国泰基金管理有限公司国泰全球绝对收益型基金优选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:中国银行股份有限公司
二零一五年十月

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2015年10月9日证监许可【2015】2252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投资价值、市场前景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。

本基金投资于境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF)),基金净值会因为境外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。投资人根据所持有的基金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:本基金特有风险(投资标的风险、主动管理风险、境外证券投资限制引致的风险)、境外投资风险(境外市场风险、汇率风险、政治风险、政府管制风险、税务风险、法律风险)、开放式基金风险(利率风险、流动性风险、信用风险、操作风险、会计核算风险、交易结算风险、技术系统运行风险、通讯风险、巨额赎回风险、不可抗力风险)等。

本基金主要投资于境外绝对收益型基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益中等的品种,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照格尽职守、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。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称 “《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称 “《信息披露办法》”)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称“《试行办法》”)、《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》(以下简称“《通知》”)和其他有关法律法规的有关规定以及《国泰全球绝对收益型基金优选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:指国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金
2、基金管理人:指国泰基金管理有限公司
3、基金托管人:指中国银行股份有限公司
4、境外托管人:指符合法律法规规定的条件,根据基金托管人与其签订的合同,为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
5、基金合同:指《国泰全球绝对收益型基金优选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
6、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰全球绝对收益型基金优选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
7、招募说明书或本招募说明书:指《国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
8、基金份额发售公告:指《国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金基金份额发售公告》
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》及颁布机关对其不时做出的修订
11、《销售办法》:指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12、《信息披露办法》:指《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、《运作办法》:指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
14、《试行办法》:指《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订
15、《通知》:指《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》
16、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
17、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
18、外管局:指国家外汇管理局或其分支机构
19、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
20、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
21、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
22、合格境外机构投资者:指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
23、人民币合格境外机构投资者:指符合现行有效的相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者
24、投资人:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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
25、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
26、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
27、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
28、注册登记业务:指基金注册登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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
29、注册登记机构:指办理注册登记业务的机构。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注册登记业务的机构
30、基金账户:指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
31、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认购、申购、赎回、转换、转托管等业务导致基金的基金份额变动及结余情况的账户
32、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
33、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
34、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
35、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
36、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
37、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
38、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
39、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
40、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
41、《业务规则》:指《国泰基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守
42、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
43、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
44、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人根据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
45、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公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
46、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
47、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
48、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金份额净赎回申请(①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;②美元基金份额按当日汇率折算为人民币等值基金份额后同人民币基金份额合并计算,下同)超过上一开放日基金总份额(美元基金份额按上一开放日当日汇率折算为人民币等值基金份额后同人民币基金份额合并计算,下同)的10%
49、基金份额类别:指本基金根据认购/申购、赎回所使用的货币不同,将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为人民币份额;以美元计价并进行认购、申购、赎回的份额类别,称为美元份额
50、基金中基金:指百分之八十以上的基金资产投资于其他基金份额的,为基金中基金
51、基准货币:指基金资产估值的记账本位币。本基金的基准货币为人民币
52、人民币:指中国法定货币
53、美元:指美国法定货币及法定货币单位
54、元:如无特指,指人民币元
55、汇率:如无特指,指中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价
56、基金收益:指基金投资所得红利、票据投资收益、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
57、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、基金份额、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
58、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
59、基金份额净值:指估值日某类基金资产净值除以估值日该类基金份额总额后得出的基金份额财产净值。本基金人民币份额的基金份额净值为估值日人民币份额所对应的基金资产净值除以估值日人民币份额的份额总数;本基金美元份额的基金份额净值为估值日美元份额所对应的基金资产净值除以估值日美元份额的份额总数
60、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
61、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
62、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
63、中国:指中华人民共和国(仅为基金合同目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
64、主要境外市场:指投资比例合计占本基金基金资产净值20%以上的同一市场的基金所在的市场
65、公司行为信息:指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动,及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息,包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息
66、等值基金份额:指美元份额按基金份额净值以适用汇率折算为人民币后的金额与人民币份额的基金份额净值之比乘以美元基金份额数折算为等值人民币基金份额数。

