国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要(2014年第一号)

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013] 189号文核准募集。 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核准, 但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。 本基金为投资于全球证券市场的债券基金,基金净值会因为所投资证券市场波动等因素

本基金为投资于全球证券市场的债券基金、基金净值会因为所投资证券中功政切寻四系产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金货资中的风险包括:高收益债信用风险、高收益债的流动性风险、交易对手风险、利率风险、债券收益率曲线变动风险、再投资风险和流动性风险、汇率及外汇管制风险、政治管制风险、法律风险、管理风险、操作风险或技术风险以及其他风险等。 本基金为债券型基金。属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于中国企业境外发行的高收益债券

收益债券。 投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。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。基金管理人提取各价值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。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,但不保证基金等更出。

金亚自经人的保证等的 1、版英信用工程联制起助原则自生和运用基金贝 1,但不体证据全定定盈利。也不保证是低股益。 本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核,本招募说明书所载内容截止日为2014年4月26日,投资组合为2014年1季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日。

一、基金名称 业境外高收益债券型证券投资基金

二、基金类型

1、基金的类别:债券型。 2、基金的运作方式:契约型开放式。 3、基金存续期间:不定期。

三、投资目标

效控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取超越业绩比较基准

四、投资范围

本基金以中国企业境外发行的债券,尤其是高收益债券为主要投资对象,辅以投资评级 债券。本基金以产自业业场介及11的债券、允款定同收益债券为工金权负利率、拥放权负产权债券。本基金投资全球证券市场的债券类金融资产不低于基金资产的80%。其中,投资于中国企业境外高收益债券的比例不低于固定收益类资产的80%。现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。高收益债券指:

(1)未达到 S&P 评级 BBB-级的债券; (2)咸未达到 Moody's 评级 Baa3 级; (3)或未经信用评级机构评级的债券。

投资评级债券是指信用评级机构对其的评级高于高收益债券评级的债券。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可

1.大类资产配置 1.大类资产配置 本基金通过深人研究全球宏观经济和区域经济环境,把握全球资本市场的变化趋势,结 合量化模型及宏观策略分析确定固定收益类资产、权益类资产、商品类资产、现金及货币市场 工具等大类资产的配置比例。本基金投资全球证券市场的债券类金融资产不低于基金资产的

本基金债券资产投资于中国企业境外高收益债券的比例不低于固定收益类资产的 80%。本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握,基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对各行业的动态跟踪、灵活运用外期策略、收益率曲线设路、信用债策略等多种投资策略。被继债券资产组合,并根据对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格变化的预测,动态的对投资组合进行调整。同时,由于高收益债券的收益率与其发行主体的基本面联系非常紧密、本基金将着重对债券发行主体进行深入的基本面研究。

本基金将基于对宏观经济政策、通货膨胀和各行业、各公司基本面的分析、预测各债券未来的收益率变化趋势,并确定相应的久期目标、合理控制收益率风险。在预期收益率整体上升时,降低组合的平均久期。在通胀预期较为 强烈的时期,提高短久期债券的配置比例,以有效应对加息预期,降低组合风险

②收益率曲线策略 在组合的久期配置确定以后,本基金将通过对收益率曲线的研究,分析和预测收益率曲 线可能发生的形状变化,采用于弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。目前,大部分中国企业境外发行的债券的久期集中在2到5年,只有少量个券的久期大于15年,因此收益率曲线的策略将主要

本基金债券资产主要投资于中国企业在境外发行的债券。因此,信用债策略是本基金固定收益资产投资的核心策略。本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素,判断当前信用债的相对投资价值、风险以及信用利差曲线的未来走势,还是这种保险的基础。 债券的配置。具体的投资策略包括:

●基本面分析 采用基本面分析,相对价值分析为主的策略。基金管理人将利用多种基本面分析指标对 企业的竞争力和债券定价水平进行详尽的考察和评价,并通过对市场变动趋势的把握,选择 适当的投资时机,进行债券组合的投资。 基本面因素主要包括企业的产品结构、市场份额、产量增长、生产成本、成本增长、利润增 长、人员素质、治理、负债、现金流、净现值等,上述因素反映了企业的杠杆化比例、盈利能力和 现金流状况。通过对此类基本面因素数据的筛选和加工,基金管理人将建构较完整的企业数 程度

