间的大类资产配置比例和各商品品种间的品种配置比例，然后以基准配置比例为参照构建投资组合，最后根据市场波动性调整固定收益类资产比例，以求将投资组合的整体风险控制在特定的水平以内。

1、资产配置策略

本基金的资产配置策略在于确定基准配置比例，包括大类资产配置比例和各商品品种配置比例。

（1）各商品品种间的配置比例

国际上的大宗商品品种繁多，本基金拟投资的商品品种主要可分为以下四大类别：

能源类：包括原油、天然气、燃料油、汽油、瓦斯油等等；

工业金属类：包括铝、锌、铜、镍、铅等等；

贵重金属类：包括黄金、白银等等；

农产品类：玉米、小麦、大豆、白糖、棉花、咖啡、可可、牲畜等等。

在商品品种配置比例的选择上，将以分散配置、均衡配置为出发点，综合考虑各商品品种历史表现以及商品市场基本面等各方面因素，力求构建一个相对稳定的商品品种配置比例基准，在全面反映大宗商品走势的同时，尽量降低商品类资产整体的波动性。

具体而言，在商品品种配置比例方面考虑以下因素：

各商品品种各自价格的历史表现和历史波动性

各商品品种价格间历史相关性

各商品品种的全球产量、交易量

各商品品种的可投资性（即是否可通过商品类基金进行投资）

（2）大类资产配置比例

本基金的大类资产类别包括商品类资产和固定收益类资产，大类资产配置以严格控制风险为目标，力求将资产的整体年化波动率控制在不超过15%的水平。

具体而言，可分为以下步骤：

对商品资产部分近期的历史实际波动率进行计算并年化；

如商品资产部分历史实际波动率小于15%，则将固定收益类资产比例设置为零。

如商品资产部分历史实际波动率大于15%，则提高固定收益类资产比例，以求将资产的整体历史实际波动率降至15%以内。

本基金管理人与德意志银行合作，对以上资产配置方法进行了固化和完善，制定了基准配置组合和定期调整方法。为对组合的表现进行持续跟踪，由德意志银行以指数的形式进行发布了国泰大宗商品配置指数，并以此指数作为本基金的业绩比较基准。关于指数的更多细节参见（六）业绩比较基准。

2、商品类基金投资策略

本基金的商品类基金投资将主要参照基准配置比例中的商品品种配置比例进行配置，具体方法如下：

（1）根据基准配置比例中商品部分各商品品种的成分和权重，在商品基金中抽样选择基础资产商品品种与基准配置比例中商品部分相同或接近的基金，组成初选基金池。

（2）通过量化模型进行最优化分析，从各选基金池中选取基金构建组合。最优化目标为组合与基准配置比例中商品部分的日收益率序列的相关系数最大化，并据此求解组合中各基金的权重。

（3）当基准配置比例定期或不定期进行调整时，通过量化模型重新计算，对组合进行相应调整。

（4）由基金管理人基于对宏观经济和各商品品种基本面的判断，综合评估历史波动率是否准确反映了各商品品种的市场风险，并对组合进行适度调整。

3、固定收益类资产投资策略

本基金投资的固定收益类资产指现金、银行存款、债券、债券型公募基金（含债券型ETF）、货币市场基金（含货币型ETF）。

在确定了商品类基金的组合后，本基金将参照基准配置比例中固定收益类资产的配置比例进行配置，并根据所构建商品类基金组合的实际历史波动率加以调整，力求将基金资产的整体波动率控制在年化15%以内。

由于本基金固定收益类资产投资的目的是优化流动性管理和分散投资风险，因此在投资策略会侧重于短久期、高流动性、高信用等级的品种进行投资。

4、衍生品投资策略

本基金投资衍生品主要采取组合避险策略和有效管理策略。衍生品的投资比例根据法律法规、本基金合同的规定，在充分考虑投资需要后予以确定。

七、投资决策机制

本基的投资决策实行公司投资决策委员会下属专业投决会——境外投资专业决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作，基金投资的重大事项需向境外投资专业决策委员会报告。

八、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

国泰大宗商品配置指数（企收益指数）

国泰大宗商品配置指数（Guotai Commodity Allocation Index）是国泰基金和德意志银行联合开发的综合性商品指数，涵盖能源、贵重金属、工业金属、农产品等多个商品类别，以反映大宗商品市场的整体走势。指数编制中借鉴了国际上较为流行的风险控制指数技术，以控制指数波动率为目标来进行资产配置。通过在指数中加入现金部分并动态调整，力求将指数的整体年化波动率控制在不超过年化15%的水平，以达到控制风险的目的。

