
国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金之
有色 A 与有色 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：中国建设银行股份有限公司

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：2015 年 4 月 15 日

公告日期：2015 年 4 月 10 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.....	7
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	15
七、基金财务状况.....	16
八、基金投资组合.....	17
九、重大事件揭示.....	20
十、基金管理人承诺.....	20
十一、基金托管人承诺.....	20
十二、备查文件目录.....	21
附件 基金合同摘要.....	22

一、重要声明与提示

《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金之有色A与有色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，国泰国证有色金属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有色金属行业指数分级证券投资基金之有色A与有色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2015年3月11日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰国证有色金属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：国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金

基金份额名称：国泰有色份额；场内简称：国泰有色；基金代码：160221

基金份额名称：有色A份额；场内简称：有色A；交易代码：150196

基金份额名称：有色B份额；场内简称：有色B；交易代码：150197

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“国泰有色份额”，分为场外国泰有色份额和场内国泰有色份额。分级份额包括两类，稳健收益类份额（简称“有色A份额”）和积极收益类份额（简称“有色B份额”）。有色A份额与有色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、有色A份额、有色B份额与国泰有色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，将被确认为国泰有色份额。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有色A份额和有色B份额。基金合同生效后，投资者认购所得的国泰有色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，国泰有色份额（基金代码：160221）设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。有色A份额（场内简称：有色A；交易代码：150196）与有色B份额（场内简称：有色B；交易代码：150197）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、国泰有色份额的申购与赎回

投资人可通过场外或场内两种方式，申购或赎回国泰有色份额（基金代码：160221）。

办理国泰有色份额场内申购、赎回业务的销售机构为具有基金销售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。办理国泰有色份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外销售机构。本基金不对有色A份额或有色B份额单独开放场内申购、赎回。

10、场内份额配对转换

场内份额配对转换是指本基金场内的国泰有色份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指场内的国泰有色份额按照1：1的基金份额配比分拆成有色A份额和有色B份额的行为。合并指有色A份额和有色B份额按照1：1的基金份额配比合并成国泰有色份额场内份额的行为。

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有色份额的份额净值大于或等于1.5000元以及有色B份额的份额净值小于或等于0.2500元。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“第二十一部分 基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

12、基金份额总额

截至2015年4月8日，本基金的份额总额为416,572,317.68份；其中，国泰有色份额为107,754,667.68份；有色A份额为154,408,825份；有色B份额为154,408,825份。

13、基金份额净值

截至2015年4月8日，国泰有色份额的基金份额净值为1.0000元，有色A份额的基金份额净值为1.0018元，有色B份额的基金份额净值为0.9982元。

14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码

份额简称：有色A，交易代码：150196

份额简称：有色B，交易代码：150197

15、本次上市交易份额

有色A：154,408,825份

有色B：154,408,825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：2015年4月15日

18、基金管理人：国泰基金管理有限公司

19、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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[2014]360号

2、基金合同生效日：2015年3月30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：2015年3月16日至2015年3月24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

本基金场内销售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位，具体名单以深圳证券交易所网站披露为准。

截止2014年7月25日，下列97家会员已具有基金申购赎回权限：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、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、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、宏信证券、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、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、开源证券、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（排名不分先后）

（2）场外发售机构

1）直销机构：国泰基金管理有限公司。

2）其他销售机构：中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、上海证券有

限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城国瑞证券有限公司、华宝证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、信达证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、江海证券有限公司、广州证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、北京增财基金销售有限公司

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

10、认购资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为416,538,499.98元人民币，折合基金份额416,538,499.98份；认购资金在募集期间产生的银行利息共计34,709.70元人民币，折合基金份额34,709.70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2015年3月27日全额划入本基金在基金托管人中国建设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2015年3月30日验资完毕，2015年3月30日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2015年3月30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：2015年3月30日。

13、基金合同生效日的基金份额总额：416,573,209.68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[2015]138号

2、上市交易日期：2015年4月15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：有色A、有色B

5、交易代码：有色A为150196、有色B为150197

6、本次上市交易份额：有色A为154,408,825份；有色B为154,408,825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有色份额、有色A份额与有色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有色份额，基金份额持有人可选择将国泰有色份额分拆为有色A份额和有色B份额后，即可上市流通。

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

（三）国泰有色份额的日常申购、赎回情况

国泰有色份额的日常申购、赎回业务将于2015年4月15日起开始办理。投资人可详细查阅刊登在2015年4月10日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》。

（四）份额配对转换业务安排

本基金将于2015年4月15日起开始办理份额配对转换业务，投资人可详细查阅刊登在2015年4月10日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上公告的《关于开通国泰国证有色金属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，本公司对该名单及其更新不再另行公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

截至2015年4月8日的基金份额持有情况：

国泰有色份额持有人户数：1,459户，平均每户持有基金份额：73,855.15 份；
有色A份额持有人户数：1,644户，平均每户持有的场内基金份额：93,922.64份；
有色B份额持有人户数：1,644户，平均每户持有的场内基金份额：93,922.64份。

