
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

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2013 年 3 月 7 日

公告日期：2013 年 3 月 4 日

目 录

一、重要声明与提示	1
二、基金概览	1
三、基金的募集与上市交易.....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况.....	6
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要	13
七、基金财务状况	13
八、基金投资组合	15
九、重大事件揭示	17
十、基金管理人承诺	18
十一、基金托管人承诺.....	18
十二、备查文件目录	18
附件 基金合同摘要	20

一、重要声明与提示

《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》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

中国证监会、深圳证券交易所对国泰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基金份额上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资人详细查阅刊登在2013年1月9日《中国证券报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金

基金份额名称：国泰房地产份额；场内简称：国泰地产；基金代码：160218

基金份额名称：房地产A份额；场内简称：房地产A；交易代码：150117

基金份额名称：房地产B份额；场内简称：房地产B；交易代码：150118

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金份额结构：本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“国泰房地产份额”，分为场外基础份额和场内基础份额。分级份额包括两类，稳健收益类份额（简称“房地产A份额”）和积极收益类份额（简称“房地产B份额”）。房地产A份额与房地产B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、房地产A份额、房地产B份额与国泰房地产份额的资产合并投资运作。

7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额，将被确认为国泰房地产份额。投资者场内认购所得的份额，将按1：1 的基金份额配比自动分拆为房地产A份额和房地产B份额。基金合同生效后，投资者认购所得的国泰房地产份额场内份额的分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

8、基金合同生效后，本基金国泰房地产份额（基金代码：160218）只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。本基金房地产A份额（场内简称：房地产A；交易代码：150117）与房地产B份额（场内简称：房地产B；交易代码：150118）只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

9、国泰房地产份额的申购与赎回

投资人可通过场外或场内两种方式，申购或赎回国泰房地产份额（基金代码：160218）。

办理国泰房地产份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理国泰房地产份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对房地产A份额或房地产B份额单独开放场内申购、赎回。

10、份额配对转换

份额配对转换是指本基金场内的国泰房地产份额与房地产A份额、房地产B份额之间的配对转换，包括分拆和合并。分拆指场内的国泰房地产份额按照1:1的基金份额配比分拆成房地产A份额和房地产B份额的行为。合并指房地产A份额和房地产B份额按照1:1的基金份额配比合并成国泰房地产份额场内份额的行为。份额配对转换业务已于2013年2月28日开始办理。

11、基金份额折算

基金份额定期折算的频率为每个会计年度进行1次（可不进行定期折算的除外）。基金份额不定期折算的条件是国泰房地产份额的份额净值大于或等于2.000时以及房地产B份额的份额净值小于或等于0.250。有关基金份额折算的约定，参见基金合同第二十二部分。定期折算基准日或不定期折算的基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

12、基金份额总额

截至2013年2月28日，本基金的份额总额为323,093,998.78份；其中，国泰房地产份额为319,833,786.78份；房地产A份额为1,630,106.00份；房地产B份额为1,630,106.00份。

13、基金份额净值

截至2013年2月28日，国泰房地产份额的基金份额净值为1.001元，房地产A份额的基金份额净值为1.004元，房地产B份额的基金份额净值为0.998元。

14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码

份额简称：房地产A，交易代码：150117

份额简称：房地产B，交易代码：150118

15、本次上市交易份额

房地产A：1,630,106.00份

房地产B：1,630,106.00份

16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

17、上市交易日期：2013年3月7日

18、基金管理人：国泰基金管理有限公司

19、基金托管人：中国银行股份有限公司

20、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可[2012]1654号

2、基金合同生效日:2013年2月6日

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金合同期限：不定期

5、发售日期：2013年1月14日至2013年1月31日

6、发售价格：1.00元人民币

7、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售

8、发售机构

（1）场内发售机构

本基金场内代销机构为具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司。具体名单为：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券。

（2）场外发售机构

1) 直销机构：国泰基金管理有限公司。

2) 代销机构：中国银行股份有限公司；中国建设银行股份有限公司；中国农业银行股份有限公司；交通银行股份有限公司；招商银行股份有限公司；上海银行股份有限公司；国泰君安证券股份有限公司；国信证券股份有限公司；中国银河证券股份有限公司；万联证券有限责任公司；上海证券有限责任公司；海通证券股份有限公司；申银万国证券股份有限公司；国盛证券有限责任公司；光大证券股份有限公司；渤海证券股份有限公司；长江证券股份有限公司；中国中投证券有限责任公司；厦门证券有限公司；中国国际金融有限公司；天相投资顾问有限公司；信达证券股份有限公司；华龙证券有限责任公司；平安证券有限责任

