

国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF） 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：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 7 月 14 日证监许可【2011】1094 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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，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，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中出现的风险主要分为三类，一是境外投资产品风险，包括海外市场风险、汇率风险、法律和政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、流动性风险、信用风险、操作或技术风险、会计核算风险、税务风险等；三是本基金的特定风险，包括基金中基金产品特定风险、所投资 ETF 基金的对冲方风险、基金资产整体波动率无法控制在目标水平的风险、投资对象资产数量与资产规模有限引致的特殊风险、上市交易及外汇额度限制引致的特殊风险。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人建议投资人根据自身的风险偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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 11 月 3 日，投资组合报告为 2014 年 3 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、基金的名称

国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）

二、基金的类型和存续期限

- 1、基金的类别：基金中基金(FOF)
- 2、基金的运作方式：上市契约型开放式

三、投资目标

本基金通过在大宗商品各品种间的分散配置以及在商品类、固定收益类资产间的动态配置，力求在有效控制基金资产整体波动性的前提下分享大宗商品市场增长的收益。

四、投资理念

利用各商品品种价格走势之间的不一致性，通过分散投资降低风险，并根据商品类资产的历史波动性动态调整固定收益类资产的配置比例，以求将基金资产的整体波动性控制在特定水平以内，在有效控制投资风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

五、投资范围

本基金的投资范围包括法律法规允许的、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）、债券、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%(若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取消后的规定执行)；投资于基金(含 ETF)的资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 80%投资于商品类基金。

商品类基金包括跟踪综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的 ETF；业绩比较基准 90%以上基于综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的共同基金。

当法律法规或监管机构允许基金投资于商品期货或其它品种时，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更上述比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

六、投资策略

本基金的投资策略为首先确定基准配置比例，包括商品类、固定收益类资产间的大类资产配置比例和各商品品种间的品种配置比例，然后以基准配置比例为参照构建投资组合，最后根据市场波动性调整固定收益类资产比例，以求将投资组合的整体风险控制在特定的水平以内。

1、资产配置策略

本基金的资产配置策略在于确定基准配置比例，包括大类资产配置比例和各商品品种配置比例。

（1）各商品品种间的配置比例

国际上的大宗商品品种繁多，本基金拟投资的商品品种主要可分为以下四大类别：

能源类：包括原油、天然气、燃料油、汽油、瓦斯油等等；

工业金属类：包括铝、锌、铜、镍、铅等等；

贵金属类：包括黄金、白银等等；

农产品类：玉米、小麦、大豆、白糖、棉花、咖啡、可可、牲畜等等。

在商品品种配置比例的选择上，将以分散配置、均衡配置为出发点，综合考虑各商品品种历史表现以及商品市场基本面等各方面因素，力求构建一个相对稳定的商品品种配置比例基准，在全面反映大宗商品走势的同时，尽量降低商品类资产整体的波动性。

具体而言，在商品品种配置比例方面考虑以下因素：

各商品品种各自价格的历史表现和历史波动性

各商品品种价格间历史相关性

各商品品种的全球产量、交易量

各商品品种的可投资性（即是否可通过商品类基金进行投资）

（2）大类资产配置比例

本基金的大类资产类别包括商品类资产和固定收益类资产，大类资产配置以严格控制风险为目标，力求将资产的整体年化波动率控制在不超过 15%的水平。

具体而言，可分为以下步骤：

对商品资产部分近期的历史实际波动率进行计算并年化；

如商品资产部分历史实际波动率小于 15%，则将固定收益类资产比例设置为零。

如商品资产部分历史实际波动率大于 15%，则提高固定收益类资产比例，以求将资产的整体历史实际波动率降至 15%以内。

本基金管理人与德意志银行合作，对以上资产配置方法进行了固化和完善，制定了基准配置组合和定期调整方法。为对组合的表现进行持续跟踪，由德意志银行以指数的形式进行发布了国泰大宗商品配置指数，并以此指数作为本基金的业绩比较基准。关于指数的更多细节参见（六）业绩比较基准。

2、商品类基金投资策略

本基金的商品类基金投资将主要参照基准配置比例中的商品品种配置比例进行配置，具体方法如下：

（1）根据基准配置比例中商品部分各商品品种的成分和权重，在商品基金中抽样选择基础资产商品品种与基准配置比例中商品部分相同或接近的基金，组成初选基金池。

（2）通过量化模型进行最优化分析，从备选基金池中选取基金构建组合。最优化目标为组合与基准配置比例中商品部分的日收益率序列的相关系数最大化，并据此求解组合中各基金的权重。