机构投资者持有的本次上市交易的有色A与有色B的基金份额分别为33,130,376份和33,130,376份，分别占本次有色A与有色B上市交易基金份额比例为21.46%和21.46%；个人投资者持有的本次上市交易的有色A与有色B的基金份额分别为121,278,449份和121,278,449份，分别占本次有色A与有色B上市交易基金份额比例为78.54 %和78.54%。

本次上市交易的有色A与有色B份额前十名持有人情况：

截止日期：2015 年 4 月 8 日

序号	持有人名称（全称）	持有有色 A 份额	占有色 A 份额比（%）	持有有色 B 份额	占有色 B 份额比（%）
1	百年人寿保险股份有限公司一分红保险产品	10,000,770.00	6.48%	10,000,770.00	6.48%
2	信诚人寿保险有限公司一分红一个险分红	7,500,218.00	4.86%	7,500,218.00	4.86%
3	信诚人寿保险有限公司一万能一三连宝投资组合	7,475,218.00	4.84%	7,475,218.00	4.84%
4	王安成	6,000,466.00	3.89%	6,000,466.00	3.89%
5	招商证券股份有限公司	5,000,097.00	3.24%	5,000,097.00	3.24%

6	路金兄	4,175,081.00	2.70%	4,175,081.00	2.70%
7	南京彤天科技实业有 限责任公司	2,500,048.00	1.62%	2,500,048.00	1.62%
8	费颖慧	1,500,145.00	0.97%	1,500,145.00	0.97%
9	杨磊	1,200,023.00	0.78%	1,200,023.00	0.78%
10	刘丙治	1,000,023.00	0.65%	1,000,023.00	0.65%
合 计		46,352,089.00	30.02%	46,352,089.00	30.02%

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：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

法定代表人：陈勇胜

总经理（代任）：陈勇胜

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：310000000060090

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：021-31089000，400-888-8688

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

公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事4名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

在组织结构方面，公司设立的分管领导议事会议、执行委员会会议、投资决策委员会、风险控制委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

3、人员情况

截至2015年3月31日，公司正式员工254人，其中56%（143人）的员工具有硕士以上学历。

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2015年3月31日，本基金管理人共管理51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、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰6个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰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、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证TMT50指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金。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。

6、本基金基金经理

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、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、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，2014 年 11 月起兼任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数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

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】143号

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

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，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。

2、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等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，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。

3、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。

（三）基金验资机构

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

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。

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金2015年4月8日资产负债表（未经审计）如下：

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金

2015年4月8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 2015 年 4 月 8 日
资产：	
银行存款	66,589,037.76
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	35,448,555.00
其中：股票投资	35,448,555.00
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	210,000,000.00
应收证券清算款	118,866,396.35
应收利息	112,309.77
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	431,016,298.88
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	14,256,372.64
应付赎回款	-
应付管理人报酬	102,719.00

应付托管费	22,598.17
应付销售服务费	-
应付交易费用	27,999.09
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	12,996.40
其他负债	6,697.74
负债合计	14,429,383.04
所有者权益：	
实收基金	416,573,209.68
未分配利润	13,706.16
所有者权益合计	416,586,915.84
负债和所有者权益总计	431,016,298.88

注：报告截止日2015年4月8日，国泰有色份额净值：1.0000元，有色A份额净值：1.0018元，有色B份额净值：0.9982元；基金份额总额：416,572,317.68份，其中国泰有色份额总额：107,754,667.68份，有色A份额总额：154,408,825份，有色B份额总额：154,408,825份。

八、基金投资组合

截至2015年4月8日，国泰国证有色金属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	35,448,555.00	8.22%
	其中：股票	35,448,555.00	8.22%
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	210,000,000.00	48.72%
	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	66,589,037.76	15.45%
6	其他各项资产	118,978,706.12	27.60%

7	合计	431,016,298.88	100.00%
---	----	----------------	---------

2、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	13,184,318.00	3.16%
C	制造业	22,264,237.00	5.34%
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	-	-
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	-	-
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	35,448,555.00	8.51%

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

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	601899	紫金矿业	555,300	2,482,191.00	0.60%

2	600111	北方稀土	88,000	2,453,440.00	0.59%
3	601600	中国铝业	247,800	1,751,946.00	0.42%
4	600219	南山铝业	139,200	1,634,208.00	0.39%
5	600547	山东黄金	49,000	1,361,220.00	0.33%
6	600489	中金黄金	104,300	1,360,072.00	0.33%
7	000060	中金岭南	88,400	1,334,840.00	0.32%
8	601168	西部矿业	121,300	1,310,040.00	0.31%
9	000831	五矿稀土	38,900	1,307,040.00	0.31%
10	600362	江西铜业	57,100	1,264,765.00	0.30%