第三部分 风险揭示

本基金投资于境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF)),基金净值会因为境外证券市场及汇率波动等因素产生波动。基金投资中出现的风险分为如下三类:一是本基金特有风险,包括投资标的风险、主动管理风险、境外证券投资限制引致的特殊风险等;二是境外投资风险,包括境外市场风险、汇率风险、政治风险、税务风险、法律风险等;三是开放式基金风险,包括利率风险、流动性风险、信用风险、操作风险、会计核算风险、交易结算风险、技术系统运行风险、通讯风险、巨额赎回风险、不可抗力风险等。

一、本基金特有风险

1、投资标的风险

本基金主要投资于境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF))。这些基金都会随着当地市场的波动而有所起伏。

2、主动管理风险

指基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金是一只主动管理型基金,在本基金精选基金的操作过程中,基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断,其精选出的基金的业绩表现并不一定持续的优于其他基金。

3、境外证券投资额度限制引致的风险

本基金将按照中国证监会和外管局核准的额度(美元额度需折算为人民币)设定基金募集期内的募集规模上限。

基金合同生效后,基金的资产规模不受上述限制,但基金管理人有权根据基金的境外证券投资额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

二、境外投资风险

1、境外市场风险

境外市场风险是指由于市场因素如基础利率、汇率、股票价格和商品价格的变化或由于这些市场因素的波动率的变化而引起的证券价格的非预期变化,并产生损失的可能性。由于本基金将投资于境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF)),所以,当境外证券市场受到特有的政治环境、法律法规、市场状况、经济发展趋势、股市波动等因素影响时,基金的净值也会发生相应变化,并最终影响本基金的投资收益。

2、汇率风险

由于本基金在全球范围内进行投资,而本基金的记账货币是人民币,因此在投资外汇计价资产时,除了证券本身的收益/损失外,人民币的升值会给基金资产带来额外的损失,从而对基金净值和投资者收益产生影响。

3、政治风险

不同国家或地区的内外政治关系变化,如政府更迭、政策调整、制度变革、国内出现动乱、对外政治关系发生危机等,都可能对本基金所参与的投资市场或投资产品造成直接或者间接的负面冲击。另外,不同国家或地区的财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化,导致市场波动而影响基金收益,产生风险。

4、政府管制风险

政府管制风险是指所投资国家或地区可能会采取某些管制措施,比如资本或外汇控制、资产冻结或扣压以及征收高额税款等给基金收益带来的不利影响。

5、税务风险

税务风险是指本基金投资各国或地区市场时,因各国、地区税务法律法规的不同,可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金,包括预扣税,该行为可能会使得资产回报受到一定影响;各国、地区的税收法律法规的规定可能变化,或者加以具有追溯力的修订,所以可能须向该等国家缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项都可能对本基金造成影响。

6、法律风险

由于各个国家或地区适用不同法律法规的原因,可能基金的某些投资行为在部分国际或地区受到限制或合同不能正常执行,或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因,给交易者带来损失的可能性。

另外,由于基金合同部分条款在法律上引起争议或诉讼,或由于现行的法律法规、税制、估值等制度的改变,给基金带来损失的可能性。

三、开放式基金风险

1、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率风险是货币市场投资所面临的主要风险,国家或地区的利率变动还将影响该地区的经济与汇率等。

2、流动性风险

流动性风险是指基金资产不能迅速转变成现金,或变现成本高,影响基金运作和收益水平。在出现的投资人巨额赎回时,如果基金资产变现能力差,可能会产生基金仓位调整的困难。同时,由于本基金涉及跨境交易,其赎回到账期通常比国内开放式基金需要更长的时间。

3、信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,可能导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金主要投资于境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF)),银行存款和货币市场工具,因而信用风险相对较低。

