

# 国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金 更新招募说明书摘要

（2014 年第二号）

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

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]1654 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。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，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。投资者根据所持有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：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

国泰房地产份额是本基金基础份额，属于证券投资基金中的高风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。房地产 A 份额和房地产 B 份额通过场内的国泰房地产份额按照 1: 1 的基金份额配比分拆而来。按照基金合同的约定，具有与国泰房地产份额不同的风险收益特征。房地产 A 份额的风险与预期收益较低，房地产 B 份额风险较高、预期收益相对较高。由于房地产 B 份额内含杠杆机制的设计，房地产 B 份额净值的变动幅度将大于国泰房地产份额和房地产 A 份额净值的变动幅度，即房地产 B 份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。房地产 B 份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。房地产 A 份额和房地产 B 份额可通过基金合同约定的配对转换方式合并为场内的国泰房地产份额，或通过基金合同约定的份额折算方式，折算为场内的国泰房地产份额，从而还原为本基金基础份额的风险收益特征。

投资有风险，投资者认购（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者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前

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 2014 年 8 月 6 日，投资组合报告为 2014 年 2 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 6 月 30 日。

## 一、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 2014 年 8 月 6 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 46 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 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、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、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。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，高级经济师，22 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、党委书记。

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 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。

金旭，董事，硕士研究生，21 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。2001 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

月在宝盈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 月起任公司监事会主席。

Nikhil Srinivasan，监事，硕士研究生。先后在 Allianz SE Singapore, Allianz SE Munich 工作，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，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。

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 月在美国花旗银行台北分行工作，任财务企划助理；1995 年 1 月至 2000 年 12 月在台湾大华证券公司工作，任债券交易总监；2001 年 1 月至 2004 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 10 月至 2006 年 5 月在台湾保诚投信股份有限公司工作，负责投资业务；2006 年 6 月至 2010 年 4 月在美国纽约人寿台湾子公司工作，任投资长；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。

贺燕萍，硕士，16 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、本基金的基金经理

##### （1）现任基金经理

徐皓，硕士研究生，FRM，注册黄金投资分析师，7 年证券从业经历。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010 年 5 月加盟国泰基金，任高级风控经理。2011 年 6 月至 2014 年 1 月担任上证 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及国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理助理，2012 年 3 月至 2014 年 1 月兼任中小板 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的基金经理助理。2014 年 1 月起任中小板 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的基金经理，2014 年 6 月起兼任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理。

##### （2）历任基金经理

本基金自 2013 年 2 月至 2014 年 6 月由章贇担任基金经理，自 2014 年 6 月起至今由徐皓担任基金经理。

#### 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)部等负责人员中产生。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：

李志坚先生：副总经理

周向勇先生：副总经理

黄焱先生：总经理助理兼投资总监兼权益投资（事业）部总经理

乔巍先生：总经理助理兼绝对收益投资（事业）部总经理

沙骏先生：量化投资（事业）部总经理

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2014 年 6 月 30 日，中国银行已托管 276 只证券投资基金，其中境内基金 251 只，QDII 基金 25 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满



足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构

| 序号 | 机构名称             | 机构信息                                                            |                                                        |
|----|------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 | 地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层                            |                                                        |
|    |                  | 直销业务专用电话：021-31081759                                           |                                                        |
|    |                  | 客户服务专线：400-888-8688，021-31089000                                |                                                        |
|    |                  | 传真：021-31081861                                                 | 网址： <a href="http://www.gtfund.com">www.gtfund.com</a> |
| 2  | 国泰基金电子交易平台       | 网站： <a href="http://www.gtfund.com">www.gtfund.com</a> 登录网上交易页面 |                                                        |
|    |                  | 电话：021-31081841                                                 | 联系人：沈茜                                                 |

