

国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)

[2013] 第 四 季 度 报 告

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
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

基金份额持有人的董事及监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。

基金经理人:中国人寿建筑工程保险有限公司和国泰基金管理有限公司,于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、风险收益特征等,并同意本基金的披露。基金托管人对本报告复核无异议。

基金经理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报吿期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:国泰大宗商品(QDII-LOF)(场内简称:国泰商品)

基金主代码:160216

交易代码:160216

基金运作方式:上市契约型开放式

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金合同生效日:2012年5月3日

报告期末基金份额总额:34,018,471.24份

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风险的前提下分享大宗商品市场增长的收益。

投资策略:本基金的投资策略为首先确定基础资产配置比例,包括商品类、固定收益类资产间的各类资产配置比例和各商品类间的品种配置比例,然后以基础配置比例为基础构建投资组合,最后根据市场变化动态调整组合收益类资产比例,以求将投资组合的整体风险控制在特定的水平以内。

业绩比较基准:国泰大宗商品配置指数(全收益指数)(注:以人民币计价计算)

风险收益特征:本基金为基金中的基金,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低预期风险和预期收益的基金。

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

境外资产托管人英文名称:State Street Bank and Trust Company

境外资产托管人中文名称:美国道富银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -290,181.32

2.本期利润 -1,091,494.06

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0299

4.期末基金资产净值 28,176,414.73

5.期末基金份额净值 0.828

(注:1)本基金在6个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

(2)期间业绩比较基准以人民币计价。

(3)本基金的合同生效日为2012年5月3日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

崔海 100ETF基金经理、国际业务部总监助理 2012-05-03 - 9

本基金的基金经理,曾任国泰基金管理有限公司国际业务部总监助理,2012年5月起兼任国泰商品(QDII-LOF)基金经理,2013年4月起兼任纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注:1.此系本基金的任职业期,即从首次担任本基金基金经理之日起,直至基金合同终止日止。

2.从2013年1月1日起,基金管理人不再单独披露从业人员从人员资格管理办法的相关规定。

4.2报告期内本基金无通过定期报告披露的基金经理变动情况。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金管理暂行办法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定,遵循“遵守法律法规、维护基金持有人利益”的原则,最大限度地保护投资人合法权益。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报吿期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 5 基金产品概况

5.1 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 25,029,853.55 85.89

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,期货 - -

5 其他 - -

6 投资衍生工具 - -

7 银行存款和结算备付金合计 4,106,794.91 14.09

8 其他各项资产 3,513.91 0.01

9 合计 29,140,623.47 100.00

5.2 报告期内各国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本期未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期内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

本基金本期未持有股票。

5.4 报告期内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

本基金本期未持有资产支持证券。

5.5 报告期内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

本基金本期未持有债券。

5.6 报告期内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

本基金本期未持有贵金属。

5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的历史走势对比图

(2012年5月3日至2013年12月31日)

注:(1)本基金在6个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

(2)期间业绩比较基准以人民币计价。

(3)本基金的合同生效日为2012年5月3日。

注:(1)本基金在6个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

(2)期间业绩比较基准以人民币计价。

(3)本基金的合同生效日为2012年5月3日。