公司；德邦证券有限责任公司；中航证券有限公司；东海证券有限责任公司；华融证券股份有限公司；江海证券有限公司；西南证券股份有限公司；新时代证券有限责任公司；国都证券有限责任公司；深圳众禄基金销售有限公司；上海好买基金销售有限公司；杭州数米基金销售有限公司；上海长量基金销售投资顾问有限公司；北京展恒基金销售有限公司

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

10、认购资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为320,689,624.49元人民币，折合基金份额320,689,624.49份；认购资金在募集期间产生的银行利息共计121,772.66元人民币，折合基金份额121,772.66份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。上述资金总额已于2013年2月6日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11、基金备案情况

本基金于2013年2月6日验资完毕，2013年2月6日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2013年2月6日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2013年2月6日。

13、基金合同生效日的基金份额总额：320,811,397.15份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2013]72号

2、上市交易日期：2013年3月7日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资人在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：房地产A、房地产B

5、交易代码：房地产A为150117、房地产B为150118

6、本次上市交易份额：房地产A为1,630,106.00份；房地产B 为1,630,106.00份。

7、基金资产净值的披露：每个工作日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的次日公布该日的国泰房地产份额、房地产A份额与房地产B份额的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：

未上市交易的托管在场内的国泰房地产份额，基金份额持有人可选择将国泰房地产份额分拆为房地产A份额和房地产B份额后，即可上市流通。

未上市交易的托管在场外的国泰房地产份额，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后，选择将国泰房地产份额分拆为房地产A份额和房地产B份额后，即可上市流通。

（三）国泰房地产份额的日常申购、赎回情况

国泰房地产份额的日常申购业务于2013年2月26日起开始办理，日常赎回业务于2013年3月4日起开始办理。投资人可详细查阅刊登在2013年2月21日《中国证券报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告》。

（四）份额配对转换业务安排

国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）已于2013年2月28日起，开通国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的场内份额配对转换业务，即国泰房地产份额与房地产A份额、房地产B份额之间的配对转换，包括“分拆”和“合并”。投资人可详细查阅刊登在2013年2月26日《中国证券报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《关于开通国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告》。

中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理资格的证券公司名单进行更新，投资人可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站（www.chinaclear.cn）查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

截至2013年2月28日的基金份额持有情况：

国泰房地产份额持有人户数：1292户，平均每户持有基金份额：247,549.37

份；房地产A份额持有人户数：11户，平均每户持有的场内基金份额：148,191.45份；房地产B份额持有人户数：11户，平均每户持有的场内基金份额：148,191.45份。

机构投资者持有的本次上市交易的房地产A与房地产B的基金份额分别为1,250,069份和1,250,069份，分别占本次房地产A与房地产B上市交易基金份额比例为76.69%和76.69%；个人投资者持有的本次上市交易的房地产A与房地产B的基金份额分别为380,037份和380,037份，分别占本次房地产A与房地产B上市交易基金份额比例为23.31%和23.31%。

本次上市交易的房地产A与房地产B份额前十名持有人情况：

截止日期：2013年2月28日

序号	持有人名称（全称）	持有房地产 A 份额	占房地产 A 份额比（%）	持有房地产 B 份额	占房地产 B 份额比（%）
1	中国银河证券股份有限公司	1,000,048	61.35	1,000,048	61.35
2	华宝信托有限责任公司-单一类资金信托 R2007ZX115	175,015	10.74	175,015	10.74
3	曾晓军	130,009	7.98	130,009	7.98
4	董智力	100,013	6.14	100,013	6.14
5	中融国际信托有限公司-中融安苏 1 号证券投资	75,006	4.60	75,006	4.60
6	马煜静	25,004	1.53	25,004	1.53
7	江启如	25,003	1.53	25,003	1.53
8	毛建宇	25,003	1.53	25,003	1.53
9	王笑霏	25,003	1.53	25,003	1.53
10	陈云利	25,001	1.53	25,001	1.53
11	施宏伟	25,001	1.53	25,001	1.53
合计		1,630,106	100.00	1,630,106	100.00