基金管理人还将对企业治理结构、对债券价格有影响的潜在事件等作进一步分析。通过上述定量与定性指标分析,基金管理人将利用评分系统对个券进行综合评分,并根据评分结 果配置具有超额收益能力或潜力的优势个券,构建本基金的债券组合。

金主要依靠基金管理人的内部评级系统来对信用债的相对信用水平、违约风险及理 论信用利差进行分析。这其中包括定性评级、定量打分以及条款分析等多个不同层面。定性评级主要关注股东实力、行业风险、历史违约及或有负债等;定量打分系统主要考察发债主体的 级王安大任成水关力引业(A)66.00 大压约及30月以顷守,是重引力水流王安与等及顷王阵的脉络实力。条款分析系统王要特对看担保的长期情券。本基金将结合担保的情况,通过分析担保条款、担保主体的长期信用水平等,对债项做出综合分析。本基金将根据上述内部信用风险 分析结果,配置内部评级高于外部信用评级机构评级的债券,获取相对信用利差收益。

77时13年末,此直闪即迁级南17年间17年20049迁级时顷分,获取相对信用利至收益。 (4)可转换债券策略 可转换债券兼具股票与债券的特性。本基金也将充分利用可转换债券具有安全边际和进 攻性的双重特征,在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上,

配置溢价率低、具有一定安全边际的可转换债券进行投资。

3.股票投资策略 本基金不以股票投资作为基本投资策略。本基金不从二级市场买人股票、权证等权益类 金融工具,但本基金持有可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证,因投资于可分离交易可转债而产生的权证等原因而持有的股票和权证等资产,本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出。 4.衍生品投资策略

品的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。在进行金融行 数量化定价模型,确定其合理内在价值,从而构建避险、套利或其它适当目的交易组合,并严

六、业類に収基個 本基金的业绩比较基准为 经估值日汇率调整后的)摩根大通亚洲债券中国总收益指数

JACI China Total Return Index)。Bloomberg 代码为 JACICHTR Index"。在亚洲债券市场上,摩根大通的 JACI China Total Return Index 是唯一以中国企业债为标的的指数。且兼顾高收益债券和投资评级债券。JACI China Total Return Index 每月定期调整或份债券,其入选的标准为发行规模在 1.5 亿美元以上、剩余期限至少 1 年的债券。JACI :。 将来如有更合适的指数推出,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定

变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上 证监会备案,而无需召开基金份额持有人大会。

七、风险收益特征 从基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种, 其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金 财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合养遵循以下限制: (1) 本基金投资全球证券市场的债券类金融资产不低于基金资产的80%。其中,投资于中国企业境外高收益债券的比例不低于固定收益类资产的80%。现金或者到期日在1年以内的

2)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%。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,但在基金托管账户的存款不受此限制。

ß)本基金持有同一机构 (政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金资产 净值的 10%。 (4) 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 (5) 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

4 / 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柱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%。
6 / 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本,同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券,并假设对持有的股本权证行使转换。
6 / 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。
7 / 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。
8 / 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 8)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

9 除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得 超过基金资产净值的10%。

在基金投资行生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同 当严格遵守下列规定: ①)本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%

①所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值

终止交易; ③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。 (4) 基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

6)本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

3.证券借贷交易 本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:

①)所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机

x。 ②)应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。 6 腊方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。 且借方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。 4 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

④政府债券:

6)本基金管理人将对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任

4.证券回购交易 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易、并且应当遵守下列规定: (1)所有参与正回购交易的对手方,中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用

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

FFXXPUPIETNEYXX。 ② 廖与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已 售出证券市值的 102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益

6)买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分

4)参与逆回购交易,应当对购人证券采取市值计价制度进行调整以确保已购人证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购 6)本基金管理人将对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应