国泰大宗商品配置指数以2000年1月4日为基期，基点为100点。投资者可以通过德意志银行的指数发布网站DBIQ（http://index.db.com）查询指数的情况，也可以通过彭博资讯查询指数情况，彭博代码为DBCMCNU1。同时，为便于投资者查询，国泰基金也在公司网站（http://www.gtfund.com）上公布指数的情况，提供指数介绍、每日走势、商品成分和权重等相关信息。

如果国泰大宗商品配置指数被停止编制及发布，或国泰大宗商品配置指数编制者或所有者停止对本基金的指数使用授权，或国泰大宗商品配置指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致国泰大宗商品配置指数不宜继续作为业绩比较基准，或证券市场上有其他代表性更强、更合适投资的指数作为本基金的业绩比较基准，或有更能代表本基金风险收益特征的业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的业绩比较基准。基金管理人将依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准或备案后予以公告。

1、指数的构成

国泰大宗商品配置指数的构成包括两大部分：商品资产部分（商品期货投资组合）和现金部分（现金或短期政府债券）。商品资产部分涵盖能源、贵重金属、工业金属、农产品等四大类别，用于反映商品市场的整体走势；现金部分用于平抑商品期货组合的市值波动，控制风险。指数提供商根据商品资产部分的近期历史波动率动态调整现金部分的比重，力求将标的整体年化波动率控制在特定的水平（年化15%）以内，以达到控制风险的目的。

商品资产部分的收益根据商品期货每日的结算价进行计算，现金部分的收益以三月期美国国债的收益率进行计算（3-month T-Bill）。

2、指数的资产配置方法

国泰大宗商品配置指数在资产配置上采用了基于历史波动率的风险控制机制。于每月的第十个工作日对商品资产部分在过去90天中的历史波动率进行计算，并将历史波动率和目标波动率（年化15%）进行比较；当商品资产部分波动率较高时提高现金部分比例，当商品资产部分波动率较低时相应降低现金部分比例，以求达到将指数整体在过去90天的波动率控制在不超过年化15%的水平。

3、商品资产部分的成分和权重

截至2011年4月29日，国泰大宗商品配置指数中商品资产部分的成分和权重如下表所示：

能源		贵重金属		工业金属		农产品	
WTI原油	9.8%	黄金	22.0%	铝	6.8%	玉米	4.8%
布伦特原油	4.0%	白银	10.8%	锌	6.1%	小麦	4.8%
天然气	6.9%			铜	6.2%	大豆	4.3%
燃料油	2.5%			镍	0.9%	白糖	3.3%
汽油	2.5%			铅	0.5%	棉花	0.9%
瓦斯油	0.9%					咖啡	0.8%
						可可	0.7%
						牲畜	0.6%
合计	26.6%		32.8%		20.4%		20.3%

4、期货合约的选取

对于任一商品品种，都有多个到期日不同的期货合约可以选择。国泰大宗商品配置指数在期货合约的选取上采用了德意志银行专有的优化展期（Optimum Yield）技术，对每种商品的期货远期曲线进行分析，根据模型选择出展期损失最小（或展期收益最大）的合约月份，并用该月份的期货合约编制指数。

九、投资程序

严格、完备的投资管理流程可以保证投资理念的贯彻执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：基金经理、研究人员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展商品市场波动、商品基金表现等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：境外投资专业决策委员会依据研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据境外投资专业决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据基准配置组合，结合研究报告，基金经理构建组合。追求严格控制投资风险。

（4）交易执行：交易管理部负责具体执行交易，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。稽核监察部对基金投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

（6）组合监控与调整：基金经理将结合商品市场波动情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

（7）本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，可根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

十、风险收益特征

本基金为基金中基金，基金管理人力求将基金年化波动率控制在特定的水平（年化15%）以内。因此本基金属于证券投资基金中的较高预期风险和预期收益的基金。

十一、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月17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2013年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	36,480,390.37	71.44
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,292,788.41	27.99
8	其他各项资产	294,240.50	0.58
9	合计	51,067,419.28	100.00

2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4、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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、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

本基金本报告期末未持有债券。

7、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。

8、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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	POWERSHARES DB COMMODITY INDEX TRACKING FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services LLC	6,933,748.19	13.83
2	ISHARES GOLD TRUST	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	5,973,810.34	11.91
3	ISHARES S&P GSCI COMMODITY INDEXED TRUST	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	5,939,908.13	11.85
4	POWERSHARES DB BASE METALS FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services LLC	5,695,747.01	11.36
5	POWERSHARES DB AGRICULTURE FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services LLC	4,481,260.48	8.94
6	POWERSHARES DB PRECIOUS METALS FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services LLC	3,246,788.69	6.48
7	POWERSHARES DB ENERGY FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services LLC	3,211,783.15	6.41
8	ISHARES SILVER TRUST	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	997,344.38	1.99