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：国泰基金管理有限公司

设立日期：1998年3月5日

住所：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

法定代表人：陈勇胜

总经理：金旭

注册资本：壹亿壹千万元人民币

设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]5号

工商登记注册的法人营业执照文号：3100000000060090

经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务

联系人：何晔

联系电话：021-3856900，400-888-8688

股东及出资比例

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

2、内部组织结构及职能

公司目前下设22个部门和2个分公司，其主要职能如下：

基金管理部：负责权益类公募基金的投资管理工作；

固定收益部：负责固定收益类公募基金的投资和研究工作；

研究开发部：负责公司的投资策略、宏观经济的研究及上市公司的研究和调研等工作；

金融工程部：负责量化投资的研究、基金的风险与绩效分析、提供数量化技术支持等工作；

交易管理部：负责公司所有产品的交易执行、管理和风险控制等相关工作；

财富管理中心：负责企业年金、专户理财和投资咨询业务的市场拓展、投资

管理、产品设计、客户服务等相关工作；

销售部：负责基金代销机构的业务协调、基金产品的直销和代销业务等工作；

产品规划部：负责产品的基础研究及产品开发、设计、报批等工作；

国际业务部：负责国际业务的发展规划、市场拓展和管理等工作；

营销策划部：负责公司市场营销及品牌推广等工作；

客户服务部：负责公司的客户服务等工作；

稽核监察部：负责揭示、控制公司各项业务风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务；

运营管理部：负责公司基金和账户的估值核算、资金清算、注册登记、账户管理等工作；

信息技术部：负责公司信息系统的建设和维护等工作；

财务管理部：负责公司财务预决算及成本管理和财务分析等工作；

人力资源部：负责公司人力资源开发与管理工作；

财富大学：负责公司的各类培训工作；

总经理办公室：负责公司战略管理、办公管理及公司品牌建设等工作；

董事会办公室：负责董事会相关工作；

行政管理部：负责公司行政管理及后勤保障等工作；

渠道管理总部：负责渠道的开发及维护，以及产品上线项目谈判，销售推动等工作；

电子商务部(筹)：负责公司网络平台的销售及管理工作；

北京分公司：负责与主管机关及相关单位的联络沟通以及其它行政工作；

深圳分公司：负责所辖区域内基金销售工作。

3、人员情况

截至2012年12月31日，本基金管理人共有员工254人，其中138人具有硕士学历，11人具有博士学历。

4、信息披露负责人：林海中

咨询电话：400-888-8688

5、基金管理业务情况

截至2012年12月31日，国泰基金管理有限公司旗下共管理28只开放式基金、2只封闭式基金及多个社保投资组合、企业年金投资组合和特定客户资产管理计划。公募基金的资产管理规模为552.90亿元。

6、本基金基金经理

章赟，复旦大学理论物理学博士，英国剑桥大学管理学研究生。曾任平安资产管理公司资产配置经理、量化投资经理。2008年5月加盟国泰基金管理有限公司，任数量金融分析师。2010年3月至2011年5月任国泰沪深300指数基金的基金经理助理；2011年3月起担任国泰金融ETF及国泰金融ETF联接基金的基金经理；2011年5月起兼任国泰沪深300指数基金的基金经理；2012年3月起兼任中小板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；2013年2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。

（二）基金托管人

1、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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

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：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、

保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

3、证券投资基金托管情况

截至2012年12月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选LOF、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开

放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证300指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财7日盈债券型、长盛添利60天理财债券型发起式、平

安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)等189只证券投资基金，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）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

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、屈斯洁

联系人：魏佳亮

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要请见附件

七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明

书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金2013年2月28日资产负债表（未经审计）如下：

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金

2013年2月28日资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资产	本期末 2013 年 2 月 28 日
资产：	
银行存款	293,109,495.29
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	
其中：股票投资	
基金投资	
债券投资	
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	35,000,000.00
应收证券清算款	
应收利息	557,434.96
应收股利	
应收申购款	131,014.85
其他资产	
资产总计	328,797,945.10
负债与持有人权益	
负债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	4,983,946.55
应付赎回款	
应付管理人报酬	193,564.80
应付托管费	38,712.97
应付销售服务费	
应付交易费用	
应交税费	
应付利息	
应付利润	

预提费用	
其他负债	15,755.86
负债合计	5,231,980.18
所有者权益：	
实收基金	323,093,242.31
未分配利润	472,722.61
所有者权益合计	323,565,964.92
负债和所有者权益总计	328,797,945.10

注：报告截止日2013年2月28日，国泰房地产基金份额净值1.001元，房地产A份额净值：1.004元，房地产B份额净值：0.998元；基金份额总额323,093,998.78份，其中国泰房地产基金份额总额：319,833,786.78份，房地产A份额总额：1,630,106.00份，房地产B份额总额：1,630,106.00份。

八、基金投资组合

截至2013年2月28日，国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的投资组合如下：

1、基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	35,000,000.00	10.64%
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付 金合计	293,109,495.29	89.15%
6	其他各项资产	688,449.81	0.21%
7	合计	328,797,945.10	100.00%

2、按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、 皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、 塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、 仪表	-	-
C8	医药、生物制 品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生 产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

本基金本报告期末未持有股票投资。

3、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

4、按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5、按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：

本基金本报告期末未持有债券投资。

6、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细：

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、投资组合报告附注

（1）本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

（2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	557,434.96
5	应收申购款	131,014.85
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	688,449.81

（4）截至2013年2月28日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

（5）截至2013年2月28日，本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同已于2013年2月6日正式生效，基金管理人于2013年2月7日在《中国证券报》及基金管理人网站（www.gtfund.com）上刊登《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同生效公告》，于2013年2月26日在《中国证券报》及基金管理人网站（www.gtfund.com）上刊登《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金份额配对转换业务的公告》。