（3）当基准配置比例定期或不定期进行调整时，通过量化模型重新计算，对组合进行相应调整。

（4）由基金管理人基于对宏观经济和各商品品种基本面的判断，综合评估历史波动率是否准确反映了各商品品种的市场风险，并对组合进行适度调整。

3、固定收益类资产投资策略

本基金投资的固定收益类资产指现金、银行存款、债券、债券型公募基金（含债券型 ETF）、货币市场基金（含货币型 ETF）。

在确定了商品类基金的组合后，本基金将参照基准配置比例中固定收益类资产的配置比例进行配置，并根据所构建商品类基金组合的实际历史波动率加以调整，力求将基金资产的整体波动率控制在年化 15%以内。

由于本基金固定收益类资产投资的目的是优化流动性管理和分散投资风险，因此在投资策略会侧重于短久期、高流动性、高信用等级的品种进行投资。

4、衍生品投资策略

本基金投资衍生品主要采取组合避险策略和有效管理策略。衍生品的投资比例应根据法律法规、本基金合同的规定，在充分考虑投资需要后予以确定。

七、投资决策机制

本基金的投资决策实行公司投资决策委员会下属专业投决会——境外投资专业决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作，基金投资的重大事项需向境外投资专业决策委员会报告。

八、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

国泰大宗商品配置指数（全收益指数）

国泰大宗商品配置指数（Guotai Commodity Allocation Index）是国泰基金和德意志银行联合开发的综合性商品指数，涵盖能源、贵金属、工业金属、农产品等多个商品类别，以反映大宗商品市场的整体走势。指数编制中借鉴了国际上较为流行的风险控制指数技术，以控制指数波动率为目标来进行资产配置。通过在指数中加入现金部分并动态调整，力求将指数的整体年化波动率控制在不超过年化 15%的水平，以达到控制风险的目的。

国泰大宗商品配置指数以 2000 年 1 月 4 日为基期，基点为 100 点。投资者可以通过德意志银行的指数发布网站 DBIQ(<http://index.db.com>) 查询指数的情况，也可以通过彭博资讯查询指数情况，彭博代码为 DBCMCNU1。同时，为便于投资者查询，国泰基金也在公司网站 (<http://www.gtfund.com>) 上公布指数的情况，提供指数介绍、每日走势、商品成分和权重等相关信息。

如果国泰大宗商品配置指数被停止编制及发布，或国泰大宗商品配置指数编制者或所有

者停止对本基金的指数使用授权，或国泰大宗商品配置指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致国泰大宗商品配置指数不宜继续作为业绩比较基准，或证券市场上有其他代表性更强、更合适投资的指数作为本基金的业绩比较基准，或有更能代表本基金风险收益特征的业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的业绩比较基准。基金管理人将依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准或备案后予以公告。

1、指数的构成

国泰大宗商品配置指数的构成包括两大部分：商品资产部分(商品期货投资组合)和现金部分（现金或短期政府债券）。商品资产部分涵盖能源、贵金属、工业金属、农产品等四大类别，用于反映商品市场的整体走势；现金部分用于平抑商品期货组合的市值波动，控制风险。指数提供商根据商品资产部分的近期历史波动率动态调整现金部分的比重，力求将标的整体年化波动率控制在特定的水平（年化 15%）以内，以达到控制风险的目的。

商品资产部分的收益根据商品期货每日的结算价进行计算，现金部分的收益以三月期美国国债的收益率进行计算（3-month T-Bill）。

2、指数的资产配置方法

国泰大宗商品配置指数在资产配置上采用了基于历史波动率的风险控制机制。于每月的第十个工作日对商品资产部分在过去 90 天中的历史波动率进行计算，并将历史波动率和目标波动率（年化 15%）进行比较：当商品资产部分波动率较高时提高现金部分比例，当商品资产部分波动率较低时相应降低现金部分比例，以求达到将指数整体在过去 90 天的波动率控制在不超过年化 15%的水平。

3、商品资产部分的成分和权重

截至 2011 年 4 月 29 日，国泰大宗商品配置指数中商品资产部分的成分和权重如下表所示：

能源		贵金属		工业金属		农产品	
WTI 原油	9.8%	黄金	22.0%	铝	6.8%	玉米	4.8%
布伦特原油	4.0%	白银	10.8%	锌	6.1%	小麦	4.8%
天然气	6.9%			铜	6.2%	大豆	4.3%
燃料油	2.5%			镍	0.9%	白糖	3.3%
汽油	2.5%			铅	0.5%	棉花	0.9%
瓦斯油	0.9%					咖啡	0.8%
						可可	0.7%