10、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（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	554.54
5	应收申购款	293,685.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	294,240.50

（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处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2012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基金的招募说明书。

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
2012年5月3日至2012年12月31日	-1.00%	0.45%	0.43%	0.81%	-1.43%	-0.36%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准（GIPS）。

1、在业绩表述中采用统一的货币；

2、按照GIPS的相关规定和标准进行计算；

3、如果GIPS的标准与国内现行要求不符时，同时公布不同标准下的计算结果，并说明其差异；

4、对外披露时，需要注明业绩计算标准是符合GIPS要求的。

十三、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：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：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

成立时间：1998年3月5日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：何 晔

联系电话：021-38569000，4008888688

股本结构：

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2013年5月3日，本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及35只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、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）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、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、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（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、国泰价值经典股票型证券投资基金（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、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰成长优选股票型证券投资基金、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6个月短期理财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、国泰估值优势股票型证券投资基金（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。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，成为目前业内少数拥有"全牌照"的基金公司之一，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，21年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。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年起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月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999年10月起任公司董事长、党委书记。

庄乾志，董事，博士研究生，高级经济师。1999年8月至2004年12月在中国建设银行总行工作，历任建设银行总行投资银行部副经理、机构业务部高级经理。2005年1月至2007年7月在中国建银投资有限责任公司任投行部副总兼证券公司重组办公室主任。2007年8月至2009年2月在西南证券有限责任公司任董事、党委委员及副总裁。2009年2月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任资本市场部负责人、战略部负责人，现任中国建银投资有限责任公司办公室（党办、董监办）主任。2012年4月起任公司董事。

林川，董事，博士研究生。2006年6月至2009年1月在美国华盛顿互惠银行任高级计量分析师。2009年2月至2009年7月在美国富升人寿保险任财务经理。2010年3月起在中国建银投资有限责任公司风险管理部工作，现任中国建银投资有限责任公司风险管理部风险管理二组负责人。2012年4月起任公司董事。

Philippe SETBON，董事，硕士研究生。1991年起历任BARCLAYS BANK金融分析师；1993年起任BOISSY GESTION SA（AZUR - GMF）首席执行官；2003年起任ROTHSCHILD ET COMPAGNIE GESTION SA股票投资部总监；2004年起任GENERALI FINANCES SA副总经理、投资总监；2007年起任GENERALI INVESTMENT FRANCE S.A.&GENERALI INVESTMENTS首席执行官、投资总监；2009年起任GENERALI INVESTMENTS董事会主席/首席执行官。2011年起任Generali Group首席投资官。并兼任Generali Investments SICAV（卢森堡）主席、Generali Investments Deutschland监事会主席、Generali Investments SGR副主席、THALIA SA（Lugano）董事会成员等职务。2010年6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年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994年起任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002年起任中意人寿保险有限公司董事。2007年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。2010年6月起任公司董事。

侯文捷，董事，硕士研究生，高级工程师。1994年3月至2002年2月在中国电力信托投资有限公司工作，历任经理部项目经理，证券部项目经理，北京证券营业部副经理，天津证券营业部副经理、经理。2002年2月起在中国电力财务有限公司工作，先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记，现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。2012年4月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，19年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007年11月起任公司董事。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993年回国从事律师工作，现为北京中伦律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001年5月起任公司独立董事。

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，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、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。2010年6月起任公司独立董事。

刘美升，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记；1982年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长；1985年起任吉林省抚松县县委常委、常务副县长；1989年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记；1995年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记；1998年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007年任海南省银行业协会会长。2010年11月起任公司独立董事。

韩少华，独立董事，大学专科，高级会计师。1964年起在中国建设银行河南省工作，历任河南省分行副处长、处长；南阳市分行行长、党组书记；分行总会计师。2003年至2008年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010年11月起任公司独立董事。

2、监事会成员

唐建光，监事会主席，大学本科，高级工程师。1982年1月至1988年10月在煤炭工业部基建司任工程师；1988年10月至1993年7月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长；1995年9月至1998年10月在煤炭部基建管理中心工作，先后任综合处处长、中心副主任；1998年10月至2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理；2005年1月起在中国建银投资有限责任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010年11月起任公司监事会主席。

