# 国泰深证TMT50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]308号文准予募集注册,并依据中国证券监督管理委员会机构部函[2015]378号文进行募集。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(TMT50A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TMT50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。TMT50A份额和TMT50B份额通过场内的国泰TMT50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TMT50份额不同的风险收益特征。TMT50A份额的预期风险和预期收益较低,TMT50B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TMT50份额和TMT50A份额净值的变动幅度,即TMT50B份额的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。TMT50B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。TMT50A份额和TMT50B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TMT50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TMT50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》”)、《公开募集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《国泰深证TMT50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:指国泰深证TMT50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《国泰深证TMT50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《国泰深证TMT50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《国泰深证TMT50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《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金份额发售公告》
8、上市交易公告书:指《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金之TMT50A份额与TMT50B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《公开募集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《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金登记结算业务指引》、《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(修订版)》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以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、登记结算系统: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深证TMT50指数分级证券投资基金的基础份额(简称“国泰TMT50份额”)、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(简称“TMT50A份额”)和国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的积极收益类份额(简称“TMT50B份额”)。其中,TMT50A份额和TMT50B份额的基础份额比例约为1:1的比例不变
32、国泰TMT50份额:指国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的基础份额
33、TMT50A份额:指国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的稳健收益类份额
34、TMT50B份额:指国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的积极收益类份额
35、分级份额:指TMT50A份额、TMT50B份额的统称
36、场外份额:指登记在登记结算系统下的基金份额
37、场内份额:指登记在证券登记系统下的基金份额
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。基金投资人办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的登记结算系统
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TMT50A份额而言,指1.0000元
42、TMT50A份额约定年基准收益率:指“一年期定期存款利率(税后)+3.00%”,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、TMT50A份额约定日单利收益率:指TMT50A份额约定年基准收益率除以365
44、TMT50A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TMT50A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:指深证TMT50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TMT50A份额、TMT50B份额的行为
56、分拆:指根据基金合同的约定,场内的国泰TMT50份额按照1:1的基金份额配比分拆为TMT50A份额和TMT50B份额的行为
57、合并:指根据基金合同的约定,TMT50A份额和TMT50B份额按照1:1的基金份额配比合并为场内的国泰TMT50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TMT50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TMT50A份额与TMT50B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登记结算系统内不同销售机构之间或证券登记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TMT50份额在登记结算系统和证券登记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TMT50份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出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TMT50份额、TMT50A份额与TMT50B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TMT50份额、TMT50A份额和TMT50B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、指定媒介: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介
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:何晖
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12月31日,本基金管理人共管理49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、国泰创利债券型证券投资基金(由国泰6个月期押题时债券型证券投资基金转型而来)、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、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金。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,22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,2014年12月11日起代任公司总经理。
张瑞庆,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,现任战略发展部处长。2014年5月起任公司董事。
陈川,董事,博士研究生,经济师。2001年7月至2005年8月,在中国建设银行总行工作,历任中间业务部、投资银行部、公司业务部业务副经理、业务经理。2005年8月至2007年6月,在中国建银投资有限责任公司工作,历任投资银行部、委托代理业务部业务经理、高级副经理。2007年6月至2008年5月,在中投证券资本市场部担任执行总经理。2008年5月至2012年6月,在中国建银投资有限责任公司工作,历任投资银行部高级经理、投资部高级经理、企业管理部高级经理。2012年6月至2012年9月,任建投科信科技股份有限公司副总经理。2012年9月至2013年4月,任中建投租赁有限责任公司纪委书记、副总经理。2013年4月至2014年1月,任中国建银投资有限责任公司长期股权投资部总经理。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部业务总监。
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年在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。
侯文建,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。
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、天津仲裁委员会仲裁员等职。2010年6月起任公司独立董事。
刘思丹,独立董事,大学学历,高级经济师。1980年起任吉林省长白县人马鹿沟乡党委书记;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;1996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主任。2010年11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年起在工商银行河北省工作,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。
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2007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任公司秘书兼法务。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任法律及合规部主管。2008年8月至2014年3月任Allianz Global Investors Singapore Limited任东南亚及南亚合规部主管。2014年3月17日起任Generali Investments Asia Limited任首席执行官。