举业参与证券值员义务、证则购义务,仍有证同时内观证券证可值或仍有证值证券借贷金。 未回购证券店市值均不得超过基金总资产的50%。前现让例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计人基金总资产。基金如参与证券借贷交易、正 回购交易、逆回购交易,本基金管理人将按照规定建立适当的内控制度、操作程序和进行档案

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

3.购买贵重金属或代表贵重金属的凭证;

3.购头页里亚海域1、农贝里亚海到70元。 4.购买实物商品; 5.除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的10%; 6.利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外;

7.参与未持有基础资产的卖空交易; 8.从事证券承销业务; 9.向他人贷款或者提供担保;

10 从事承担无限责任的投资

11.向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人、境外托管人发 12.买卖与其基金管理人、基金托管人、境外托管人有控股关系的股东或者与其基金管理

12.头头与具基亚管理人、基亚仁官人、境外代官人有径股大东的政东或有与具基亚管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
13.从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
14.依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
(三)若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在履行适当程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(四)投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同 定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投

资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在30个交易日内进行调整。法律

(六) 基金的融资 为了应付赎回、交易清算等临时用途,可以借人现金。该临时用途借人现金的比例不得 超过本基金资产净值的 10%。 此外,本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易进行融资。

也 八速坟票 1、基金管理人行使代理投票权应遵循基金份额持有人利益最大化的原则。 2.行使代理投票权应考虑不同地区市场上适用的法律或监管要求、公司治理标准、披露 实务操作等存在的差异,充分研究提案的合理性,并综合考虑投资顾问,独立第三方研究机场 等的意见后,选择合适的方式行使投票权。本着基金投资者利益最大化的原则,对特股化例较 小或审议非重要事项、支付较高费用等情况时,基金管理人可以选择不参与上市公司的投票。 3.代理投票权的执行,可选择实地投票、通过交易经纪商系统投票、委托境外投资顾问、 托管人或第三方代理投票机构投票等方式。 4.基金管理人应保留投票记录。

1、基金管理人挑选证券经纪商主要考虑的因素包括:交易执行能力、研究报告质量、提供

质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有:是否完成交易、成交的及时性、成交价格、

2 耐光报告市顷重。土要是指奔商能合提供局质重的宏观经济时先,行业时先及市场定向、个股分析报告和专题研究报告,报告内容是否详实、投资建议是否推确等; 6 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面; 4 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训。 6 价值贡献。主要是指证券经纪商对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务,对公司投资提升所作出的贡献; 4 时间用案、主要是证券经纪商对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务,对公司投资提升所作出的贡献;

6)其他因素。主要是证券经纪商的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无

基金管理人主要根据对证券经纪商的评价结果进行交易量分配。评价证券经纪商将重点

依据其交易执行能力,研究报告质量、提供研究服务质量、法规监管资讯服务和价值贡献等方面的指标,并采用十分制进行评分。 评分的计算公式是: 2i(第 i 项评价项目×项目权重),其中各项目权重由基金管理人根据相

关法规要求和内部制度进行确定。 本基金管理人将根据有关规定,在基金定期报告中对所选择的证券经纪商、基金通过该证券经纪商买卖证券的成交量以及所支付的佣金等进行披露。对于在证券经纪商选择和交易量分配中存在或潜在的利益冲突,管理人应该本着尽可能维护持有人的利益进行妥善处理,

八、基金投资组合报告

八、基金及沒沒自己報告
 本基金管理人的董事会及董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。
 基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17日复核 了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容、保证复核内容不存在虚假记载、误 是地数法或求查者上海贯。

本投资组合报告所载数据截止2014年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。

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	-	-
3	固定收益投资	185,681,611.75	81.19
	其中:债券	185,681,611.75	81.19
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买人返售金融资产	10,000,135.00	4.37
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,809,302.66	11.29
8	其他各项资产	7,196,223.84	3.15

2.报告期末在各个国家 他区 证券市场的股票及存托凭证投资分布本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。 3.报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

4、期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投

;=== 本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。 5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