##### （2）代销机构

##### 1) 代销银行及券商

| 序号 | 机构名称         | 机构信息                                               |                                                |
|----|--------------|----------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1  | 中国农业银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号                             |                                                |
|    |              | 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号                             |                                                |
|    |              | 法定代表人：蒋超良                                          | 客户服务电话：95599                                   |
|    |              | 联系人：客户服务中心                                         | 传真：010-85109219                                |
|    |              | 网址： <a href="http://www.95599.cn">www.95599.cn</a> |                                                |
| 2  | 中国银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号                              |                                                |
|    |              | 法定代表人：田国立                                          | 联系人：客户服务中心                                     |
|    |              | 客服电话：95566                                         | 网址： <a href="http://www.boc.cn">www.boc.cn</a> |
| 3  | 中国建设银行股份有限公司 | 注册地址：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                                          | 客服电话：95533                                     |
|    |              | 网址： <a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>   |                                                |
| 4  | 交通银行股份有      | 注册地址：上海市银城中路 188 号                                 |                                                |

|    |                |                                      |                      |
|----|----------------|--------------------------------------|----------------------|
|    | 有限公司           | 法定代表人：牛锡明                            | 客服电话：95559           |
|    |                | 联系人：曹榕                               | 电话：021-58781234      |
|    |                | 网址：www.bankcomm.com                  |                      |
| 5  | 招商银行股份有限公司     | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦            |                      |
|    |                | 法定代表人：傅育宁                            | 联系人：邓炯鹏              |
|    |                | 电话：0755-83198888                     | 传真：0755-83195109     |
|    |                | 客户服务热线：95555                         | 网址：www.cmbchina.com  |
| 6  | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号               |                      |
|    |                | 办公地址：上海市中山东一路 12 号                   |                      |
|    |                | 法定代表人：吉晓辉                            | 电话：021-61618888      |
|    |                | 联系人：高天、虞谷云                           | 客户服务热线：95528         |
| 7  | 上海银行股份有限公司     | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号               |                      |
|    |                | 法定代表人：范一飞                            | 联系人：夏雪               |
|    |                | 电话：021-68475888                      | 传真：021-684761111     |
|    |                | 客服电话：021-962888                      |                      |
|    |                | 网址：www.bankofshanghai.com            |                      |
| 8  | 国泰君安证券股份有限公司   | 注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号                |                      |
|    |                | 法定代表人：万建华                            | 联系人：芮敏祺              |
|    |                | 电话：021-38676161                      | 传真：021-38670161      |
|    |                | 客服电话：400-888-8666                    | 网址：www.gtja.com      |
| 9  | 中信建投证券股份有限公司   | 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼             |                      |
|    |                | 法定代表人：王常青                            | 联系人：魏明               |
|    |                | 电话：010-85130588                      | 传真：010-65182261      |
|    |                | 客服电话：400-888-8108                    | 网址：www.csc108.com    |
| 10 | 国信证券股份有限公司     | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼 |                      |
|    |                | 法定代表人：何如                             | 联系人：齐晓燕              |
|    |                | 电话：0755-82130833                     | 传真：0755-82133952     |
|    |                | 客服电话：95536                           | 网址：www.guosen.com.cn |
| 11 | 招商证券股份有限公司     | 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层       |                      |
|    |                | 法定代表人：宫少林                            | 联系人：林生迎              |