4、操作风险

操作风险是指那些由于内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等原因可能引致的风险。这种风险可能来自基金管理人、基金托管人、境外托管人、登记结算机构、销售机构等。

以下事件有可能引发操作风险:

(1)内部程序出错造成的资产计量错误;

(2)员工的操作造成的错误;

(3)违规操作造成的损害,如市场操纵、内幕交易、利益输送等。

5、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作或工作疏忽形成的风险,如经常性的串户、账务记重、透支、过失付款、资金汇划系统款项错划、日终轧账假平、会计备份数据丢失、利息计算错误等。

另外,由于各个国家/地区对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定存在一定差异,可能给本基金投资带来潜在风险。

6、交易结算风险

交易结算风险主要因为国际结算的支付方式和时间的差异,造成划付款项的延误和错划,进而影响到投资者的申购赎回及基金资产的安全。

7、技术系统运行风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、境外托管人、登记结算机构、销售机构等。

8、通讯风险

通讯风险是指境外投资管理活动对远距离、跨时区的通讯系统要求较高,技术失误或自然灾害等因素造成的通讯故障可能会影响到本基金投资管理活动的准确性和时效性,从而导致基金资产受到损失。

9、巨额赎回风险

本基金为开放式基金,基金规模将随着投资者对基金单位的赎回而不断变化,若是由于投资者的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响。此外,因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回,并导致基金管理人的现金支付出现困难,基金投资者在赎回基金份额时,可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

10、不可抗力风险

不可抗力风险是指战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。金融市场危机、境外代理机构破产等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金及投资人的利益受损。

第四部分 基金的投资

一、投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,追求稳健的投资回报。

二、投资范围

本基金的投资范围为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境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF))、银行存款、货币市场工具等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于境外公募基金资产的比例不低于基金资产的80%,投资于基金合同界定的绝对收益型基金占非现金基金资产的比例不低于80%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

三、投资策略

本基金通过定量和定性相结合的方式优选境外绝对收益型公募基金(以下简称“标的基金”),按照资产管理人、绝对收益目标的实现策略等角度适度分散本基金的配置,以期实现基金资产的稳健增值。

1、境外绝对收益型公募基金的界定

本基金管理人对境外绝对收益型公募基金的界定,主要依据标的基金的名称和投资目标,即1)基金名称中含绝对收益(absolute return/total return)字样;或2)以追求绝对收益为主要投资目标的基金,例如以追求在不同市场环境下获得长期正回报为投资目标的基金,以追求获得资产增值的同时实现风险最小化为投资目标的基金等。其实现绝对收益目标的策略包括但不限于:

① 多资产配置策略(Multi-Asset Allocation)

根据对市场环境的深入研究,通过在各资产类别中灵活配置,以期实现稳健的绝对收益。

② 全球配置策略(Global Allocation)

通过在全球各地区进行资产配置分散投资,以期获得稳健的风险回报率。

③ 市场中性策略(Market Neutral)

通过同时构建多头和空头头寸以对冲市场风险,以期在任何市场环境下均能获得稳定收益。

④ 长短仓对冲策略(Long/Short)

通过同时构建多头和空头来对冲一定的市场风险,但两者的比例相对比较灵活,以期实现相对稳健的投资收益。

⑤ 全球宏观策略(Global Macro)

利用宏观经济的基本原理来识别金融资产价格的失衡错配现象,在世界范围的外汇、股票、债券、期货、期权以及其他金融产品上进行资产配置,以期获得稳健的投资收益。

⑥ 事件驱动策略(Event driven)

通过分析重大事件发生前后对投资的标的的影响不同而进行投资,重大事件包括发生分拆、收购、合并、破产重组、财务重组、资产重组等。

⑦ 套利策略(Arbitrage)