BBB+至 BBB-		-		_		
BB+至 BB−		108,977,770.34		48.87		
B+至 B−		76,703,841.41		34.40		
注:上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪等国际权威机构评级。 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细						
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)	
1	XS0620341064	GZRFPR 10 7/8 04/29/ 16	12,304,200	13,188,010.69	5.91	

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)	
1	XS0620341064	GZRFPR 10 7/8 04/29/ 16	12,304,200	13,188,010.69	5.91	
2	USG3225AAA19	EVERRE 13 01/27/15	12,304,200	12,909,935.77	5.79	
3	XS0756437132	AGILE 9 7/8 03/20/17	12,304,200	12,895,662.89	5.78	
4	USG9844KAA72	YINGDZ 8 1/8 04/22/18	11,688,990	11,748,019.40	5.27	
5	XS0828366756	KAISAG 12 7/8 09/18/ 17	9,228,150	10,309,135.49	4.62	
注:(1)债券代码为 ISIN 码。						

2 放直列小顺乔间值,介印按照期本门直租产年70人式门。 7.报告期末按公介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报告期末未持有资产支持证券。 8.报告期末按公介价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细本基金本报告期末末持有金融衍生品。 9.报告期末按公介价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末共持有基金。 10.投资组合报告附注 0 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编

2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,888,368.25
3	应收股利	-
4	应收利息	4,306,863.53
5	应收申购款	992.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,196,223.84

4)报告期末持有的外干转股期的可转换债券明约 4 加台別於日本的人了不過數學的學學的 本基金本报告期未未持有处于转股期的可转換债券。 6 服告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末未持有股票。

九、基金的业绩 基金业绩截止日为2013年12月31日。 基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不证 一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,

设备在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。						
阶段	净值增长 率①		业绩比较基准收 益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	1)-3)	2-4
2013年4月26日至2013年 12月31日	1.60%	0.19%	-3.33%	0.41%	4.93%	-0.22%
注:同期业绩比较基准以人民币计价。						

2013年4月26日为基金合同生效日。

1、巻車 日本 (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:1996年3月3日 法定代表人:陈勇胜 注册资本:壹亿壹千万元人民币

联系电话:021-31089000,4008888688

股本结构:

截至2014年4月26日,本基金1955年1950 截至2014年4月26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44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。 这)、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 日券投资基金、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 证券仅页基壶、国季壶酮品寿切旧化百型证券投页基壶、国季壶期们且帽型纯店至型证券投资 基金 伯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 伯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(OF)伯 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(OF)上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰一证 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 整证券投资基金 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 整证券投资基金 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 型证券投资基金、国家信用互利分级同寿望证券投资基金、中小核 300 成长交易型开放人工 教证券投资基金、国家中小核 300 成长交易型开放大工精效证券投资基金联赛基金。国家成长 优选股票型证券投资基金、国家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、国泰自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 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、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金、国泰联创债券型证券投资基金、国泰联益灵活配置混合型证券投资基金、区分、国泰国管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。另外、本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理等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、传户理财、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空牌照"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。

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. 重事宏成贝 陈勇胜,董事长,硕士研究生,高级经济师,21 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。历任综合计划收、资金处副处长、国际结算部副总经理 住持 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、党

委书记。 庄乾志、董事,博士研究生,高级经济师。1999年8月至2004年12月在中国建设银行总 行工作,历任建设银行总行投资银行部副经理、机构业务部高级经理。2005年1月至2007年7月在中国建银投资有限责任公司任投行部副总兼证券公司重组办公室主任。2007年8月至2009年2月在西南证券有限责任公司任董中资委委员及副总裁。2009年2月起中国建银投资有限责任公司工作,先后任资本市场部负责人、战略部负责人,现任中国建银投资有限责

A 历任研究员基金经理。2009-2013 年任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 权益部总。 2013 年 6 月起任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 总经理。2013 年 11 月起任公司董 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 研一次, 重事, 人子华村, 英国村厅怀险子云南级云页 \$\text{Cll \(\mathcal{D}\mathcal{E}\mathcal{P}\mathcal{E}\m

