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(2015 年第一号)

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[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。本基金投资中的风险包括: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。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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 2015 年 4 月 26 日,投资组合为 2015 年 1 季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 12 月 31 日。

一、基金名称

国泰中国企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

在有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的投资收益。

四、投资范围

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括债券、基金(包括 ETF)、资产支持证券、货币市场工具、结构性投资产品、信用违约互换(CDS)等金融衍生品以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金不从二级市场买入股票、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。

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)或未达到 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,可以将其纳入投资范围。

五、投资策略

1.大类资产配置

本基金通过深入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 80%。

2.债券投资策略

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,灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略等多种投资策略,构建债券资产组合,并根据对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化的预测,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。

(1)久期策略

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;在预期收益率整体下降时,提高组合的平均久期。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,采用子弹型策略、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运用于中短期债券。

(3)信用债策略

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,确定信用债券的配置。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务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据库。

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。

●信用风险分析

本基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财务实力。条款分析主要针对有担保的长期债券,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。

(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入股票、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

本基金在金融衍生品的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。在进行金融衍生品投资时,将在对这些金融衍生品对应的标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合数量化定价模型,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,并严格监控这些金融衍生品的风险。

六、业绩比较基准

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 每月定期调整成份债券,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 China Total Return Index 对本基金的投资具有重要的参考价值,适合作为本基金的业绩比较基准。

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公告并报中国证监会备案,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。

(一)投资限制

1.组合限制

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。基金的投资组合将遵循以下限制:

(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 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

(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。

(3)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%。

(5)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 20%。

(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%。

2. 金融衍生品投资

本基金投资衍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,同时应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%。

(2)本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(3)本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

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评级机构评级;

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。

(5)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构评级。

(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%。

(3)借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。一旦借方违约,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:

①现金;

②存款证明;

③商业票据;

④政府债券;

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5)本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(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评级机构信用评级。

(2)参与正回购交易,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以满足索赔需要。

(3)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、利息和分红。

(4)参与逆回购交易,应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入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入证券以满足索赔需要。

(5)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责任。

基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。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管理。

(二)禁止行为

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:

1.购买不动产;

2.购买房地产抵押按揭;

3.购买贵重金属或代表贵重金属的凭证;

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、境外托管人发行的股票或者债券;

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的约定。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。法律法规另有规定时,从其规定。

(五)基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东和债权人权利,保护基金投资者的利益;

2.有利于基金财产的安全与增值。

(六)基金的融资

为了应付赎回、交易清算等临时用途,可以借入现金。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%。

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。

(七)代理投票

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、独立第三方研究机构等的意见后,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,对持股比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。

(八)证券交易管理

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、提供研究服务质量、法规监管资讯服务以及价值贡献等方面。

(1)交易执行能力。主要指券商是否能够对投资指令进行有效的执行,以及能否取得较高质量的成交结果。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、对市场的影响等;

(2)研究报告的质量。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告,报告内容是否详实,投资建议是否准确等;

(3)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;

(5)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;

(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、近年内有无重大违规行为等。

2、席位交易量的分配依据

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:Σi(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。

3、其他事项

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,并按规定进行报告。

八、基金投资组合报告

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 2015 年 4 月 15 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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2015 年 3 月 31 日,本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

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	21,762,987.76	76.91
	其中:债券	21,762,987.76	76.91
	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	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,958,727.16	21.06
8	其他各项资产	575,279.06	2.03
9	合计	28,296,993.98	100.00

2、报告期末在各个国家(地区)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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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资明细

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

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
AA+至 AA-	-	-
BBB+至 BBB-	-	-
BB+至 BB-	9,044,856.31	36.74
B+至 B-	12,718,131.45	51.65

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	XS0883317884	GRNCH 8 1/2 02/04/18	1,842,660	1,898,124.07	7.71
2	USG2116MAA92	SHASHU 8 1/2 05/25/16	1,842,660	1,887,602.48	7.67
3	XS0875312364	XINHD 6 1/4 01/29/18	1,842,660	1,874,040.50	7.61
4	USG2115XAA66	CHIOIL 5 1/4 04/25/18	1,842,660	1,845,866.23	7.50
5	USG9844KAA72	YINGDZ 8 1/8 04/22/18	1,842,660	1,634,936.94	6.64