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	118,866,396.35
3	应收股利	
4	应收利息	112,309.77
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	118,978,706.12

（4）截至2015年4月8日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 截至2015年4月8日，本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同已于2015年3月30日正式生效，基金管理人于2015年3月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站（www.gtfund.com）上刊登《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同生效公告》。

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《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》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《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》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《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》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；基金管理人或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，投资人可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会关于准予国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金募集注册的文件

（二）中国证监会关于国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金延期募集备案的回函

（三）《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》；

（四）《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金招募说明书》；

（五）《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金托管协议》；

（六）法律意见书；

（七）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（八）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（九）中国证监会要求的其他文件。

国泰基金管理有限公司

2015 年 4 月 10 日

附件 基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (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) 按照规定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，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人的利益；
- (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/期货经纪商或其他为

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、转换的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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，确定国泰有色份额申购、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）按规定受理国泰有色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人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《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

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(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人的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

4、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(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、证券账户、期货账户等投资所需账户，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、国泰有色份额的申购、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管理人、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议；

（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

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（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）依法转让其持有的有色 A 份额和有色 B 份额，依法申请赎回其持有的国泰有色份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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议；
 - (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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由国泰有色份额、有色 A 份额与有色 B 份额基金份额持有人独立进行表决。国泰有色份额、有色 A 份额与有色 B 份额基金份额持有人持有的每一基金份额在其份额类别内拥有平等的投票权，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、自动分离、分拆、合并或上市交易）而有所差异。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 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）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止有色 A 份额与有色 B 份额的运作；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 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“单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额”指单独或合计持有国泰有色份额、有色 A 份额与有

色 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；

（13）终止有色 A 份额、有色 B 份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（14）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（15）法律法规、《基金合同》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。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整国泰有色份额的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

（4）因相应的法律法规、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（6）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

3、召集方式

（1）除法律法规规定或《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）基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

（3）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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

（4）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额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，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（含 10%）基金份额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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

（5）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人就同一事项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，单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额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。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）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

4、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

5、开会方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式以及法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（①含二分之一，下同；②指全部有效凭证所对应的国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额分别占权益登记日国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自基金总份额二分之一以上，下同）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额应不少于本基金在权益登记日国泰有色

份额、有色 A 份额、有色 B 份额各自基金总份额的三分之一。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额分别占权益登记日国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额小于在权益登记日国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额各自基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额各自基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

4) 上述第 3) 项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符。

(3) 在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。

(4) 在会议召开方式上, 本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会, 会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决, 具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

6、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项, 如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、终止有色 A 份额与有色 B 份额的运作、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后, 对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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

1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表, 在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权其出席会议的代表主持; 如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一) 选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会, 不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

2) 通讯开会

在通讯开会的情况下, 首先由召集人提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决, 在公证

机关监督下形成决议。

7、表决

国泰有色份额、有色 A 份额和有色 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。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自类别内的表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自类别内的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止有色 A 份额和有色 B 份额的运作、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面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。

8、计票

（1）现场开会

1) 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和代理人中选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共同担任监票人；如大会由基金

份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,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选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

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) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

9、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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议。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、基金托管人均有约束力。

10、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等的规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内

容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

本基金分级份额存续期间暂不进行收益分配。

在本基金国泰有色份额、有色 A 份额、有色 B 份额的运作期间内，基金管理人可根据实际情况，在履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，并相应修改有色 A 份额、有色 B 份额基金份额净值的计算公式等，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，并报中国证监会备案后，如果终止有色 A 份额、有色 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

（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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券/期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；

10、基金证券/期货账户的开户费用、银行账户维护费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数使用许可费

本基金的标的指数使用许可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（基金合同生效日所在季度除外）。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的标的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用许可费每日计提，按季支付。标的指数使用许可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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人可根据指数使用许可协议，对上述计提标准和计提方式进行合理变更，此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在更新招募说明书或其他公告中披露基金最新适用的计提标准和计提方法。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）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、债券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金所持有的股票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%，且不低于非现金资产的 80%。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，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。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金所持有的股票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%，且不低于非现金资产的 80%；

（2）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；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（7）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 20%；

（8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（9）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%；

（10）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。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 3 个月内予以全部卖出；

(11) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金的总资产，所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(13) 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%；

(14) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在相关证券可交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起

开始。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）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；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

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

《基金合同》生效后，在有色 A 份额和有色 B 份额开始上市交易或者国泰有色份额开始办理申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自的基金份额净值。

在有色 A 份额和有色 B 份额开始上市交易或者国泰有色份额开始办理国泰有色份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售机构以及其他媒介，披露开放日的国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、国泰有色份额、有色 A 份额和有色 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媒介上。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

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基金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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进

行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 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；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自的应计分配比例，并据此由国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决，但若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，仲裁地点为北京市，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

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》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

国泰基金管理有限公司

2015 年 4 月 10 日