Amerigo BORRINI，监事，大学本科，CFA，金融咨询师。1967年起历任忠利集团会计结算部、忠利集团金融分析师、忠利集团基金经理、忠利集团资产管理公司财务部首席执行官、忠利集团财务部总监、忠利集团总经理助理、忠利集团首席风险官、忠利集团兼并收购及企业融资部总监，并在Generali Horizon S.p.A.，Trieste（IT）、BG Fiduciaria SIM兼任董事会主席及Autovie Venete S.p.A.、Banca Generali S.p.A.、Flandria B）、Generali Investments Italy SGR S.p.A.，Trieste（IT）、Generali Investments SICAV（Lux）、Generali Finance B.V.，Diemen（NL）、Generali Investissement，Parigi（FR）、Genirland（IRL）、Generali Multinational Pension Solutions SICAV（Lux）、Graafschap Holland N.V.，Diemen（NL）、La Centrale Finaziaria Generale S.p.A.、Net Engineering International S.p.A.，Padova（IT）、Perseo S.p.A.，Torino（IT）、Premuda S.p.A.，Genvoa（IT）、Transocean Holding Corporation（USA）等公司兼任董事。2010年6月起任公司监事。

刘顺君，监事，硕士研究生，高级经济师。1986年7月至2000年3月在中国人民解放军军事经济学院工作，历任教员、副主任。2000年4月至2003年1月在长江证券有限责任公司工作，历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003年1月至2005年5月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005年6月起在中国电力财务有限公司工作，先后任金融租赁公司筹建处综合部主任，营业管理部主任助理，华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席，福建业务部副主任、主任，现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012年4月起任公司监事。

沙骏，监事，硕士研究生。1998年5月至1999年11月任职于国泰君安证券，1999年11月至2000年11月任职于平安保险集团，2000年11月至2008年1月任职于宝盈基金管理有限公司。2008年2月加入国泰基金管理有限公司，先后担任交易管理部总监、研究部总监。现任公司投资总监兼基金经理。2010年11月起任公司职工监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001年10月加入国泰基金管理有限公司，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。2007年11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。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，20年证券基金从业经历。1993年4月至1998年4月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998年4月至2007年11月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。2007年12月加入国泰基金管理有限公司，2008年12月起担任公司副总经理，2011年1月起兼北京分公司总经理，2012年2月起兼任人力资源部总监。

周向勇，硕士研究生，17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月起任公司副总经理。

田昆，博士研究生，10年证券基金从业经历。2003年7月至2012年8月在博时基金管理有限公司工作，历任渠道经理、渠道主管、上海分公司副总经理、北京分公司副总经理、市场部总经理、北京分公司及零售业务总经理。2012年8月加入国泰基金管理有限公司，2012年11月起任公司副总经理。

林海中，硕士研究生，11年证券基金从业经历。2002年8月至2005年4月在中国证监会信息中心工作，历任专业助理、主任科员；2005年4月至2012年6月在中国证监会基金监管部工作，历任主任科员、副处长、处长。2012年6月加入国泰基金管理有限公司，2012年8月起任公司督察长。

4、本基金的基金经理

崔涛，硕士研究生，8年证券基金从业经历。2004年6月至2007年5月就职于Paloma Partners资产管理公司，任量化分析师；2007年6月至2009年4月就职于富通银行（纽约），任量化分析师（副总裁）；2009年6月加入国泰基金管理有限公司，任高级经理（量化研究方向），从事量化及衍生品投资、指数基金和ETF的投资研究以及境外市场投资研究。2011年5月起任国泰纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理，2011年5月起任国际业务部总监助理，2012年5月起任国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）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，其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。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，审议并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：

李志坚：全球投资总监

周向勇先生：副总经理

黄淼先生：总经理助理

张则斌先生：财富管理中心投资总监

沙骏先生：投资总监

张玮先生：投资总监兼研究部总监

裴晓辉先生：固定收益投资总监兼固定收益部总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

十四、基金的费用与税收

（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，含境外托管人收取的费用；

3、基金财产拨划支付的银行费用；

4、基金合同生效后的基金信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7、基金的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、征管费、过户费、手续费、券商佣金及其他性质类似的费用等），所投资基金的交易费用和管理费用，及在境外市场的开户、交易、清算和登记等相关的各项费用；

8、外汇兑换交易的相关费用；

9、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

10、与基金缴纳税款有关的手续费、汇款费及顾问费；

11、基金上市初费和上市月费；

12、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、除管理费、托管费之外的基金费用，由基金管理人、基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

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，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费不得从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人应聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

十五、基金托管人

（一）基金托管人情况

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