（上接B17版）

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（Perfomance 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%。本基金投资境外伞型基金的，该伞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伞型基金子基金；

（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%。

（8）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在30个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

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有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，无需召开基金份额持有人大会审议。

2、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）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）购买不动产；

（5）购买房地产抵押按揭；

（6）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；

（7）购买实物商品；

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

（9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

（10）参与未持有基础资产的卖空交易；

（11）向其基金管理人、基金托管人出资；

（12）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；

（13）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

3、关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为美国3年期国债到期收益率+3%。

本基金定位为追求绝对收益回报的基金产品，以美国3年期国债到期收益率上浮3%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整前2个工作日在指定媒介上予以公告。

六、风险收益特征

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。

第五部分 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：唐建光

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2015年9月30日，本基金管理人共管理55只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、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（在金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金泉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、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（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、国泰价值经典混合型证券投资基金（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、国泰申报驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰金鑫证券投资基金、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、国泰估值优势混合型证券投资基金（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、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（由中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰央企改革股票型证券投资基金。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

唐建光，董事长，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月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长；1993 年7月至1995年9月在中煤基建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任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010年11月至2014年10月任国泰基金管理有限公司监事会主席，2014年8月起任公司党委书记，2015年8月起任公司董事长、法定代表人。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006年7月起在中国建银投有限责任公司工作，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企融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。

张峰，董事，硕士研究生，16年证券从业经历。1987年7月至1999年3月就职于国家计划委员会，历任产业经济研究所科员、政研室经济分析处副处长、财金司综合处处长。1999年3月至2001年7月在嘉实基金管理有限公司工作，任研究部副总监、市场部总监。2001年7月至2002年4月在中保集团资产管理公司，任总经理助理。2002年4月至2015年4月在嘉实基金管理有限公司工作，历任督察长、副总经理兼首席市场官。2015年5月加入国泰基金管理有限公司，2015年8月起任公司总经理及公司董事。

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。2013年起兼任金诚信矿业管理股份有限公司（目前已上市）独立董事，2015年5月起兼任北京采安律师事务所兼职律师。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副所长。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

梁风玉，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。

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（财富大学）及行政管理部负责人。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。

邓叶锋，监事，硕士研究生。曾任职于天回证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、社保111组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理，2008年4月起任国泰金鼎价值精选证券投资基金的基金经理，2009年5月起兼任国泰区位优势混合型证券投资基金（原国泰区位优势股票型证券投资基金）的基金经理，2013年9月至2015年3月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）的基金经理。2015年8月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

唐建光，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

张峰，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，2015年8月31日起代任公司督察长。

周向勇，硕士研究生，19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。

4、本基金拟任基金经理

吴向军，男，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，担任投票分析师；2007年6月至2011年4月美国Security Global Investors工作，担任高级分析师。2011年5月加入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，2015年7月起兼任国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）的基金经理。2015年8月起任国际业务部副总监。

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，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。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：

主任委员：

张峰：总经理、董事

委员：

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）部副总监

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。

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，确定各类基金份额申购、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，本着谨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、内部风险控制的组织

（1）风险管理委员会：风险管理委员会为公司非常设议事机构，由公司副总经理、督察长及相关人员组成，其主要职责是负责基金投资过程中的风险评估与防范，制定控制基金投资风险的措施，并在市场发生重大变化时，依据风险控制的要求，对投资组合作出有效调整，保证基金资产的安全。

（2）督察长：督察长制度是基金管理有限公司特有的制度。督察长由公司总经理提名，经董事会聘任或解聘。督察长可列席公司任何会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行稽核，独立出具稽核报告，报送中国证监会和公司董事长。

（3）稽核监察部：稽核部门依据国家的有关法律、法规，公司的内控制度，在所赋予的权限内，按照规定的程序和方法，对稽核对象进行客观公正的检查和评价。稽核部负责检查、评价公司有关部门执行国家有关法律法规的情况和执行公司各项规章制度的情况；负责评价公司内控制度的健全性、有效性和合理性；负责评价投资决策程序及执行情况；调查公司内部的经济违法案件等。

2、内部风险控制、内部监察及稽核、财务管理及人事管理等制度的建立情况

建立健全的内部控制体系是基金管理公司的基础性工作，也是保护基金投资者的重要措施。国泰基金管理有限公司建立的内控机制包括：

（1）内部风险控制的原则及内容

1）内部风险控制遵循的原则

全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

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；

相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

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；

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）内部风险控制的内容：

内部风险控制制度的内容由一系列的具体制度构成，包括：岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度等。

为保证各部门的相对独立性，应建立明确的岗位分离制度。同时实行空间隔离制度，建立中间墙，充分保证信息的隔离和保密。

各部门应本着合理、高效、尽可能减小错误发生的可能性的原则，制定本部门的作业流程。

基金投资运作实行各基金的基金经理独立决策下的的集中交易制度，建立交易管理部，所有基金投资必须在交易管理部完成。

制定规范的信息披露管理办法，建立完善的信息资料保全系统，建立完整的会计、统计和各种业务资料的档案。

实行独立的稽核检查制度，稽核监察部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

（2）内部稽核制度

1）稽核监察部的职责：

稽核监察部门依据国家的有关法律法规、公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，对稽核监察对象进行公正客观的检查和评价。

稽核监察部负责调查、评价公司有关部门执行国家有关法律法规的情况和执行公司各项规章制度的情况；进行日常风险控制监控工作；负责调查评价公司内控制度健全性、合理性和有效性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；负责调查、评价投资决策与执行情况；评价基金资产情况；调查公司内部的经济违法案件等。

针对公司管理多个基金，稽核监察部负责实时监控公司管理的所有基金持有某一家上市公司的总持仓量；通过系统设置，实现对基金间反向交易的自动禁止，杜绝内幕交易的发生；检查交易管理部是否按照“时间优先，价格优先”原则进行交易。