|    |                |                                        |                      |
|----|----------------|----------------------------------------|----------------------|
|    |                | 电话：0755-82943666                       | 传真：0755-82943636     |
|    |                | 网址：www.newone.com.cn                   |                      |
|    |                | 客服电话：400-888-8111/95565                |                      |
| 12 | 中国银河证券股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座         |                      |
|    |                | 法定代表人：陈有安                              | 联系人：田薇               |
|    |                | 电话：010-66568430                        | 传真：010-66568990      |
|    |                | 客服电话：400-8888-888                      |                      |
|    |                | 网址：www.chinastock.com.cn               |                      |
| 13 | 海通证券股份有限公司     | 注册地址：上海市淮海中路 98 号                      |                      |
|    |                | 法定代表人：王开国                              | 联系人：李笑鸣              |
|    |                | 电话：021-23219000                        | 传真：021-23219100      |
|    |                | 客服电话：400-888-8001（全国），021-95553        |                      |
|    |                | 网址：www.htsec.com                       |                      |
| 14 | 申银万国证券股份有限公司   | 注册地址：上海市常熟路 171 号                      |                      |
|    |                | 法定代表人：丁国荣                              | 联系人：邓寒冰              |
|    |                | 电话：021-54033888                        | 传真：021-54038844      |
|    |                | 客服电话：021-962505                        | 网址：www.sw2000.com.cn |
| 15 | 中信证券（浙江）有限责任公司 | 注册地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层          |                      |
|    |                | 法定代表人：沈强                               | 联系人：周妍               |
|    |                | 电话：0571-86078823                       | 客服电话：0571-96598      |
|    |                | 网址：www.bigsun.com.cn                   |                      |
| 16 | 万联证券有限责任公司     | 注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层 |                      |
|    |                | 法定代表人：张建军                              | 联系人：罗创斌              |
|    |                | 电话：020-38286651                        | 传真：020-22373718-1013 |
|    |                | 客服电话：400-888-8133                      | 网址：www.wlzq.com.cn   |
| 17 | 东方证券股份有限公司     | 注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层      |                      |
|    |                | 法定代表人：潘鑫军                              | 联系人：吴宇               |
|    |                | 电话：021-63325888                        | 传真：021-63326173      |
|    |                | 客服电话：95503                             | 网址：www.dfzq.com.cn   |
| 18 | 上海证券有限责        | 注册地址：上海市西藏中路 336 号                     |                      |

|    |                  |                                                 |                    |
|----|------------------|-------------------------------------------------|--------------------|
|    | 任公司              | 法定代表人：郁忠民                                       | 联系人：张瑾             |
|    |                  | 电话：021-53519888                                 | 传真：021-53519888    |
|    |                  | 客服电话：021-962518                                 | 网址：www.962518.com  |
| 19 | 国盛证券有限<br>责任公司   | 注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号                             |                    |
|    |                  | 办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼                |                    |
|    |                  | 法定代表人：曾小普                                       | 联系人：徐美云            |
|    |                  | 电话：0791-6285337                                 | 传真：0791-6288690    |
|    |                  | 网址：www.gsstock.com                              |                    |
| 20 | 光大证券股份有<br>限公司   | 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号                           |                    |
|    |                  | 法定代表人：薛峰                                        | 联系人：刘晨             |
|    |                  | 电话：021-22169999                                 | 传真：021-22169134    |
|    |                  | 客服电话：95525、10108998、400-888-8788                |                    |
|    |                  | 网址：www.ebscn.com                                |                    |
| 21 | 中信证券股份有<br>限公司   | 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座              |                    |
|    |                  | 法定代表人：王东明                                       | 联系人：陈忠             |
|    |                  | 电话：010-84588888                                 | 传真：010-84865560    |
|    |                  | 网址：www.cs.ecitic.com                            |                    |
| 22 | 渤海证券股份有<br>限公司   | 注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室               |                    |
|    |                  | 办公地址：天津市河西区宾水道 8 号                              |                    |
|    |                  | 法定代表人：杜庆平                                       | 联系人：王兆权            |
|    |                  | 电话：022-28451861                                 | 传真：022-28451892    |
|    |                  | 客服电话：400-651-5988                               | 网址：www.bhzq.com    |
| 23 | 中信万通证券有<br>限责任公司 | 注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室       |                    |
|    |                  | 办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061） |                    |
|    |                  | 法定代表人：杨宝林                                       | 联系人：吴忠超            |
|    |                  | 电话：0532-85022326                                | 传真：0532-85022605   |
|    |                  | 客服电话：0532-96577                                 | 网址：www.zxwt.com.cn |
| 24 | 长江证券股份有          | 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦                          |                    |

