国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2015年4月7日
公告日期:2015年4月1日

一、重要声明与提示

《国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)上市交易公告书》(以下简称"本公告书")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对国泰大宗商品配置证券投资基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资人详细查阅刊登在2012年3月21日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站(www.gtfund.com)上公告的《国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)
2、基金简称:国泰商品
3、基金场内简称:国泰商品
4、基金代码:160216
5、基金类型:LOF
8、基金份额总额:
截至2015年3月30日,本基金的份额总额为492,827,858.92份
9、基金份额净值:
截至2015年3月30日,国泰商品份额的基金份额净值为0.630元
10、本次上市交易份额:398,800,917份
11、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
12、上市交易日期:2015年4月7日
13、基金管理人:国泰基金管理有限公司
14、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
15、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、本基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会,2011年7月14日证监许可【2011】1094号
2、基金合同生效日:2012年5月3日
3、基金运作方式:契约型开放式
4、基金合同期限:不定期
5、发售日期:2012年3月26日至2012年4月25日
6、发售价格:1.00元人民币
7、发售方式:本基金通过场内、场外两种方式公开发售
8、发售机构
(1)场内发售机构
本基金场内销售机构为深圳证券交易所内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会员单位,具体名单以深圳证券交易所网站披露为准。
(2)场外发售机构
1)直销机构:国泰基金管理有限公司。
2)代销机构:
中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、洛阳银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、万联证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、长城国瑞证券有限公司、华宝证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、华福证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、信达证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、广州证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司等。
9、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
10、认购资金总额及入账情况
本次募集的净认购金额为309,147,715.70元人民币,折合基金份额309,147,715.70份;认购资金在募集期间产生的银行利息共计144,210.93元人民币,折合基金份额144,210.93份,已分别计入各基金份额持有人的基金账户,归各基金份额持有人所有。上述资金总额已于2012年5月3日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。
11、基金备案情况
本基金于2012年5月3日验资完毕,2012年5月3日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2012年5月3日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日:2012年5月3日。
13、基金合同生效日的基金份额总额:309,291,926.63份
(二)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上【2015】118号
2、上市交易日期:2015年4月7日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资人在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金场内简称:国泰商品
5、交易代码:160216
6、本次上市交易份额:398,800,917份
7、未上市交易份额的流通规定:
未上市交易的托管在场外的国泰大宗商品份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其转托管至深圳政券交易所场内后即可上市流通。
(三)本基金转托管的主要内容
为了保证基金份额持有人的利益,本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请,为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数
截至2015年3月30日,本基金份额持有人户数为4,211户,平均每户持有的基金份额为117,033.45份。场内基金份额持有人户数为2,084户,平均每户持有的基金份额为191,363.20份。
(二)持有人结构
截至2015年3月30日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的基金份额为26,868,263份,占基金总份额的5.45%;个人投资者持有的基金份额为465,959,595.92份,占基金总份额的94.55%。其中,场内机构投资者持有的基金份额为26,868,263份,占基金总份额的5.45%;个人投资者持有的基金份额为371,932,654份,占场内基金总份额的93.26%。
(三)场内前十名基金份额持有人情况
截至2015年3月30日,场内前十名基金份额持有人情况如下表。

截止日期:2015年3月30日

序号	持有人名称(全称)	持有份额	占场内基金份额的比例(%)
1	招商证券投资有限公司	14,879,464.00	3.73%
2	中信信托有限责任公司-中信聚益之稳意进取管理型风险缓冲金融投资集合资金信托计划	11,027,941.00	2.77%
3	周永良	10,330,882.00	2.59%
4	林海平	8,940,387.00	2.24%
5	韩琳	7,373,156.00	1.85%
6	傅林萍	7,351,470.00	1.84%
7	彭泽勇	4,435,102.00	1.11%
8	朴彩瑛	3,663,454.00	0.92%
9	蒋一科	3,559,757.00	0.89%
10	裘丰	3,537,819.00	0.89%
合计		75,099,432.00	18.83%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、基本信息
名称:国泰基金管理有限公司
设立日期:1998年3月5日
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
法定代表人:陈勇胜
总经理:陈勇胜
注册资本:壹亿壹千万元人民币
设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]5号
工商登记注册的法人营业执照文号:310000000060090
经营范围:基金设立、基金业务管理,及中国证监会批准的其他业务
联系人:何晔
联系电话:021-31089000,400-888-8688
股东及出资比例