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,管业理理部主任助理,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。
乔巍,监事,大学本科。1997年1月至2001年7月任职于泰康人寿保险公司,2001年8月至2001年9月任职于上海明城投资咨询公司,2001年9月至2013年7月任职于华夏基金管理有限公司,2013年8月加入国泰基金管理有限公司,现任公司总经理助理。2013年11月起任公司职工监事。
李辉,监事,大学本科。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月任职于中宏人寿保险有限公司,2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司,2005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。现任公司人力资源部及财富大学负责人。2013年11月起任公司职工监事。
束琴,监事,大专学历。1980年3月至1992年3月分别任职于人民银行安康地区分行和工商银行安康地区分行,1993年3月至2008年8月任职于陕西省住房资金管理中心。2008年8月加入国泰基金管理有限公司,先后担任行政管理部主管、总监助理。现任公司行政部副总监。2013年11月起任公司职工监事。
3、高级管理人员
陈勇胜,董事长及代任总经理,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,21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。
周向勇,硕士研究生,18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。
贺燕萍,硕士,16年证券业从业经历。1998年2月至2007年8月在中信建投证券有限责任公司(原华夏证券有限公司)研究所和机构业务部任总经理助理;2007年8月至2013年8月历任光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、总经理和光大证券资产管理有限公司总经理;2013年8月加入国泰基金管理有限公司,2013年10月起任公司副总经理。
林海中,硕士研究生,12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、本基金拟任基金经理
艾小军,硕士研究生,13年基金业从业经历,2001年5月至2006年9月在华安基金管理有限公司任量化分析师;2006年9月至2007年8月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师;2007年9月至2007年10月在平安资产管理有限公司任量化分析师;2007年10月加入国泰基金管理有限公司,历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014年1月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、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,其成员在公司分管副总经理、投资总监、绝对收益投资(事业)部、权益投资(事业)部、量化投资(事业)部等相关人员中产生。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:
周向勇先生:副总经理
黄焱先生:总经理助理兼投资总监兼权益投资(事业)部总经理
乔巍先生:总经理助理兼绝对收益投资(事业)部总经理
沙骏先生:量化投资(事业)部总经理
张玮先生:权益投资总监
吴晨先生:绝对收益投资(事业)部总监助理
6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。
四、基金管理人职责
1、依法募集资金,办理基金份额的发售和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6、编制季度、半年度和年度基金报告;
7、计算并公告基金资产净值,确定国泰TMT50份额申购、赎回价格;
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9、按照规定召集基金份额持有人大会;
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。
五、基金管理人承诺
1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。
2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)法律法规或中国证监会禁止的其他行为。
3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:
(1)越权或违规经营;
(2)违反基金合同或托管协议;
(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6)玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责;
(7)违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(8)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
(9)贬损同行,以抬高自己;
(10)以不正当手段谋求业务发展;
(11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
(13)其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。
4、基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生。
5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
六、基金经理承诺
1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着诚慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;
3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,且不利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。
七、基金管理人内部控制制度
1、内部控制制度概述
基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险,保证经营活动的合法合规和有效开展,制定了一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施,形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面,并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。
(1)内部风险控制遵循的原则
1)全面性原则:内部风险控制必须覆盖公司所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;
2)独立性原则:公司设立独立的稽核监察部,稽核监察部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查;
3)相互制约原则:公司及各部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系;
4)保持与业务发展的同等地位原则:公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上,内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上;
5)定性和定量相结合原则:建立完备风险控制指标体系,使风险控制更具客观性和操作性。
(2)内部会计控制制度
公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求,建立了完善的内部会计控制制度,实现了职责分离和岗位相互制约,确保会计核算的真实、准确、完整,并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立,保护基金资产的独立、安全。
(3)风险管理控制制度
公司为有效控制管理运营中的风险,建立了一整套完整的风险管理控制制度,其内容由一系列的具体制度构成,主要包括:岗位分离和空间分离制度、投资管理控制制度、信息技术控制、营销业务控制、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度、人力资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程,对公司面临的投资风险和管理风险进行有效的控制。
(4)监察稽核制度
公司实行独立的监察稽核制度,通过对稽核监察部充分授权,对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循情况和有效性进行全面的独立监察稽核,确保公司经营的合法合规性和内部控制的有效性。
2、基金管理人内部控制制度要素
(1)控制环境
公司经过多年的管理实践,建立了良好的控制环境,以保证内部会计控制和管理控制的有效实施,主要包括科学的公司治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经管理念、独立的监察稽核职能等方面。
1)公司建立并完善了科学的治理结构,目前有独立董事4名。董事会下设提名及薪酬考查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会,对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任,既相互独立,又相互合作和制约,形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系;
3)公司一贯坚持诚信为投资者服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念,形成了诚信为本和稳健经营的企业文化;
4)公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限,并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。
(2)控制的性质和范围
1)内部会计控制
公司建立了完善的内部会计控制,保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。
首先,公司根据国家有关法律法规,有关会计制度和准则,制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及会计核算流程,做好基金业务和公司经营的核算工作,真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司财务状况。
其次,公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开,保证两者相互独立,各基金之间做到独立建账、独立核算,保证基金资产和公司资产之间、以及各基金资产之间的相互独立性。
公司建立了严格的岗位职责分离控制、凭证与记录控制、资产接触控制、独立稽核等制度,确保在基金核算和公司财务管理中做到对资源的有效控制、有关功能的相互分离和各岗位的相互监督等。
另外公司还建立了严