|    |              |                                                                                                                 |                    |
|----|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
|    | 限公司          | 法定代表人：胡运钊                                                                                                       | 联系人：李良             |
|    |              | 电话：027-65799999                                                                                                 | 传真：027-85481900    |
|    |              | 客服电话：95579                                                                                                      | 网址：www.95579.com   |
| 25 | 齐鲁证券有限公司     | 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号                                                                                          |                    |
|    |              | 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号                                                                                          |                    |
|    |              | 法定代表人：李玮                                                                                                        | 联系人：吴阳             |
|    |              | 电话：0531-68889155                                                                                                | 传真：0531-68889185   |
|    |              | 客服电话：95538                                                                                                      | 网址：www.qlzq.com.cn |
| 26 | 中国中投证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元 |                    |
|    |              | 法定代表人：龙增来                                                                                                       | 联系人：刘毅             |
|    |              | 电话：0755-82023442                                                                                                | 传真：0755-82026539   |
|    |              | 网址：www.china-invs.cn                                                                                            |                    |
|    |              | 客服电话：400-600-8008、95532                                                                                         |                    |
| 27 | 厦门证券有限公司     | 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼                                                                                           |                    |
|    |              | 法定代表人：傅毅辉                                                                                                       | 联系人：赵钦             |
|    |              | 电话：0592-5161642                                                                                                 | 传真：0592-5161140    |
|    |              | 客服电话：0592-5163588                                                                                               | 网址：www.xmzq.cn     |
| 28 | 中国国际金融有限公司   | 注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层                                                                           |                    |
|    |              | 法定代表人：李剑阁                                                                                                       | 联系人：罗文雯            |
|    |              | 电话：010-65051166                                                                                                 | 传真：010-65051156    |
|    |              | 网址：www.cicc.com.cn                                                                                              |                    |
| 29 | 华福证券有限责任公司   | 注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层                                                                                    |                    |
|    |              | 法定代表人：黄金琳                                                                                                       | 联系人：张腾             |
|    |              | 电话：0591-87278701                                                                                                | 传真：0591-87841150   |
|    |              | 客服电话：0591-96326                                                                                                 | 网址：www.hfzq.com.cn |
| 30 | 天相投资顾问有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701                                                                                 |                    |
|    |              | 法定代表人：林义相                                                                                                       | 联系人：林爽             |
|    |              | 电话：010-66045608                                                                                                 | 传真：010-66045527    |
|    |              | 客服电话：010-66045678                                                                                               | 网址：www.txsec.com   |

|    |            |                                          |                       |
|----|------------|------------------------------------------|-----------------------|
| 31 | 信达证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼               |                       |
|    |            | 法定代表人：高冠江                                | 联系人：唐静                |
|    |            | 电话：010-88656100                          | 传真：010-88656290       |
|    |            | 客服电话：400-800-8899                        | 网址：www.cindasc.com    |
| 32 | 华龙证券有限责任公司 | 注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号                     |                       |
|    |            | 法定代表人：李晓安                                | 联系人：李昕田               |
|    |            | 电话：0931-8888088                          | 传真：0931-4890515       |
|    |            | 客服电话：0931-4890100、4890619、4890618        |                       |
|    |            | 网址：www.hlzqgs.com                        |                       |
| 33 | 平安证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼              |                       |
|    |            | 法定代表人：杨宇翔                                | 联系人：郑舒丽               |
|    |            | 电话：0755-22626391                         | 传真：0755-82400862      |
|    |            | 客服电话：95511-8                             | 网址：www.pingan.com     |
| 34 | 德邦证券有限责任公司 | 注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼              |                       |
|    |            | 法定代表人：姚文平                                | 联系人：罗芳                |
|    |            | 电话：021-68761616                          | 传真：021-68767981       |
|    |            | 客服电话：4008888128                          | 网址：www.tebon.com.cn   |
| 35 | 中航证券有限公司   | 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 |                       |
|    |            | 法定代表人：杜航                                 | 联系人：戴蕾                |
|    |            | 电话：0791-86768681                         | 传真：0791-86770178      |
|    |            | 客服电话：400-8866-567                        | 网址：www.avicsec.com    |
| 36 | 东海证券股份有限公司 | 注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层            |                       |
|    |            | 法定代表人：刘化军                                | 联系人：李涛                |
|    |            | 电话：0519-88157761                         | 传真：0519-88157761      |
|    |            | 客服电话：400-888-8588                        | 网址：www.longone.com.cn |
| 37 | 华融证券股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街 8 号                      |                       |
|    |            | 法定代表人：宋德清                                | 联系人：黄恒                |
|    |            | 电话：010-58568235                          | 传真：010-58568062       |
|    |            | 客服电话：010-58568118                        | 网址：www.hrsec.com.cn   |
| 38 | 江海证券有限公司   | 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号                 |                       |