通过对各种金融工具的研究,利用金融工具之间的价格不合理进行相应的套利,包括可转债套利、固定收益套利、期货套利、ETF套利等。

⑧ 多重策略(Multi-Strategy)

通过对上述多种策略的组合,平滑单一策略的风险,以期获得更稳健的投资收益。

随着新金融工具的增加,绝对收益目标实现策略的不断丰富、成熟,本基金管理人可相应丰富、增加标的基金。

2、基金投资策略

本基金通过定量分析策略和定性分析策略相结合的方式优选标的基金,通过分析各标的基金的费率水平、历史收益、夏普比率、历史回撤、波动率等量化指标,挑选出合适的基金组成标的基金池。再对标的基金池中的基金进行筛选和配置,通过深入了解标的基金的具体策略及投资领域,并对资产管理公司的历史、组织构架,以及标的基金投资经理的优势及稳定性进行分析,将资产分散投资于不同基金管理人、投资策略的基金,构建基金投资组合。

1)定量分析策略

本基金对标的基金的费用、收益和风险进行定量分析,选择成立时间较长或有较长的可回溯历史业绩的标的基金。主要关注以下几个定量指标:

①费率水平(Expense Ratio)

考察基金的管理费(Management Fee)、申购费(Front Load/Initial Charge等)、赎回费(Redemption Fee/Exit Charge等)、业绩提成(Performance Fee)和销售费用(Distribution Fee)等,选择综合费率较低的标的基金。

②收益分析(Performance Analysis)

分析基金在不同市场环境下的历史收益表现,包括历史收益(Return)和夏普比率(Sharp Ratio)等,分析基金的收益表现是否和基金的投资目标、投资策略相符合。

③风险分析(Risk Analysis)

分析基金的历史回撤(Drawdown)和波动率(standard deviation),选择总体投资风险水平适当可控的基金。

2)定性分析策略

本基金主要从资产管理公司和投资经理两个角度对标的基金进行定性分析,主要关注以下定性指标:

①资产管理公司(Asset Management Company)

考察资产管理公司的历史变迁(History)、组织构架(Organization)、产品优势(Advantages)等。选择成立时间较长,组织构架较为稳定,资产规模较大,在行业内有一定的影响力的资产管理公司。

②投资经理(Portfolio Manager/Team)

考察投资经理的投资理念(Investment Philosophy)和投资优势、稳定性、从业经验、所管理其他基金的状况等。选择投资经理投资理念和投资优势较为清晰,稳定性较高,从业经验丰富的投资经理。

四、投资限制

1、组合限制

(1)本基金投资于境外公募基金资产的比例不低于基金资产的80%,投资于基金合同界定的绝对收益型基金占非现金基金资产的比例不低于80%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%;

(2)每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的20%。本基金投资境外全型基金的,该全型基金应当视为一只基金;

(3)本基金不得投资于以下基金:

1)其他基金中基金;

2)联接基金(A Feeder Fund);

3)投资于前述两项基金的全型基金子基金;

(4)本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%,其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行,但存放于境内外托管账户的存款可以不受上述限制;

(5)本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券(不包括境外基金)市值不得超过基金资产净值的10%;

(6)本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

(7)基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金,不得超过该境外基金总份额的20%。

(下转A30版)

国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可【2015】2252号文准予注册募集。中国证监会对本基金募集的注册,并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金为基金中基金。基金运作方式为契约型开放式。

3、本基金的基金管理人和注册登记机构为国泰基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为中国银行股份有限公司,境外托管人为中国银行(香港)有限公司。

4、本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及中国证监会允许进行认购的其他投资人。

5、本基金自2015年10月28日至2015年11月17日通过基金管理人指定的销售机构公开发售。本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。本公司也可根据基金销售情况在募集期限内适当缩短或延长基金发售时间,并及时公告。