注:(1)债券代码为 ISIN 码。

(2)数量列示债券面值,外币按照期末估值汇率折为人民币。

7、报告期末按公允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、报告期末按公允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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、报告期末按公允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

本基金本报告期末未持有基金。

10、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(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	574,572.60
5	应收申购款	706.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	575,279.06

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报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 2014 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

基金一定盈利,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,投资者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	净值增长率标准差②	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%
2014年度	1.08%	0.25%	7.85%	0.17%	-6.77%	0.08%
2013年 4 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日	2.70%	0.23%	4.25%	0.29%	-1.55%	-0.06%

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。

十、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:壹亿壹千万元人民币

联系人:何 晔

联系电话:021-31089000,4008888688

股本结构:

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 2015 年 4 月 26 日,本基金管理人共管理 52 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)、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉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,23 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。

张瑞兵,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,资本市场部助理投资经理,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。2014 年 5 月起任公司董事。

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 年任 URWICK CAPITAL LLP 合伙人;2005-2006 年在 CREDIT SUISSE 任副总裁;2006-2008 年在 EURIZONCAPITAL SGR SpA 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。

侯文捷,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等职。2010 年 6 月起任公司独立董事。

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所长。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 任公司秘书及法务。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 法律及合规部主管。2008 年 8 月至 2014 年 3 月任 Allianz Global Investors Singapore Limited 东南亚及南亚合规部主管。2014 年 3 月 17 日起任 Generall Investments Asia Limited 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,营业管理部主任助理,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 月任职于上海明诚投资咨询公司,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,22 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,17 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.本基金基金经理

(1)现任基金经理

吴向军, 硕士研究生,11 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产开发股票型证券投资基金的基金经理。

(2)历任基金经理

自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。

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:副总经理

黄焱:总经理助理兼投资总监兼权益投资(事业)部总经理

吴晨:绝对收益投资(事业)部总监助理

张则斌:权益投资总监

6.上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

十一、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

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.基金合同生效以后的会计师费和律师费;

7.基金的资金汇划费用;

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。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.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。

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=E×1.1%÷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

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=E×0.28%÷当年天数

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,列入或摊入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务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入基金费用。

(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,并报中国证监会备案。

(五)税收

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务。

十二、 基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

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

法定代表人:刘士余

成立日期:2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本:32,479,411.7 万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设, 品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届"'金牌理财'TOP10 颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004 年 9 月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止 2015 年 3 月 31 日, 中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 254 只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰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、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰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、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝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、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长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、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华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、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、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、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、(下转 B95 版)

国泰基金管理有限公司
调整长期停牌股票估值方法的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会[2008]38 号公告)以及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)的原则和有关要求,国泰基金管理有限公司(以下简称"本公司")与托管银行商定,决定对本公司旗下基金持有的"中孚实业"(证券代码:600595)股票进行估值调整,自 2015 年 6 月 5 日起按指数收益法进行估值。

待该股票的交易体现出活跃市场交易特征后,将恢复为采用当日收盘价格进行估值,届时将不再另行公告。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
2015 年 6 月 9 日

关于新增华鑫证券销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划、转换业务及开展申购(含定投)费率优惠活动的公告

国泰基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")已与华鑫证券有限责任公司(以下简称"华鑫证券")签订了以下基金销售协议。经双方协商一致,上述渠道自 2015 年 6 月 10 日起销售本公司管理的以下基金并开通定期定额投资计划、基金转换业务及同时开展申购及定期定额投资费率优惠活动。投资人可通过华鑫证券的营业网点办理基金开户、申购、赎回等业务。具体公告如下:

一、华鑫证券销售基金业务范围:

基金代码	基金名称	定投下限(元)	转换业务
000103	国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金	100	不开通
000193	国泰美国房地产开发股票型证券投资基金	100	不开通
000199	国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金	-	开通
000302	国泰淘金互联网债券型证券投资基金	100	不开通
000362	国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金 A 类	100	开通
000363	国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金 C 类	100	开通
000367	国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金	100	开通
000511	*国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金	100	开通
000512	*国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金	100	开通
000526	*国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金	100	开通
000742	国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金	100	开通
000953	*国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金 A 类	100	开通
000954	*国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金 C 类	100	开通
001265	**国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金	-	-
020001	国泰金鹰增长证券投资基金	100	开通
020002	国泰金龙债券证券投资基金 A 类	100	开通
020012	国泰金龙债券证券投资基金 C 类	100	开通
020003	国泰金龙行业精选证券投资基金	100	开通
020005	国泰金马稳健回报证券投资基金	100	开通
020007	国泰货币市场证券投资基金	100	开通
020009	国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金	100	开通
020010	国泰金牛创新成长股票型证券投资基金	100	开通
020011	国泰沪深 300 指数证券投资基金	100	开通
020015	国泰区位优势股票型证券投资基金	100	开通
020018	国泰金鹿保本增值混合证券投资基金	-	开通
020019	国泰双利债券证券投资基金 A 类	100	开通
020020	国泰双利债券证券投资基金 C 类	100	开通
020021	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	100	开通
020022	国泰保本混合型证券投资基金	-	开通
020023	国泰事件驱动策略股票型证券投资基金	100	开通
020025	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	100	开通
020026	国泰成长优选股票型证券投资基金	100	开通
020027	国泰信用债券型证券投资基金 A 类	100	开通
020028	国泰信用债券型证券投资基金 C 类	100	开通
020029	国泰创利债券型证券投资基金	-	-
020031	国泰现金管理货币市场基金 A 类	100	开通
020032	国泰现金管理货币市场基金 B 类	100	开通
020033	国泰民安增利债券型发起式证券投资基金 A 类	100	开通
020034	国泰民安增利债券型发起式证券投资基金 C 类	100	开通
020035	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 A 类	100	开通
020036	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 C 类	100	开通
160211	国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)	100	不开通
160212	国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)	100	不开通
160213	国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金	100	不开通
160215	国泰价值经典股票型证券投资基金(LOF)	100	不开通
160216	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)	100	不开通
160217	国泰信用互利分级债券型证券投资基金	100	不开通
160218	国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金	100	不开通
160219	国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金	100	不开通
160220	*国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	100	不开通
160222	国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金	100	不开通
160221	国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金	100	不开通
160224	国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金	100	不开通
519020	*国泰金泰平衡混合型证券投资基金	100	不开通
519021	国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金	100	不开通
519606	国泰金鑫股票型证券投资基金	100	不开通

注:(1)表格中标*的国泰民益灵活配置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、国泰金泰平衡混合型证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金目前为暂停申购状态,若该基金届时开放申购,投资者可通过华鑫证券参与相关业务。

(2)表格中标**的国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金目前只可赎回,尚未开放申购,若该基金届时开放申购,投资者可通过华鑫证券申购相关基金。

二、"定期定额投资业务"是指投资者通过本基金管理人指定的销售机构申请,约定每月扣款时间、扣款金额、扣款方式,由指定销售机构于每期约定扣款日,在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。定期定额申购费率与普通申购费率相同,每期扣款金额以代销渠道为准。销售机构将按照与投资者申请时所约定的每月固定扣款日、扣款金额扣款,若遇非基金交易日时,扣款是否顺延以销售机构的具体规定为准。

三、基金转换业务是指投资者在同一销售机构持有本基金管理人管理的开放式基金基金份额后,可将其持有的基金份额直接转换成本基金管理人管理的由该销售机构销售的其他开放式基金的基金份额,而不需要先赎回已持有的基金份额,再申购目标基金的一种业务模式。

1、适用投资人范围

基金转换业务适用于所有已在同一销售机构持有国泰基金旗下任一只自 TA 基金基金份额的个人投资者、机构投资者以及合格的境外机构投资者。

2、基金转换费用

(1)基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由

基金份额持有人承担。

①转入基金申购补差费:按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的, 补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额;转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的,补差费为零。

②转出基金赎回费:按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中按相关基金招募说明书规定的比例归转出基金基金财产,其余作为注册登记费和相关的手续费。

3、转换份额的计算公式

基金合同中无特殊约定基金的转换费用采用 "转出和转入基金的申购费补差+转出基金的赎回费"算法,计算公式如下:

净转入金额= B×C×(1-D)/(1+G)

转换补差费用= [B×C×(1-D)/(1+G)]×G

转入份额= 净转入金额 / E

其中,B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

G 为对应的申购补差费率,当转出基金的申购费率≥ 转入基金的申购费率时,则申购补差费率 G 为零;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费归入转出基金资产的比例由招募说明书规定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率,调整后的基金转换费率应及时公告。