|    |             |                                      |                      |
|----|-------------|--------------------------------------|----------------------|
|    | 司           | 法定代表人：孙名扬                            | 联系人：张宇宏              |
|    |             | 电话：0451-82336863                     | 传真：0451-82287211     |
|    |             | 客服电话：400-666-2288                    | 网址：www.jhzq.com.cn   |
| 39 | 新时代证券有限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层          |                      |
|    |             | 法定代表人：马金声                            | 联系人：孙恺               |
|    |             | 电话：010-83561149                      | 传真：010-83561094      |
|    |             | 客服电话：4006989898                      | 网址：www.xsdzq.cn      |
| 40 | 西南证券股份有限公司  | 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号                   |                      |
|    |             | 法定代表人：余维佳                            | 联系人：张煜               |
|    |             | 电话：023-63786141                      | 传真：023-63786212      |
|    |             | 网址：http://www.swsc.com.cn            |                      |
| 41 | 国都证券有限责任公司  | 注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 |                      |
|    |             | 法定代表人：常喆                             | 联系人：黄静               |
|    |             | 电话：010-84183333                      | 传真：010-84183311-3389 |
|    |             | 客服电话：4008188118                      | 网址：www.guodu.com     |
| 42 | 晋商银行股份有限公司  | 注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座        |                      |
|    |             | 法定代表：上官永清                            |                      |
|    |             | 客服电话：95105588                        | 网址：www.jshbank.com   |
| 43 | 宁波银行股份有限公司  | 注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号                |                      |
|    |             | 法定代表人：陆华裕                            |                      |
|    |             | 客服电话：96528（上海地区 962528）              |                      |
|    |             | 网址：www.nbcb.com.cn                   |                      |
| 44 | 浙商银行股份有限公司  | 注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号                 |                      |
|    |             | 法定代表人：张达洋                            |                      |
|    |             | 客服电话：95527                           |                      |
|    |             | 网址：http://www.czbank.com             |                      |

## 2) 第三方销售机构

| 序号 | 机构名称     | 机构信息                            |
|----|----------|---------------------------------|
| 1  | 诺亚正行（上海） | 注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室 |

|   |                  |                                          |                      |
|---|------------------|------------------------------------------|----------------------|
|   | 基金销售投资顾问有限公司     | 法定代表人：汪静波                                | 联系人：方成               |
|   |                  | 电话：021-38602377                          | 传真：021-38509777      |
|   |                  | 客服电话：4008215399                          | 网址：www.noah-fund.com |
| 2 | 上海好买基金销售有限公司     | 注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室     |                      |
|   |                  | 法定代表人：杨文斌                                | 联系人：薛年               |
|   |                  | 电话：021-20613999                          | 传真：021-68596916      |
|   |                  | 客服电话：400-700-9665                        | 网址：www.ehowbuy.com   |
| 3 | 杭州数米基金销售有限公司     | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号                  |                      |
|   |                  | 法定代表人：陈柏青                                | 联系人：周熾旻              |
|   |                  | 电话：0571-28829790                         | 传真：0571-26698533     |
|   |                  | 客服电话：4000-766-123                        | 网址：www.fund123.cn    |
| 4 | 深圳众禄基金销售有限公司     | 注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 |                      |
|   |                  | 法定代表人：薛峰                                 | 联系人：童彩平              |
|   |                  | 电话：0755-33227950                         | 传真：0755-82080798     |
|   |                  | 客服电话：4006-788-887                        |                      |
|   |                  | 网址：www.zlfund.cn 及 www.jmmw.com          |                      |
| 5 | 上海长量基金销售投资顾问有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室          |                      |
|   |                  | 法定代表人：张跃伟                                | 联系人：敖玲               |
|   |                  | 电话：021-58788678-8201                     | 传真：021-58787698      |
|   |                  | 客服电话：400-089-1289                        | 网址：www.erichfund.com |
| 6 | 北京展恒基金销售有限公司     | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号                   |                      |
|   |                  | 法定代表人：闫振杰                                | 联系人：焦琳               |
|   |                  | 电话：010-62020088-8288                     | 传真：010-62020088-8802 |
|   |                  | 客服电话：4008886661                          |                      |
|   |                  | 网址：www.myfund.com                        |                      |
| 7 | 浙江同花顺基金销售有限公司    | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903                |                      |
|   |                  | 法定代表人：凌顺平                                | 联系人：杨翼               |
|   |                  | 电话：0571-88911818-8565                    | 传真：0571-86800423     |
|   |                  | 客服电话：4008-773-776<br>0571-88920897       | 网址：www.5ifund.com    |