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%

2、内部组织结构及职能
公司建立并完善了科学的治理结构,目前有独立董事3名。董事会下设提名及资格审查委员会、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;
在组织结构方面,公司设立的分管领导议事会议、总经理办公会议、投资决策委员会、风险控制委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。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;
公司一贯坚持诚信为投资人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;
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。
3、人员情况
截至2015年2月28日,公司正式员工252人,其中53%(134人)的员工具有硕士以上学历。
4、信息披露负责人:林海中
咨询电话:400-888-8688
5、基金管理业务情况
截至2015年2月28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、国泰信值优势股票型证券投资基金(LOF)(由国泰信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、国泰创利债券型证券投资基金(由国泰6个月短期理财债券型证券投资基金转型而来)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)。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。
6、本基金基金经理
邱晓华,硕士研究生,曾任职于新华通讯社、北京首都国际投资管理有限公司、银河证券。2007年4月加入国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理。2011年4月至2014年6月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理;2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理;2013年8月起兼任国泰科技证券保本混合型证券投资基金基金的基金经理;2014年5月起兼任国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金的基金经理;2014年11月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理。
白海峰,中国改革发展研究院金融学在职博士,哥伦比亚大学商学院MBA,北京大学理学硕士,北京大学经济学,理学双学士,曾就职于纽约太平洋资产管理公司(NYPC),任高级投资经理,2010年加盟国泰基金,历任首席宏观经济学家助理,宏观经济研究员,国际业务部负责人,2015年1月起任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
批准设立机关和批准设立文号:中国银行业监督管理委员会银监复【2004】43号
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】12号
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
联系电话:010-67595096
传真:010-66275830
联系人:田青
中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,886股H股及9,593,657,606股A股)。
2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。
截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。
截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加921万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。
截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大;自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。
2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在美国《银行家》杂志2014年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。
中国建设银行总行设投资托管业务部、下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。
2、主要人员情况
赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
3、基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行";获和讯网的中国"最佳资产托管银行"奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的"最佳基金托管银行"奖;中央国债登记结算有限责任公司的"优秀托管机构"奖。
(三)境外托管人
1、基本情况
名称:道富银行 State Street Bank and Trust Company
注册地址:One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
办公地址:One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States
法定代表人:Joseph L. Hooley
成立时间:1891年4月13日
截止到2013年12月31日的所有者权益(Shareholder's Equity):203.8亿美元
2、托管资产规模、国际信用评级和托管业务
道富银行的全球托管业务由美国道富集团公司全资拥有。道富银行始创于1891年并于1924年成为美国第一个共同基金的托管人。道富银行现已成为一家具有领导地位的国际托管银行。截至2013年12月31日,托管和管理资产总额已达到27.4万亿美元,一级资本比率为17.3%。道富银行长期存款信用评级为AA-(标准普尔)及Aa3(穆迪投资)。道富银行在全球29个国家或地区设有办事处,2013年12月31日道富银行超过2万9千多名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务,包括全球托管、基金会计、绩效评估、投资纲领监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。
3、境外托管人的职责
1)安全保管受托财产;
2)计算境外受托资产的资产净值;
3)按照相关合同的约定,及时办理受托资产的清算、交割事宜;
4)按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定,开设受托资产的资金账户以及证券账户;
5)按照相关合同的约定,提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息;
6)保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料;
7)其他由基金托管人委托其履行的职责。
(四)基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
经办注册会计师:汪棣、魏佳亮
联系人:魏佳亮

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要请见附件。

七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
国泰大宗商品配置证券投资基金2015年3月30日资产负债表(未经审计)如下:

国泰大宗商品配置证券投资基金
2015年3月30日资产负债表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资产	本期末2015年3月30日
资产:	
银行存款	122,075,453.77
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	196,889,700.62
其中:股票投资	-
基金投资	196,889,700.62
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	20,805.74
应收股利	-
应收申购款	656,727.58
其他资产	-
资产总计	319,642,687.71
负债与持有人权益	-
负债:	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	9,374,942.85
应付管理人报酬	346,792.63
应付托管费	80,918.29
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	-
其他负债	144,165.25
负债合计	9,946,819.02
所有者权益:	-
实收基金	491,677,238.58
未分配利润	-181,981,369.89
所有者权益合计	309,695,868.69
负债和所有者权益总计	319,642,687.71

注:报告截止日2015年3月30日,国泰大宗商品份额净值0.630元;基金份额总额491,677,238.58份。

八、基金投资组合

截至2015年3月30日国泰大宗商品配置证券投资基金的投资组合如下:
1、基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	196,889,700.62	61.60
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	122,075,453.77	38.19
7	其他各项资产	677,533.32	0.21
8	合计	319,642,687.71	100.00

