

## 国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)

[2014]第三季度报告

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:二〇一四年十月二十七日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本基金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约定，于2014年10月23日复核了本报告中的财务

数据、净值和收益分配情况、投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金经理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

本基金简称:国泰大宗商品(QDII-LOF)(场内简称:国泰商品)

基金代码:160216

交易代码:160216

基金运作方式:上证型契约开放式

基金合同生效日:2012年5月3日

报告期末基金份额总额:21,513,529.81份

本基金通过在大宗商品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下分层大类商品品种。

本基金的资产配置为贵金属类资产配比比例,但商品类、固定收益类资产

占总资产的比例和各商品类品种的配比比例,但以贵金属类资产配置比例最高,其次是商品类资产配置比例,以求得资产组合的稳定性及在预定水平内。

业绩比较基准:国泰大宗商品指数(收益率指数)(以下简称为“定价基准”)

风险收益特征:本基金为债券型基金,基金管理人通过将基金资产划拨到特定的水平(年化5%)以内,以此本基金属于投资级基金中的较高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

境外托管人:平安汇通公司 State Street Bank and Trust Company

境外账户开户人英文名称:美国富兰克林 Franklin Templeton

§ 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 (2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 -113,659.95

2.本期利润 -1,801,266.87

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0763

4.期末基金资产净值 16,848,574.76

5.期末基金份额净值 0.783

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2)所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金的基本情况

3.2.1 本报告期基金份额的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差额(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差额(④) ①-③ ②-④

过去三个月 -9.06% 0.44% -10.47% 0.48% 1.41% -0.04%

注:同期间业绩比较基准以人民币计价。

(2)同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间 证券从业年限 说明

董海 本基金的基金经理,国泰基金管理有限公司固定收益部总监,具有10年以上金融行业经验,其中10年以上固定收益类产品管理经验,并具有丰富的风险管理经验。

2012-05-03 ~ 10 略

本基金的基金经理在担任基金经理期间,未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违法违规行为,信息披露及时、准确、完整,本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合公司保持独立运作,并通过科学决策、规范运作、精心管理,健全内部控制体系,有效保护投资者的合法权益。

4.2 公平交易专项说明

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》的相关规定,通过严格的内部风险控制制度和流程,对各项投资的风险和管理风险进行有效控制,严格控制不同投资组合之间的同一时段内反向交易,严格执行不公平的公平交易和利益输送的同日反向交易,确保公平对待所有基金的投资组合,切实防范利益输送行为。

4.4 报告期内本基金没有参与股票一级市场申购或新股发行承销工作。

4.5 报告期内本基金没有参与债券一级市场申购或新股发行承销工作。

4.6 报告期内本基金没有参与债券二级市场买卖。

4.7 报告期内本基金没有参与权证一级市场申购或新股发行承销工作。

4.8 报告期内本基金没有参与股指期货交易。

4.9 报告期内本基金没有参与国债期货交易。

4.10 报告期内本基金没有参与商品期货交易。

4.11 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.12 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.13 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.14 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.15 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.16 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.17 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.18 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.19 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.20 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.21 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.22 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.23 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.24 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.25 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.26 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.27 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.28 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.29 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.30 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.31 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.32 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.33 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.34 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.35 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.36 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.37 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.38 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.39 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.40 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.41 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.42 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.43 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.44 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.45 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.46 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.47 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.48 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.49 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.50 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.51 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.52 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.53 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.54 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.55 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.56 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.57 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.58 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.59 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.60 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.61 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.62 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.63 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.64 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.65 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.66 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.67 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.68 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.69 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.70 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.71 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.72 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.73 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.74 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.75 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.76 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.77 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.78 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.79 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.80 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.81 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.82 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.83 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.84 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.85 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.86 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.87 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.88 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.89 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.90 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.91 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.92 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.93 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.94 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.95 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.96 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.97 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.98 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.99 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.100 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.101 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.102 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.103 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.104 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.105 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.106 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.107 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.108 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.109 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.110 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.111 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.112 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.113 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.114 报告期内本基金没有参与国债期权交易。

4.115 报告期内本基金没有参与商品期权交易。

4.116 报告期内本基金没有参与权证二级市场买卖。

4.117 报告期内本基金没有参与股指期权交易。

4.118