有限公司工作,历任圣理部项目各理,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 副论经理。2012 年 4 月起任公司董事。 金旭,董事,硕士研究生。20 年证券从业经历。1993 年 7 月至 2001 年 11 月在中国证监会 工作,历任法规处副处长,深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。200 年 11 月至 2004 年 7 月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004 年 7 月至 2006 年 1 月在 宝盘基金管理有限公司任总经理。2006 年 1 月至 2007 年 5 月在梅隆全球投资有限公司北京 代表处任首席代表。2007 年 5 月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007 年 11 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、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多理事、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等职。2010年6月起任公司独立董事。

公司独立董事。 刘秉升,独立董事,大学学历,高级经济师。1980 年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记; 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;1995 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所长。2010 年 11 月起任公司独立董事。 2.监事会成员

唐建光,监事会主席,大学本科,高级工程师。 1982 年 1 月至 1988 年 10 月在煤炭工业 部基建司任工程师;1988年10月至1993年7月在中国绕配煤矿总公司基建局任副处长; 1993年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长;1995年9月至 1998年10月在煤炭部基建管理中心工作,先后任综合处处长,中心副主任;1998年10月至 2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理;2005年1月起在中国建银投资有限责

Nikhil Sriniyasan 监事 硕士研究生。先后在 Allianz SE Singapore Allianz SE Munich Nikhil Srinivasan, 监事,硕士研究生。先后在 Allianz SE Singapore, Allianz SE Munich LF,并曾任 Allianz SE Munich 首席投资官。2013年2月加入意大利忠利集团,担任首席投资官。2013年11月起任公司监事。 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 至经济学院工作,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

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月任职于海康人寿保险有限公司,2005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月为州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

3.向级官里公贝 陈勇胜,董事长、简历情况见董事会成员介绍。 金旭,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 月加入国秦基金管理有限公司,2008 年 12 日末妇在公司副总经理

日起担任公司副总经理。
周向勇,硕士研究生,17 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月在2011年1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月在中国建设银行总行工作,先后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。
李志坚,硕士研究生,22 年金融业从业经历。1992年2月至1994年12月在美国花旗银行合北分行工作,任财务企划助理;1995年1月至2000年12月在合湾大华证券公司工作,负责投资业务;2004年1月月至2006年9月在台湾景顺投信股份有限公司工作,负责投资业务;2004年4月在美国组约人寿合湾子公司工作,任政资长。2010年5月至2011年1月至2004年9月在台湾导城投信股份有限公司工作,负责投资业务;2006年6月至2010年4月在美国组约人寿合湾子公司工作,任政资长。2010年5月至2012年12月在台湾富邦投信股份有限公司工作,任投资长;2013年1月起加入国泰基金管理有限公司,任全球投资总监、2013年6月起任公司副总经理。
被燕游、硕士、16年证券业从业经历。1998年2月至2007年8月至2013年8月至2013年8月历任光大证券股份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总经理,2015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。

① 地比基金经理 吴向军,硕士研究生,10 年证券基金从业经历。2004年6月至2007年6月在美国 Avera Global Partners 工作,担任股票分析师;2007年6月至2011年4月在美国 Security Global Investors 工作,担任高级分析师。2011年5月起加盟国泰基金管理有限公司,2013年4月起任 国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金的基金经理,2013年8月起兼任国泰美国房地 2月14日 产开发股票型证券投资基金基的基金经理

本基金成立以来一直由吴向军担任基金经理,无基金经理更换事项。 古本基金投资决策委员会成员 5.本基金投资决策委员会成员 投资事业部等),权益投资事集委员会,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等),权益投资事业部等等,量化投资事业部等等,为员力员中产生。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

台灣及於大學及名式的。公司及於大學以名工學小兒在歌店中人名德巴基並目前,中以 井决策公司投资研究部,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