			牲畜	0.6%
合计	26.6%	32.8%	20.4%	20.3%

4、期货合约的选取

对于任一商品品种，都有多个到期日不同的期货合约可以选择。国泰大宗商品配置指数在期货合约的选取上采用了德意志银行专有的优化展期（Optimum Yield）技术，对每种商品的期货远期曲线进行分析，根据模型选择出展期损失最小（或展期收益最大）的合约月份，并用该月份的期货合约编制指数。

九、投资程序

严格、完备的投资管理流程可以保证投资理念的贯彻执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：基金经理、研究人员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展商品市场波动、商品基金表现等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：境外投资专业决策委员会依据研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据境外投资专业决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据基准配置组合，结合研究报告，基金经理构建组合。追求严格控制投资风险。

（4）交易执行：交易管理部负责具体执行交易，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。稽核监察部对基金投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

（6）组合监控与调整：基金经理将结合商品市场波动情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

（7）本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，可根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

十、风险收益特征

本基金为基金中基金，基金管理人力求将基金年化波动率控制在特定的水平（年化 15%）以内。因此本基金属于证券投资基金中的较高预期风险和预期收益的基金。

十一、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 10 月 23 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 9 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(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	15,947,783.30	85.37
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	—	—
	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	2,727,184.42	14.60
8	其他各项资产	6,118.06	0.03
9	合计	18,681,085.78	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、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

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	POWERSHARES DB COMMODITY INDEX TRACKING	ETF 基金	开放式	DB Commodity Services LLC	3,128,657.00	18.57
2	ISHARES S&P GSCI COMMODITY INDEX TRUST	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	2,712,581.88	16.10
3	POWERSHARES DB	ETF 基金	开放式	DB Commodity	2,703,777.65	16.05

	AGRICULTURE FUND			Services LLC		
4	POWERSHARES DB BASE METALS FUND	ETF 基金	开放式	DB Commodity Services LLC	2,684,200.40	15.93
5	POWERSHARES DB ENERGY FUND	ETF 基金	开放式	DB Commodity Services LLC	1,987,496.22	11.80
6	ISHARES GOLD TRUST	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,173,343.28	6.96
7	POWERSHARES DB PRECIOUS METALS FUND	ETF 基金	开放式	DB Commodity Services LLC	1,145,294.03	6.80
8	ISHARES SILVER TRUST	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisor	412,432.84	2.45

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	526.29
5	应收申购款	5,591.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,118.06

（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。

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
2012 年 5 月 3 日至 2012 年 12 月 31 日	-1.00%	0.45%	0.43%	0.81%	-1.43%	-0.36%
2013 年度	-16.36%	0.58%	-18.37%	0.75%	2.01%	-0.17%
2014 年上半年	3.99%	0.42%	6.43%	0.49%	-2.44%	-0.07%
自基金合同生效起 至 2014 年 6 月 30 日	-13.90%	0.51%	-12.75%	0.72%	-1.15%	-0.21%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

十三、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 11 月 3 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 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、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。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。

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

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

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。

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

崔涛，男，硕士研究生，10 年证券基金从业经历。曾任职于 Paloma Partners 资产管理公司、富通银行（纽约）。2009 年 6 月加入国泰基金管理有限公司，任高级经理（量化研究方向），从事量化及衍生品投资、指数基金和 ETF 的投资研究以及境外市场投资研究。2011 年 5 月起任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理，2011 年 5 月起任国际业务部总监助理，2012 年 5 月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理，2013 年 4 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数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崔涛担任基金经理，无基金经理更换事项。

5、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

张玮先生：权益投资总监

吴晨先生：绝对收益投资（事业）部总监助理

十四、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、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、征管费、过户费、手续费、券商佣金及其他性质类似的费用等），所投资基金的交易费用和管理费用，及在境外市场的开户、交易、清算和登记等相关的各项费用；
- 8、外汇兑换交易的相关费用；
- 9、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 10、与基金缴纳税款有关的手续费、汇款费及顾问费；
- 11、基金上市初费和上市月费；
- 12、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、除管理费、托管费之外的基金费用，由基金管理人、基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费不得从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人、基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人应聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