例如:某基金份额持有人持有国泰金龙行业精选证券投资基金 10 万份基金份额, 持有期为 100 天,决定转换为国泰金鹰增长证券投资基金,假设转换当日转出基金(国泰金龙行业)份额净值是 1.200 元,转入基金(国泰金鹰增长)份额净值是 1.300 元,转出基金对应赎回费率为 0.2%,转入基金申购补差费率为 0.3%,则可得到的转换份额为:

净转入金额= 10,0000×1.200×(1-0.2%)/(1+0.3%)=119,401.79 元

转换补差费用= [10,0000×1.200×(1-0.2%)/(1+0.3%)]×0.3%=358.21 元

转入份额= 119,401.79 / 1.300=91,847.53 份

即:某基金份额持有人持有国泰金龙行业精选证券投资基金 10 万份基金份额,持有期为 100 天,决定转换为国泰金鹰增长证券投资基金,假设转换当日转出基金份额净值是 1.200 元,转入基金的份额净值是 1.300 元,则可得到的转换份额 91,847.53 份。

注:转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

若遇上转出和转入基金的申购费一项为固定值另一项为比例值,无法按差值进行计算,则申购费补差不再扣减原基金申购时已缴纳的 1000 元申购费。

4、基金转换的业务规则

(1) 基金转换只能在同一销售机构办理, 且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售。

(2)基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时,转出方的基金必须处于可赎回状态,转入方的基金必须处于可申购状态。

(3)基金转换采取未知价法,即以申请受理当日转出、转入基金的基金份额净值为基础进行计算。

(4)正常情况下,基金注册与过户登记人将在 T+1 日对投资者 T 日的基金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2 日后(包括该日)投资者可向销售机构查询基金转换的确认情况。

(5)基金转换的最低申请为 1000 份,各基金转换的最低申请份额详见各基金招募说明书。如投资者在单个销售网点持有单只基金的份额不足招募说明书所示时,需一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

(6)单个开放日基金净赎回份额及净转出申请份额之和超过上一开放日基金总份额的 10%时,为巨额赎回。发生巨额赎回时,基金转出与基金赎回具有相同的优先级,基金管理人可根据基金资产组合情况,决定全额转出或部分转出,并且对于基金转出和基金赎回,将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下,未确认的转出申请将不予以顺延。

(7)目前,国泰基金旗下的开放式基金均采用前端收费模式,故投资者转入的基金份额将被自动记入前端收费模式下,且持有人对转入基金的持有期限自转入之日起计算。

5、暂停基金转换的情形及处理

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购, 因此暂停基金转换适用有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、赎回的基金处于封闭期有关规定。

6、重要提示

(1)基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的国泰基金旗下管理的基金,且拟转出基金及拟转入基金已在该销售机构开通转换业务。

(2)国泰基金旗下新发售基金的转换业务规定,以届时公告为准。

(3) 通过国泰基金网上交易平台办理基金转换业务的有关事项请参见基金管理人公布的基金网上交易相关业务规则或公告等文件。

(4)基金管理人有权根据市场情况或法律法规变化调整上述转换的程序及有关限制,在实施日前依照《信息披露管理办法》的有关规定,在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(5)基金管理人旗下管理的基金的转换业务规则的解释权归国泰基金管理有限公司。

四、优惠费率活动具体内容

1、优惠时间:无限期,若有变动,本公司或华鑫证券将另行公告。

2、活动期间,投资者通过华鑫证券自助式交易系统(包括网上交易、电话委托、手机证券、磁卡委托、热自助系统)申购与定投上述适用基金(仅限前端、场外模式),原费率高于 0.6%的,可享受原费率 4 折优惠,最低优惠至 0.6%;原费率低于 0.6%的,则按原费率执行。原申购费率(含分级费率)为固定费用的,则按原申购费率执行。

3、上述适用基金的原申购费率参见各基金的相关法律文件及本公司发布的最新相关公告。

五、投资者可以通过以下渠道办理相关业务

(1)华鑫证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元

办公地址:上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人:俞洋

联系人:王逍

电话:021-64339000

传真:021-54668802

客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918

网址:www.cfsc.com.cn

六、本基金管理人联系方式

客户服务热线:400-888-8688,021-31089000

公司网站:www.gtfund.com

风险提示: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

保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
二〇一五年六月九日