国泰房地产份额的申购于2013年2月26日起开始办理，国泰房地产份额的赎回于2013年3月4日起开始办理，投资人可详细查阅刊登在2013年2月21日《中国证券报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上刊登的《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公

告》。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、

《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会核准国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金募集的文件；

-
- （二）《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》；
 - （三）《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金招募说明书》；
 - （四）《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金托管协议》；
 - （五）法律意见书；
 - （六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
 - （七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
 - （八）中国证监会要求的其他文件。

国泰基金管理有限公司

2013 年 3 月 4 日

附件 基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、

赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定国泰房地产份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按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基金收益；

（14）按规定受理国泰房地产份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回

款项；

（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）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实施其他法律行为；

（24）基金管理人应当在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

3、基金托管人的权利

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金

财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、国泰房地产份额的申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果房地产A份额和房地产B份额的运作出现终止，则在终止房地产A份额和房地产B份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

(1) 分享基金财产收益；

-
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
 - (3) 依法转让其持有的房地产A份额和房地产B份额，依法申请赎回其持有的国泰房地产份额；
 - (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
 - (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
 - (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
 - (7) 监督基金管理人的投资运作；
 - (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
 - (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务

- (1) 认真阅读并遵守基金合同；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

7、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金资产账户名称而有所改变。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由国泰房地产份额、房地产A份额与房地产B份额基金份额持有人独立进行表决。国泰房地产份额、房地产A份额与房地产B份额基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥

有同等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认/申购、场外认/申购、上市交易、分拆合并）而有所差异。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- （8）本基金与其他基金合并；
- （9）终止房地产A份额与房地产B份额的运作；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②指单独或合计持有国泰房地产份额、房地产A份额与房地产B份额各自的基金总份额10%以上基金份额的基金份额持有人，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- （13）法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费率、基金托管费率和其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；
- （3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 单独或合计持有10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

(4) 单独或合计持有10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （4）会务常设联系人姓名、电话；
- （5）权益登记日；

（6）如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和中国证监会允许的其他方式召开。会议的召开方式由会议召集人确定。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上。（①含50%，下同；②指全部有效凭证所对应的国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额分别占权益登记日国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自基金总份额50%以上，下同）；

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；

(3) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额分别占权益登记日国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自基金总份额50%以上（含50%）；

(4) 直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本条前述第2款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合计持有10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做

出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合计持有10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

8、表决

(1) 国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自类别内的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自类别内的表决权的50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式、终止房地产A份额和房地产B份额的运作、终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

9、计票

（1）现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名

监票人进行计票，并由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体上公告。

（4）如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金收益分配原则、执行方式

本基金（包括国泰房地产份额、房地产A份额、房地产B份额）不进行收益分配。

在本基金国泰房地产份额、房地产A份额、房地产B份额的运作期间内，如果法律法规或监管部门取消上述限制，则基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，在履行适当程序后，可以对上述收益分配原则进行修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止房地产A份额、房地产B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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。

2、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1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。

3、不列入基金费用的项目

本条第1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。

4、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。

5、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。

（五）基金财产的投资方向和投资限制

1、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。

2、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，（但须符合中国证监会相关

规定)。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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、投资限制

(1) 禁止用本基金资产从事以下行为

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7) 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；
- 8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(2) 基金投资组合比例限制

1) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

2) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的5%；本基金持有的同一资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

3) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起三个月内全部卖出；

4) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

5) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

6) 本基金持有的现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%；

7) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于股票资产的90%；

8) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

①在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

②在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

④基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

⑥每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

(3) 若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法

履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

2、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

3、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

（1）本基金的基金合同生效后，在开始办理国泰房地产份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自的基金份额净值；

（2）在开始办理国泰房地产份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自的份额净值和基金份额累计净值；

（3）基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、国泰房地产份额、房地产A份额和房地产B份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

（2）变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（3）但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- （3）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

如果本基金合同终止，房地产A份额和房地产B份额将全部折算为场内国泰房地产份额，份额折算基准日为本基金合同终止日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日），份额折算方式和份额折算计算方式，适用本基金合同第二十三章的约定。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

（2）基金财产清算组

1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

（3）清算程序

- 1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

-
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;
 - 4) 对基金财产进行评估和变现;
 - 5) 制作清算报告;
 - 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
 - 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
 - 8) 对基金财产进行分配。

(4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

- 1) 支付清算费用;
- 2) 交纳所欠税款;
- 3) 清偿基金债务;
- 4) 按基金份额持有人持有的国泰房地产基金份额的份额比例进行分配。

基金财产未按前款1)、2)、3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等, 在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(6) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 报中国证监会备案并公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

(八) 争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决, 但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的, 则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为上海。仲裁裁决是

终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

国泰基金管理有限公司

2013年3月4日