6、本基金的销售机构包括直销机构和其他销售机构。本基金通过本公司直销机构和其他销售机构为投资人办理基金认购等业务。直销机构包括本公司直销柜台和电子交易平台,其他销售机构包括银行、券商及其他机构,销售机构名单详见“七(三)销售机构”。各销售机构的办理地点、办理日期、办理时间和办理程序等事项参照各销售机构的具体规定。

7、本基金通过各销售机构的基金销售网点以人民币和美元两种货币同时向投资者公开发售。以人民币认购的基金份额登记为人民币份额,以美元现汇认购的基金份额登记为美元现汇份额,以美元现钞认购的基金份额登记为美元现钞份额。如无特指,美元现汇份额和美元现钞份额以下统称美元份额。各类基金份额的发售机构、业务办理规则可能不尽相同,投资者在办理业务前应查阅招募说明书及相关公告。如投资者以美元现钞认/申购基金份额时,发生现钞转换为现汇的相关费用,由投资者自行承担或遵守销售机构的相关规定。

8、募集规模

本基金募集规模上限为10亿元人民币或等值货币。在募集期内任何一天(含第一天),若当日募集时间截止后,本基金募集总规模(以认购金额计,不含募集期间利息)超过10亿元人民币或等值货币(募集资金中的美元应以该日的汇率折算为人民币后,同人民币认购金额合并计算,下同),基金管理人将结束募集并于次日在指定媒体上公告。若募集期内本基金接受的有效认购申请总金额未超过10亿元人民币或等值货币,则对所有有效认购申请予以确认。若募集期内任何一天当日募集时间截止后,接受的有效认购申请总金额超过10亿元人民币或等值货币,则该日为募集结束日,该日的有效认购申请采用“比例确认”的原则予以部分确认,未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还投资者;募集结束日之前提交的有效认购申请全部予以确认。

募集结束日有效认购申请“比例确认”的计算方法如下:

募集结束日部分确认的比例=(募集规模上限-募集首日起至募集结束日前一日有效认购申请金额)/募集结束日有效认购申请总金额

其中,公式中的金额均不包括利息,美元金额应以该日的汇率折算为人民币后,同人民币认购金额合并计算。

投资者募集结束日认购申请确认金额=投资者募集结束日提交的有效认购申请金额×募集结束日部分确认的比例

当发生“比例确认”时,投资者认购费率按照认购申请确认金额所对应的费率计算,且认购确认金额不受募集期最低限额的限制。认购确认金额计算结果保留至小数点后2位,小数点后第3位四舍五入。最终认购申请确认的金额以本基金的注册登记机构计算并确认的结果为准。若投资者在认购期间多次认购本基金,其认购结果将按每笔有效认购申请分别予以确认。

9、投资人在首次认购本基金时,如尚未开立国泰基金管理有限公司基金账户,需按销售机构的规定,提出开立国泰基金管理有限公司基金账户和销售机构交易账户的申请。开户和认购申请可同时办理,一次性完成,但认购申请的确认须以开户确认成功为前提条件。一个投资人只能开立和使用一个基金账户,已经开立国泰基金管理有限公司基金账户的投资人可免予开户申请。

投资人不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

10、持有中国工商银行卡、中国农业银行卡、中国建设银行卡、招商银行卡等的个人投资者在本公司网站(https://etrade.gtfund.com/)与本公司达成网上交易的相关协议,接受本公司有关服务条款并办理相关手续后,即可通过本公司网上交易办理基金账户开立、本基金人民币份额的认购、本基金人民币份额的申购、本基金人民币份额的赎回、资料变更、本基金人民币份额的分红方式变更、信息查询等各项业务。有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站查询。

11、基金份额的认购采用金额认购方式。投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。若资金未全额到账则认购无效,基金管理人将认购无效的款项退回。认购费按每笔认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。在基金募集期内,对于人民币份额的认购,投资者首次单笔最低认购金额不低于人民币1000元(含认购费),追加认购单笔最低限额为人民币500元;对于美元份额的认购,投资者首次单笔最低认购金额不低于200美元(含认购费),追加认购单笔最低限额为美元100美元。对于已认购其中一个份额类别,首次认购其他份额类别的投资者,其认购适用于相应类别份额认购的首次单笔最低限额,包括已经认购了美元现钞份额再认购美元现汇份额,或已经认购了美元现汇份额再认购美元现钞份额。各销售机构对本基金最低认购金额及交易差着其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