十五、基金托管人

（一）基金托管人情况

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

组织形式：股份有限公司

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

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的历史，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 240,417,319,880 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。在英国《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。

（二）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。

（三）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。

十六、境外托管人

（一）境外托管人的基本情况

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

最近一个会计年度（截止到 2013 年 12 月 31 日）所有者权益（Shareholder' s Equity）：
203.8 亿美元

（二）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 日道富拥有超过 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。

（三）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。

十七、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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：021-31085881	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金 电子交易平台	网站：www.gtfund.com 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：www.95599.cn	
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：www.boc.cn
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：www.ccb.com	
4	交通银行股份有	注册地址：上海市银城中路 188 号	

	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	中国民生银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号	
		法定代表人：董文标	联系人：董云巍、吴海鹏
		电话：010-58351666	传真：010-83914283
		客服电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
8	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号	
		法定代表人：胡平西	联系人：吴海平
		电话：021-38576977	传真：021-50105124
		客服电话：021-962999	网址：www.srcb.com
9	杭州银行股份有限公司	注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦	
		法定代表人：吴太普	联系人：严峻
		电话：0571-85163127	传真：0571-85179591
		客服电话：400-888-8508	网址：www.hzbank.com.cn
10	洛阳银行股份有限公司	注册地址：洛阳市新区开元大道与通济街交叉口	
		法定代表人：王建甫	联系人：胡艳丽
		电话：0379-65921977	传真：0379-65920155
		客服电话：0379-96699	
		网址：www.bankofluoyang.com.cn	
11	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号	
		法定代表：何沛良	联系人：何茂才

		电话：0769-22866255	电话：0769-22866255
		客服电话：0769-961122	网址：www.drcbank.com
12	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
13	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
14	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
15	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	
16	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	
17	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	
18	申银万国证券股	注册地址：上海市常熟路 171 号	

	份有限公司	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
19	兴业证券股份有 限公司	注册地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦	
		法定代表人：兰荣	联系人：谢高得
		电话：021-38565785	传真：021-38565783
		客服电话：400-888-8123	网址：www.xyzq.com.cn
20	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	
21	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
22	民生证券股份有 限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层	
		法定代表人：余政	联系人：赵明
		电话：010-85127622	传真：010-85127917
		客服电话：400-619-8888	网址：www.msza.com
23	东吴证券股份有 限公司	注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层	
		法定代表人：吴永敏	联系人：方晓丹
		电话：0512-65581136	传真：0512-65588021
		客服电话：0512-33396288	网址：www.dwzq.com.cn
24	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
25	上海证券有限责 任公司	注册地址：上海市西藏中路 336 号	
		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
26	国盛证券有限责任公司	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	
27	光大证券股份有限公司	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	
28	宏源证券股份有限公司	注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路 233 号	
		法定代表人：冯戎	联系人：李巍
		电话：010-88085858	传真：010-88085195
		客服电话：400-800-0562	网址：www.hysec.com
29	广发证券股份有限公司	注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）	
		办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼	
		法定代表人：孙树明	联系人：黄岚
		电话：020-87555888	传真：020-87555305
		客服电话：95575	网址：www.gf.com.cn
30	中信证券股份有限公司	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	
31	渤海证券股份有限公司	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
32	中信万通证券有 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
33	华泰证券有限责 任公司	注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
		办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
		法定代表人：吴万善	联系人：张小波
		电话：025-84457777	网址：www.htzq.com.cn
		客服电话：95597	
34	长江证券股份有 限公司	注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
		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
35	国海证券股份有 限公司	注册地址：广西桂林市辅星路 13 号	
		法定代表人：张雅锋	联系人：牛孟宇
		电话：0755-83709350	传真：0755-83704850
		客服电话：95563	网址：www.ghzq.com.cn
36	中原证券股份有 限公司	注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号	
		办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 层	
		法定代表人：营明军	联系人：程月艳、耿铭
		电话：0371-65585670	传真：0371-65585665
		客服电话：400-813-9666/0371-967218	
		网址：www.ccnew.com	
37	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
38	恒泰证券股份有 限公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号	
		法定代表人：庞介民	联系人：王旭华
		电话：0471-4972343	传真：0471-4961259
		客服电话：0471-4961259	网址：www.cnht.com.cn
39	东莞证券有限责 任公司	注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼	
		法定代表人：游锦辉	联系人：梁健伟
		电话：0769-22119341	传真：0769-22116999
		客服电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
40	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	
41	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
42	华宝证券有限责 任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层	
		法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
		电话：021-68778081	传真 021-68778117
		客服电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
43	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	
44	华福证券有限责	注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	