2）稽核监察部的权限：

稽核监察部有权向有关部门获取文件和材料，查阅合同、协议及相关附件，检查会计凭证、账册、报表及相关的交易记录资料，核查实物资产；有权穿越公司为控制风险和实施保密制度而设立的有形隔离和无形隔离，亦指通称的防火墙或中间墙；有权要求各业务部门提供有关经营管理计划、及其执行情况，提供报表、制度、规定、办法等文件资料。经总经理同意，有权参加公司业务会议；监察公司员工遵守执业行为准则，保密制度的情况，有权要求相关人员提供相关资料和口头或书面说明；稽核监察部对被审部门或个人正在进行的违法、违规行为有权提请被查对象注意，在报公司领导同意后有权予以制止。

公司督察长可列席公司的任何会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核，定期应独立出具稽核报告，报送中国证监会和董事长；如发现公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和董事长报告。

（3）财务管理制度

基金管理公司的财务制度主要是通过严格执行国家有关政策、会计制度和准则，做好公司业务活动和其他活动的核算工作，并如实反映基金的运作情况和基金管理公司的开支情况。通过严格财务管理，配合加强成本控制工作。公司财务管理与基金会计核算严格区分。

（4）人事管理制度

基金管理公司的人事制度是通过建立人才的培训、激励和行为约束机制，不断培训和吸引优秀的人才，使公司的业务和管理活动不断优化。具体制度包括：制定人才培训和发展计划，制定员工守则和岗位操作守则，定期考核评比、奖优罚劣，根据国家有关法律，保护员工的合法权益。

第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可【2015】2252号文（关于准予国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金注册的批复））准予注册募集。

二、基金类型和存续期限

1、基金类型：基金中基金

2、基金运作方式：契约型、开放式

3、基金的存续期间：不定期

三、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

通过各销售机构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，以美元认购的基金份额登记为美元份额。各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

3、发售对象

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法律法规或中国证监会允许以人民币、美元购买证券投资基金的其他投资人。

四、募集规模

本基金募集金额不少于2亿元人民币或等值货币（募集资金中的美元金额应以募集期最后一日的汇率折算为人民币）。

本基金可根据中国证监会、外管局核准的境外证券投资额度（美元额度需折算为人民币），对基金发售规模进行限制。具体规模限制在相关公告中规定。

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等控制基金申购规模并暂停基金的申购。

五、募集币种

人民币/美元

六、基金的初始面值、认购价格及计算公式、认购费用

1、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。

2、认购费用

募集期内投资人可多次认购本基金，认购费用按每笔认购申请单独计算。本基金对人民币份额和美元份额分别设置认购费率及认购金额分档标准。

本基金人民币份额的认购费率如下：

人民币认购金额（M）	认购费率
M＜100万元	1.20%
100万元≤M＜300万元	0.80%
300万元≤M＜500万元	0.50%
M≥500万元	每笔交易1,000.00元

本基金美元份额的认购费率如下：

美元认购金额（M）	认购费率
M＜20万美元	1.20%
20万美元≤M＜60万美元	0.80%
60万美元≤M＜100万美元	0.50%
M≥100万美元	每笔交易200.00美元

对于人民币份额，依照上述人民币份额认购费率结构确定所适用的认购费率；对于美元份额，依照上述美元份额认购费率结构确定所适用的认购费率。

3、基金认购份额的计算

（1）认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

对于人民币份额的认购：

净认购金额=认购金额/（1+人民币份额认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期间的利息）/人民币份额初始面值

对于美元份额的认购：

净认购金额=认购金额/（1+美元份额认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期间的利息）/美元份额初始面值

（2）认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

对于人民币份额的认购：

认购费用=人民币份额固定认购费用

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购期间的利息）/人民币份额初始面值

对于美元份额的认购：

认购费用=美元份额固定认购费用

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购期间的利息）/美元份额初始面值

人民币份额的认购费用以人民币元为单位，美元份额的认购费用以美元为单位，计算结果保留至小数点后2位，小数点后第3位四舍五入；认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资50,000.00元认购本基金人民币份额，认购费率为1.2%，假定募集期产生的利息为10.50元，则可认购本基金人民币份额的份额数为：

净认购金额=50,000.00/（1+1.2%）=49,407.11元

认购费用=50,000.00-49,407.11=592.89元

认购份额=（49,407.11+10.50）/1.00=49,417.61份

即：该投资人投资50,000.00元认购本基金人民币份额，募集期产生的利息为10.50元，可得49,417.61份本基金人民币份额。

例：某投资人投资50,000.00美元认购本基金美元份额，认购费率为1.2%，假定募集期产生的利息为10.50美元，则可认购本基金美元份额的份额数为：

净认购金额=50,000.00/（1+1.2%）=49,407.11美元

认购费用=50,000.00-49,407.11=592.89美元

认购份额=（49,407.11+10.50）/1.00=49,417.61份

即：该投资人投资50,000.00美元认购本基金美元份额，募集期产生的利息为10.50美元，可得49,417.61份本基金美元份额。

七、认购时间安排

1、认购时间安排

投资人认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和其他销售机构确定，请参见本基金的基金份额发售公告或其他销售机构的相关公告。

2、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或基金代销机构的相关业务办理规则。

3、认购的方式和确认

（1）投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。需按销售机构规定的方式全额缴款。本基金人民币份额的认购须使用人民币，美元份额的认购须使用美元。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。

（2）以人民币认购的基金份额登记为人民币份额，以美元认购的基金份额登记为美元份额。

（3）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销。

4、认购的限额

（1）在募集期内，投资者可多次认购，对单一投资者在认购期间累计认购份额不设上限

（2）认购最低限