黄焱先生: 总经理助理兼投资总监兼权益投资 傳业)部 (筹)总经理

乔巍先生:总经理助理兼绝对收益投资 傳业 廍 第 总经理

十一、基金的费用与税收

1.基金官理人的官理政; 2.基金托管人的托管费,含境外托管人收取的费用; 3.因基金的开户、证券交易、证券清算交收、证券登记存管而产生的各项费用; 4.基金合同生效以后的信息披露费用; 5.基金份额持有人大会费用; 6.基金台同生效以后的会计师费和律师费; 7.基金的资金汇划费用;

7.基金的资金汇到费用; 8.外汇兑换交易的相关费用; 9.与基金财产缴纳税收有关的手续费、汇款费等; 10.代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用; 11.按照国家有关规定可以列入的其他费用。 C. 连级国家有关规定可以列入的其他费用。 C. 连级国家有关规定可以对入的其他费用。 C. 基金管理人的管理费 基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.1%年费率计提。 无通偿继见。其个签定单位的 1.1%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.1%年费率计提。计算方法如下: H=EX1.1%+当年天数 H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值

E 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。 2.基金托管人的托管费 基金托管人的基金托管费 如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务费)

按基金资产净值的 0.28%年费率计提。 在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.28%年费率计提。计算方法如下: H=Ex0.28%+当年天数

H-Ex0.28%-- 当牛大数 H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。 3.本条第 (一)款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协

议的规定,列入或难入当期基金费用。 (三) 不列入基金费用的项目 本条第 一 嚴約实定以外的其他费用,基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义 冬导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列人

基並政用。 四)基金费用调整 基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人最迟于新的费率实施日前2日在中国证监会指定媒体上予以公告,

伍 脱收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义 十二、基金托管人

(一)基金托管人概况 名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

名称: 中国从业域门及以为18公司、1937年 住所: 北京市东城区建国门内大街 69号 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28号凯晨世贸中心东座 9层

办公地址:北京市四地及复兴] 內大街 28 亏刮晨世资中心办法定代表人;养超良成立日期;2009年1月15日注册资本;32,479,411.7万元人民币批准设立机关和设立文号:中国银监会银监复 [2009]13号存续期间:持续经营基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号 歷至由迁,610,6320[510

内需增长或号股票型证券投资基金。交银施罗德成长股票证券投资基金、长愿中址 100 箱数 证券投资基金。秦达宏利首选企业股票型证券投资基金。东吴价值成长双动力股票型证券投资基金。解华动力增长混合型证券投资基金。富盈策略增长股票型证券投资基金。国泰金牛创新成长股票型证券投资基金。益民创新优势混合型证券投资基金。中邮核心成长股票型证券投资基金。经信双利优选灵活配置混合型证券投资基金。富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金。由 5 巴黎竞争优势股票型证券投资基金。第"年优选成长股票型证券投资基金。在惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金。养作优选成长股票型证券投资基金。金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、大信稳健双盈债券型证券投资基金。金元惠理成长动力型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施 %则以予至证分区及基础。十之党的同时学星及民代证为区员基础。並允め生活的体本院自呈生养投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。招商政情增强分级债券型证券投资基金、投资基金、最低价值增强分级债券债券型证券投资基金、融值标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎债指数增强型证券投资基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富专市国企业境分级基金、第一年发展,

办公地址:270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070

办公地址:270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070 法定代表人:James Dimon 成立时间:1799 年 实收资本 截止 2013 年 12 月末):1,785 百万美元 托管资产规模 截止 2013 年 年末):2.0.5 万亿美元 信用等级 穩迪市學 Aa3 高級信用债券) 作为全球领先的金融服务公司,摩根大通拥有 2.1 万亿美元资产,在超过 60 个国家经营。在投资银行业务,消费者金融服务、小企业和商业银行业务、金融交易处理、资产管理和私募股权投资基金等方面。摩根大通均为业界领导者。 摩根大通自 1946 年开始为其美国客户提供托管服务。之后为响应客户投资海外的要求,该公司在 1974 年率先开展了一种综合性的服务率先全球托管。此后,摩根大通继续扩展服务,以满足不断变化的客户需要。通过提供优质服务和创新的产品,摩根大通始终保持其领先地位。