	任公司	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
45	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
46	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
47	中国民族证券有限责任公司	注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	
		法定代表人：赵大建	联系人：李微
		电话：010-59355941	传真：010-66553791
		客服电话：400-889-5618	网址：www.e5618.com
48	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	
49	国元证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号	
		法定代表人：凤良志	联系人：祝丽萍
		电话：0551-2257012	传真：0551-2272100
		客服电话：95578	网址：www.gyzq.com.cn
50	西部证券股份有限公司	注册地址：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼	
		法定代表人：刘建武	联系人：冯萍
		电话：029-87406488	传真：029-87406387
		客服电话：95582	网址：www.westsecu.com
51	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
52	德邦证券有 限公司	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
53	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
54	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
55	山西证券股份有 限公司	注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼	
		法定代表人：侯巍	联系人：郭熠
		电话：0351-8686659	传真：0351-8686619
		客服电话：400-666-1618、95573	
		网址：www.i618.com.cn	
56	湘财证券有限责 任公司	注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼	
		法定代表人：林俊波	联系人：钟康莺
		电话：021-68634518	传真：021-68865680
		客服电话：400-888-1551	网址：www.xcsc.com
57	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
58	日信证券有限责 任公司	注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号	
		法定代表人：孔佑杰	联系人：陈韦杉
		电话：010-66413306	传真：010-66412537

		客服电话：010-88086830	网址：www.rxzq.com.cn
59	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	
		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
60	广州证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
		法定代表人：刘东	联系人：林洁茹
		电话：020-88836655	传真：020-88836654
		客服电话：020-961303	网址：www.gzs.com.cn
61	天源证券经纪有限公司	注册地址：青海省西宁市长江路 53 号	
		法定代表人：林小明	联系人：王斌
		电话：0755-33331188	传真：0755-33329815
		客服电话：4006543218	网址：www.tyzq.com.cn
62	浙商证券股份有限公司	注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7	
		法定代表人：吴承根	联系人：毛亚莉
		电话：021-64318893	传真：021-64713795
		客服电话：967777	网址：www.stocke.com.cn
63	中银国际证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层	
		法定代表人：许刚	联系人：王炜哲
		电话：021-20328309	传真：021-50372474
		客服电话：4006208888	网址：www.bocichina.com
64	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
65	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	

66	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
67	开源证券有限责任公司	注册地址：西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
		法定代表人：李刚	联系人：王姣
		电话：029-68633210	客服电话：400-860-8866
		网址：www.kysec.cn	
68	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
69	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	
70	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）基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室	
		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.jjmmw.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 0571-88920897	网址：www.5ifund.com
8	上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	
		法定代表：其实	联系人：朱钰
		电话：021-54509988-1071	传真：021-64383798
		客服电话：4001818188	网址：www.1234567.com.cn
9	万银财富（北京）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
10	上海利得基金销售有限公司	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	
11	嘉实财富管理有限公司	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	

（二）登记结算机构

序号	机构名称	机构信息	
1	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：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

序号	机构名称	机构信息	
1	上海市通力律师事务所	住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼	
		负责人：韩炯	联系人：黎明
		联系电话：021-31358666	传真：021-31358600
		经办律师：吕红、黎明	

（四）审计基金财产的会计师事务所

序号	机构名称	机构信息	
1	普华永道中天会计师事务所（特殊普通	注册地址：中国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	

	合伙)	法人代表：杨绍信	
		联系人：魏佳亮	联系电话：021-61238888
		经办注册会计师：汪棣、魏佳亮	

十八、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》、《公开募集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 2014 年 6 月 16 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“一、绪言”中的相关内容；
- 3、更新了“二、释义”中的相关内容；
- 4、更新了“四、基金的投资”中投资组合报告，更新至2014年9月30日；
- 5、更新了“五、基金的业绩”中的相关内容，更新至2014年6月30日；
- 6、更新了“六、基金管理人”中的相关内容；
- 7、更新了“十八、基金托管人”中的相关内容；
- 8、更新了“二十、相关服务机构”中销售机构的相关信息；
- 9、更新了“二十三、对基金份额持有人的服务”中的相关信息；
- 10、更新了“二十四、其他应披露事项”，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。

国泰基金管理有限公司

二〇一四年十二月十七日