2、按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期未持有股票投资。
3、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
本基金本报告期未未持有股票投资。
4、按券种分类的债券投资组合
本基金本报告期未未持有债券投资。
5、按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细:
本基金本报告期未未持有债券投资。
6、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:
本基金本报告期未未持有资产支持证券。
7、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF基金	开放式	US Commodity Funds LLC	47,608,040.70	15.37
2	PROSHARES ULTRA BLOOMBERG CRUDE OIL	ETF基金	开放式	ProShares	47,215,681.92	15.25
3	UNITED STATES BRENT OIL FUND	ETF基金	开放式	US Commodity Funds LLC	41,124,603.52	13.28
4	POWERSHARES DB OIL FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services	40,511,001.05	13.08
5	UNITED STATES 12 MONTH OIL FUND LP	ETF基金	开放式	US Commodity Funds LLC	20,335,065.24	6.57
6	POWERSHARES DB PRECIOUS METALS FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services	22,724.88	0.01
7	POWERSHARES DB AGRICULTURE FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services	13,717.21	0.00
8	ISHARES S&P GSCI COMMODITY INDEX FUND	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisor	12,120.75	0.00
9	POWERSHARES DB COMMODITY INDEX FUND	ETF基金	开放式	DB Commodity Services	10,604.13	0.00
10	ISHARES SILVER TRUST	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisor	9,812.04	0.00

8、投资组合报告附注
(1)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制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
(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。
(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	20,805.74
5	应收申购款	656,727.58
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	677,533.32

(4)截至2015年3月30日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
(5)截至2015年3月30日,本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

本基金以下信息披露事项均已通过指定报刊以及基金管理人网站(www.gtfund.com)进行公开披露,并已报送相关监管部门备案。

序号	公告日期	公告名称	报纸
1	2012/5/4	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
2	2012/6/1	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
3	2012/6/1	国泰基金管理有限公司关于增加国泰大宗商品配置证券投资基金参加各渠道网上银行、基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
4	2012/6/28	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
5	2012/7/9	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加众禄基金网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
6	2012/7/9	关于新增众禄基金代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
7	2012/7/13	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加数米基金网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
8	2012/7/13	关于新增数米基金网代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
9	2012/7/13	国泰基金管理有限公司关于开通银联支付浦发银行、中信银行、光大银行等3家银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
10	2012/8/9	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
11	2012/8/9	关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
12	2012/8/16	国泰基金管理有限公司关于开通通联支付中国农业银行借记卡、中国建设银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
13	2012/8/18	关于新增好买基金代理销售国泰基金旗下部分基金并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
14	2012/8/22	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
15	2012/8/22	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》
16	2012/8/29	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
17	2012/9/6	国泰基金管理有限公司关于调整旗下基金在众禄基金定期定额投资起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
18	2012/9/6	国泰基金管理有限公司关于开展公司网上交易定期定额赎回业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
19	2012/9/14	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加浙商证券有限责任公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
20	2012/9/14	关于新增西南证券股份有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
21	2012/9/14	关于新增新时代证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
22	2012/9/14	关于新增浙商证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
23	2012/9/14	关于新增中银国际证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
24	2012/10/16	国泰基金管理有限公司关于在国海证券开通旗下基金定期定额投资计划及参加定投网上交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
25	2012/10/18	国泰基金管理有限公司关于开通通联支付交通银行、邮储银行等四家银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
26	2012/10/30	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)临时暂停申购赎回等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
27	2012/10/31	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)临时暂停申购赎回等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
28	2012/11/13	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
29	2012/11/19	国泰基金管理有限公司关于开通银联支付广发银行、浙商银行、温州银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
30	2012/11/20	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
31	2012/11/28	国泰基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加中国银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
32	2012/11/29	关于新增国都证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
33	2012/12/5	国泰基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户直销网上交易业务并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
34	2012/12/11	国泰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
35	2012/12/19	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
36	2012/12/26	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
37	2012/12/31	国泰基金管理有限公司关于继续参加中信建投证券基金定期定额业务网上申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
38	2013/1/16	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
39	2013/1/25	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加上海天天基金销售有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
40	2013/1/25	关于新增上海天天基金销售有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
41	2013/2/6	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
42	2013/3/6	国泰基金管理有限公司副总经理离任公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
43	2013/3/26	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
44	2013/4/1	国泰基金管理有限公司关于开通通联支付工商银行、中国银行和民生银行借记卡网上基金