|    |                      |                                        |                    |
|----|----------------------|----------------------------------------|--------------------|
| 8  | 万银财富（北京）<br>基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内     |                    |
|    |                      | 法定代表：李招弟                               | 联系人：刘媛             |
|    |                      | 电话：010-59393923                        | 传真：010-59393074    |
|    |                      | 客服电话：4008080069                        | 网址：www.wy-fund.com |
| 9  | 上海利得基金销售<br>有限公司     | 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室           |                    |
|    |                      | 法定代表：盛大                                | 联系人：叶志杰            |
|    |                      | 电话：021-50583533                        | 传真：021-50583633    |
|    |                      | 客服电话：400-005-6355                      |                    |
|    |                      | 网址：www.leadfund.com.cn                 |                    |
| 10 | 浙江金观诚财富管<br>理有限公司    | 注册地址：杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 801  |                    |
|    |                      | 法定代表：陆彬彬                               | 联系人：鲁盛             |
|    |                      | 电话：0571-56028617                       | 传真：0571-56899710   |
|    |                      | 客服电话：400-068-0058                      |                    |
|    |                      | 网址：www.jincheng-fund.com               |                    |
| 11 | 嘉实财富管理有限<br>公司       | 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元 |                    |
|    |                      | 法定代表：赵学军                               | 联系人：张倩             |
|    |                      | 电话：021-20289890                        | 客服电话：400-021-8850  |
|    |                      | 传真：021-20280110、010-85097308           |                    |
|    |                      | 网址：www.harvestwm.cn                    |                    |

## 2、场内发售机构

本基金场内通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售。本基金房地产 A 份额和房地产 B 份额已于 2013 年 3 月 7 日在深圳证券交易所交易上市，投资人通过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。具体会员单位名单请见刊登于 2013 年 3 月 4 日《中国证券报》上的《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金之房地产 A 与房地产 B 基金份额上市交易公告书》。

### （二）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号 19 楼

负责人：韩炯 联系电话：021-31358666

传 真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

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

## 四、基金名称

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金

## 五、基金类型和存续期限

- 1、基金类型：股票型基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

## 六、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 七、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、债券回购、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资不高于基金资产净值的 3%。

## 八、投资策略

### 1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### 2、债券投资策略

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

### 3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情

况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

## 九、风险收益特征

本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。

运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰房地产份额、房地产 A 份额、房地产 B 份额。其中国泰房地产份额为普通的股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；房地产 A 份额的风险与预期收益较低；房地产 B 份额采用了杠杆式的结构，风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

## 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：国证房地产行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

## 十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 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 2014 年 6 月 30 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(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 723,282,916.50 | 87.12        |
|    | 其中：股票             | 723,282,916.50 | 87.12        |
| 2  | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 30,000,000.00  | 3.61         |
|    | 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      | 76,649,544.06  | 9.23         |
| 7  | 其他各项资产            | 267,844.22     | 0.03         |
| 8  | 合计                | 830,200,304.78 | 100.00       |