12、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由于投资人怠于查询产生的任何损失由投资人自行承担。

13、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明,投资人欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2015年10月20日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.gtfund.com),投资人亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集相关事宜。

14、在募集期间,除本公告所列的销售机构外,如增加其他销售机构,本公司将及时公告。

15、投资人可拨打本公司客户服务电话(400-888-8688)、021-31089000或其他销售机构咨询电话了解认购事宜。

16、本基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

17、风险提示

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金的投资组合比例为:本基金投资于境外公募基金资产的比例不低于基金资产的80%,投资于基金合同界定的绝对收益型基金占非现金基金资产的比例不低于80%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个开放日基金份额净赎回申请(①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;②美元基金份额按当日汇率折算为人民币等值基金份额后同人民币基金份额合并计算)超过上一开放日基金总份额(美元基金份额按上一开放日当日汇率折算为人民币等值基金份额后同人民币基金份额合并计算)的10%时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

本基金投资于境外公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF)),基金净值会因为境外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。投资人根据所持有的基金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:本基金特有风险(投资标的风险、主动管理风险、境外证券投资限制引致的风险)、境外投资风险(境外市场风险、汇率风险、政治风险、政府管制风险、税务风险、法律风险)、开放式基金风险(利率风险、流动性风险、信用风险、操作风险、会计核算风险、交易结算风险、技术系统运行风险、通讯风险、巨额赎回风险、不可抗力风险)等。

本基金主要投资于境外绝对收益型基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益中等的品种,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资人应当认真阅读本基金“基金合同”、“招募说明书”等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过本基金管理人或其他销售机构购买和赎回基金,基金销售机构名单详见本公告。本基金人民币发售价格为人民币份额初始面值1.00元,美元发售价格为美元份额初始面值1.00美元。本基金在募集期内按1.00元/美元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资人按1.00元/美元面值购买基金份额以后,有可能面临基金份额净值跌破1.00元/美元、从而遭受损失的风险。

本基金管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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

18、关于投资人身份证更新的提示

新《中华人民共和国居民身份证法》已于2012年1月1日起开始实施。《中华人民共和国居民身份证法》第二十三条规定,依照《中华人民共和国居民身份证条例》领取的居民身份证(即第一代身份证),自2013年1月1日起停止使用。

根据《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》第二章第十九条规定:“在与客户的业务关系存续期间,金融机构应当采取持续的客户身份识别措施,关注客户及其日常经营活动、金融交易情况,及时提示客户更新资料信息。客户先前提交的身份证件或者身份证明文件已过有效期的,客户没有在合理期限内更新且没有提出合理理由的,金融机构应中止为客户办理业务。”

根据上述规定,本公司再次提醒广大客户,如果您的身份证件是第一代身份证,或者您的身份证件或者身份证明文件已过有效期,自2013年1月1日起,其将不能作为居民合法证件在本公司办理任何需要提供身份证件的业务,请及时到开立基金账户的机构办理身份证件或者身份证明文件更新手续,以免影响交易。

19、本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次募集的基本情况

(一)基金名称和基金代码

基金名称:国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金

基金简称:国泰全球绝对收益型基金优选

基金代码:国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金-人民币:001936

国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金-美元现汇:001935

国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金-美元现钞:001934

(二)基金类型

基金中基金

(三)基金运作方式

契约型开放式

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金的募集目标

本基金的最低募集金额不少于2亿元人民币或等值货币。募集资金中的美元应以募集期最后一日的汇率折算为人民币以确定募集是否达到最低募集金额要求。

(六)募集方式