国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]307号文注册募集。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价值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:因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险(食品A份额的本金及约定收益的风险、指数化投资风险、运作风险)等。

本基金虽为股票型指数基金,但由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。国泰食品份额是本基金基础份额,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。食品A份额和食品B份额通过场内的国泰食品份额按照1:1的基金份额配比自动分离或分拆而来,按照基金合同的约定,具有与国泰食品份额不同的风险收益特征。食品A份额的预期风险和预期收益较低,食品B份额由于内含杠杆机制的设计,预期风险和预期收益有所放大,将高于普通的股票型基金,其净值的变动幅度将大于国泰食品份额和食品A份额净值的变动幅度,即食品B份额的波动性要高于其他两类分额,其承担的风险也较高。食品B份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。食品A份额和食品B份额可通过基金合同约定的配对转换方式合并为场内的国泰食品份额,或通过基金合同约定的份额折算方式,折算为场内的国泰食品份额,从而体现出本基金基础份额的风险收益特征。

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。

第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)和其他法律法规的有关规定以及《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处,均以基金合同为准。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金
2、基金管理人:指国泰基金管理有限公司
3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司
4、基金合同:指《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书或本招募说明书:指《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7、基金份额发售公告:指《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
8、上市交易公告书:指《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金之食品A份额与食品B份额上市交易公告书》
9、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
10、《基金法》:指《中华人民共和国证券投资基金法》
11、《销售办法》:指《证券投资基金销售管理办法》
12、《信息披露办法》:指《证券投资基金信息披露管理办法》
13、《运作办法》:指《证券投资基金运作管理办法》
14、《业务规则》:指深圳证券交易所发布实施的《上市开放式基金业务指引》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订;中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订;深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司发布的相关通知、指引、指南
15、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
16、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
17、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
18、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
19、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
20、合格境外机构投资者:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内市场的中国境外的机构投资者
21、投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
22、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
23、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
24、销售机构:指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位
25、注册登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人开放式基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
26、注册登记机构:指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为国泰基金管理有限公司或接受国泰基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构
27、场外:指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
28、场内:指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回
29、注册登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统
30、证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统。通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统
31、基金份额结构:本基金的基金份额包括国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基础份额(简称“国泰食品份额”)、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(简称“食品A份额”)和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的积极收益类份额(简称“食品B份额”)。其中,食品A份额和食品B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变
32、国泰食品份额:指国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基础份额
33、食品A份额:指国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的稳健收益类份额
34、食品B份额:指国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的积极收益类份额
35、分级份额:指食品A份额、食品B份额的统称
36、场外份额:指登记在注册登记系统下的基金份额
37、场内份额:指登记在证券登记结算系统下的基金份额
38、开放式基金账户:指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。
39、深圳证券账户:指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统
40、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金交易业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
41、本金:除非基金合同文义另有所指,对于食品A份额而言,指1.0000元
42、食品A份额约定年基准收益率:指“一年期定期存款利率(税后)+4.00%”,其中,一年期定期存款利率以最近一次基金份额折算基准日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。基金合同生效日(含)至第一次基金份额折算基准日(含)期间的一年期定期存款利率以基金合同生效日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准
43、食品A份额约定日单利收益率:指食品A份额约定年基准收益率除以365
44、食品A份额的约定收益:指自基金合同生效日(含)起至第1个基金份额折算基准日(含)期间、或自上一个基金份额折算基准日(定期折算基准日或不定期折算基准日)次日(含)起至下一个基金份额折算基准日(含)期间,以1.0000元为基准,采用食品A份额约定日单利收益率累计计算的金额
45、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期
46、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
47、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月
48、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
49、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
50、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
51、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
52、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
53、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
54、标的指数:指国证食品饮料行业指数
55、上市交易:指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖食品A份额、食品B份额的行为
56、分拆:指根据基金合同的约定,场内的国泰食品份额按照1:1的基金份额配比分拆为食品A份额和食品B份额的行为
57、合并:指根据基金合同的约定,食品A份额和食品B份额按照1:1的基金份额配比合并为场内的国泰食品份额的行为
58、场内份额配对转换:指根据基金合同约定,场内的国泰食品份额与分级份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并
59、自动分离:指基金发售结束后,对投资人场内认购所得的全部份额按照1:1的基金份额配比确认为食品A份额与食品B份额
60、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
61、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
62、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
63、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效的公告,在本基金份额与基金管理人管理的其他基金基金份额间的转换行为
64、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作,包括系统内转托管和跨系统转托管
65、系统内转托管:指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构之间或证券登记结算系统内不同会员单位之间进行转托管的行为
66、跨系统转托管:指基金份额持有人将持有的国泰食品份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为
67、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、申购金额及扣款方式,由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
68、巨额赎回:指本基金单个开放日,国泰食品份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上赎回申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的(包括国泰食品份额、食品A份额与食品B份额)的10%
69、元:指人民币元
70、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
71、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
72、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
73、基金份额净值:指根据基金份额净值计算规则计算的国泰食品份额、食品A份额和食品B份额的基金份额净值
74、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
75、指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
76、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 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:何晔
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2014年8月31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46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、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、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、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、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金、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、国泰金龙行业