# 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

## （1）积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —            |
| B  | 采矿业              | —            | —            |
| C  | 制造业              | 6,911,628.86 | 0.87         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |
| E  | 建筑业              | —            | —            |
| F  | 批发和零售业           | 26,254.40    | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —            | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —            | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —            | —            |
| J  | 金融业              | —            | —            |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| K | 房地产业          | 50,543,351.59 | 6.33 |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -    |
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,672,791.72  | 0.84 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -    |
| P | 教育            | -             | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -    |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 64,154,026.57 | 8.03 |

## (2) 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | -              | -            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 616,857,845.15 | 77.25        |
| L  | 租赁和商务服务业         | 7,016,964.12   | 0.88         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |

|   |    |                |       |
|---|----|----------------|-------|
| S | 综合 | 35,254,080.66  | 4.42  |
|   | 合计 | 659,128,889.93 | 82.55 |

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### （1）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投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 000002 | 万 科 A | 13,670,268 | 113,053,116.36 | 14.16        |
| 2  | 600383 | 金地集团  | 7,992,109  | 71,049,849.01  | 8.90         |
| 3  | 600048 | 保利地产  | 13,714,525 | 68,024,044.00  | 8.52         |
| 4  | 000402 | 金 融 街 | 5,082,904  | 27,701,826.80  | 3.47         |
| 5  | 000024 | 招商地产  | 2,351,512  | 24,502,755.04  | 3.07         |
| 6  | 000009 | 中国宝安  | 2,384,570  | 24,346,459.70  | 3.05         |
| 7  | 600340 | 华夏幸福  | 935,271    | 23,540,771.07  | 2.95         |
| 8  | 600759 | 正和股份  | 1,652,812  | 16,891,738.64  | 2.12         |
| 9  | 000511 | 烯碳新材  | 2,204,872  | 14,860,837.28  | 1.86         |
| 10 | 600208 | 新湖中宝  | 4,892,317  | 14,285,565.64  | 1.79         |

#### （2）期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 600177 | 雅戈尔  | 983,162   | 6,911,628.86 | 0.87         |
| 2  | 600767 | 运盛实业 | 955,853   | 6,872,583.07 | 0.86         |
| 3  | 000809 | 铁岭新城 | 562,156   | 6,672,791.72 | 0.84         |
| 4  | 600185 | 格力地产 | 791,226   | 6,630,473.88 | 0.83         |
| 5  | 000537 | 广宇发展 | 1,132,421 | 6,488,772.33 | 0.81         |

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5、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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### （1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### （1）本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 11、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   | 215,478.05 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 21,822.03  |
| 5  | 应收申购款   | 297.03     |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | 30,247.11  |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 267,844.22 |

（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）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明



| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限情况<br>说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 000009 | 中国宝安 | 24,346,459.70      | 3.05             | 筹划重大事项       |

（6）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2014 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

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，但不保证基金一定盈利，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<br>长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------------------------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2013 年 2 月 6 日至<br>2013 年 12 月 31 日 | -7.30%     | 1.55%         | -19.28%        | 1.76%             | 11.98% | -0.21% |
| 2014 年上半年                           | -0.75%     | 1.43%         | -1.18%         | 1.45%             | 0.43%  | -0.02% |
| 2013 年 2 月 6 日至<br>2014 年 6 月 30 日  | -8.00%     | 1.51%         | -20.23%        | 1.66%             | 12.23% | -0.15% |

注：2013 年 2 月 6 日为基金合同生效日

## 十三、基金费用与税收

（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；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、基金上市费及年费；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；

- 6、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金合同生效以后的会计师费、律师费和诉讼费；
- 9、基金资产的资金汇划费用；
- 10、按照国家有关法律法规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 1.0%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 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%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 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 3、标的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定

向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

基金管理人可根据指数许可使用合同和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

4、本条第（一）款第 4 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，以及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等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2013年9月18日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；

- 2、更新了“三、基金管理人”中的相关信息；
- 3、更新了“四、基金托管人”中的相关信息；
- 4、更新了“五、相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 5、更新了“十二、基金的投资”中基金投资组合报告，数据截止至2014年6月30日；
- 6、更新了“十三、基金的业绩”，数据截止至2014年6月30日；
- 7、更新了“二十七、其他应披露的事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)。

国泰基金管理有限公司

二〇一四年九月十九日