

---

# 国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）

## 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7日

公告日期：2015年4月1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.....	2
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况.....	4
五、基金主要当事人简介.....	6
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	14
八、基金投资组合.....	14
九、重大事件揭示.....	18
十、基金管理人承诺.....	27
十一、基金托管人承诺.....	27
十二、备查文件目录.....	27
附件 基金合同摘要.....	29

## 一、重要声明与提示

《国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）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》的规定编制国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）（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大宗商品配置证券投资基金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2012年3月21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](http://www.gtfund.com)）上公告的《国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）招募说明书》。

## 二、基金概览

1、基金名称：国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）

2、基金简称：国泰商品

3、基金场内简称：国泰商品

4、基金代码：160216

5、基金类型：LOF

8、基金份额总额：

截至2015年3月30日，本基金的份额总额为492,827,858.92份

9、基金份额净值：

截至2015年3月30日，国泰商品份额的基金份额净值为0.630元

10、本次上市交易份额：398,800,917份

11、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

- 
- 12、上市交易日期：2015年4月7日
  - 13、基金管理人：国泰基金管理有限公司
  - 14、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
  - 15、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：中国证券监督管理委员会，2011年7月14日证监许可【2011】1094号
- 2、基金合同生效日：2012年5月3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：2012年3月26日至2012年4月25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。

#### （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：

中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、洛阳银行股份有限公司、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、中

---

国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、万联证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、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、中国国际金融有限公司、华福证券有限责任公司、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、国元证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、广州证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司等。

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309,147,715.70元人民币，折合基金份额309,147,715.70份；认购资金在募集期间产生的银行利息共计144,210.93元人民币，折合基金份额144,210.93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2012年5月3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2012年5月3日验资完毕，2012年5月3日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2012年5月3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：2012年5月3日。

13、基金合同生效日的基金份额总额：309,291,926.63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】

---

118号

2、上市交易日期：2015年4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、基金场内简称：国泰商品

5、交易代码：160216

6、本次上市交易份额：398,800,917份

7、未上市交易份额的流通规定：

未上市交易的托管在场外的国泰大宗商品份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

（三）本基金转托管的主要内容

为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）持有人户数

截至2015年3月30日，本基金份额持有人户数为4,211户，平均每户持有的基金份额为117,033.45份。场内基金份额持有人户数为2,084户，平均每户持有的基金份额为191,363.20份。

（二）持有人结构

截至2015年3月30日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为26,868,263份，占基金总份额的5.45%；个人投资者持有的基金份额为465,959,595.92份，占基金总份额的94.55%。其中，场内机构投资者持有的基金份额为26,868,263份，占基金总份额的5.45%；个人投资者持有的基金份额为371,932,654份，占场内基金总份额的93.26%。

（三）场内前十名基金份额持有人情况

截至2015年3月30日，场内前十名基金份额持有人情况如下表。

截止日期：2015年3月30日

序号	持有人名称（全称）	持有 份额	占场内基金份额的比 例（%）
1	招商证券投资有限 公司	14,879,464.00	3.73%
2	中信信托有限责任 公司—中信聚益之 锐意进取管理型风 险缓冲金融投资集 合资金信托计划	11,027,941.00	2.77%
3	周永良	10,330,882.00	2.59%
4	林海平	8,940,387.00	2.24%
5	韩琳	7,373,156.00	1.85%
6	傅林萍	7,351,470.00	1.84%
7	彭泽勇	4,435,102.00	1.11%
8	朴彩瑛	3,663,454.00	0.92%
9	蒋一科	3,559,757.00	0.89%
10	袁丰	3,537,819.00	0.89%
合计		75,099,432.00	18.83%

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：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3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、总经理办公会议、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2月28日，公司正式员工252人，其中53%（134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2月28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、国泰中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、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金(由国泰6个月短期理财债券型证券投资基金转型而来)、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)。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

邱晓华,硕士研究生,曾任职于新华通讯社、北京首都国际投资管理有限公司、银河证券。2007年4月加入国泰基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理。2011年4月至2014年6月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理;2011年6月起兼任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理;2013年8月起兼任国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理;2014年5月起兼任国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金的基金经理;2014年11月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)的基金经理。

白海峰,中国改革发展研究院金融学在职博士,哥伦比亚大学商学院 MBA,

---

北京大学理学硕士，北京大学经济学，理学双学士，曾就职于纽约太平洋资产管理公司（NYPC），任高级投资经理，2010年加盟国泰基金，历任首席宏观经济学家助理，宏观经济研究员，国际业务部负责人，2015年1月起任国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)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】

43号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12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

联系电话：010-67595096

传真：010-66275830

联系人：田青

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。

## 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）境外托管人

##### 1、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

截止到2013年12月31日的所有者权益（Shareholder's Equity）：203.8亿美元

## 2、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。

## 3、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。

## （四）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。

国泰大宗商品配置证券投资基金2015年3月30日资产负债表（未经审计）如下：

### 国泰大宗商品配置证券投资基金

#### 2015年3月30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 3 月 30 日
资产：	
银行存款	122,075,453.77
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	196,889,700.62
其中：股票投资	-
基金投资	196,889,700.62
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	20,805.74
应收股利	-
应收申购款	656,727.58
其他资产	-
资产总计	319,642,687.71
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	-
应付赎回款	9,374,942.85
应付管理人报酬	346,792.63

应付托管费	80,918.29
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	144,165.25
负债合计	9,946,819.02
所有者权益：	-
实收基金	491,677,238.58
未分配利润	-181,981,369.89
所有者权益合计	309,695,868.69
负债和所有者权益总计	319,642,687.71

注：报告截止日2015年3月30日，国泰大宗商品份额净值0.630元；基金份额总额491,677,238.58份。

## 八、基金投资组合

截至2015年3月30日国泰大宗商品配置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	基金投资	196,889,700.62	61.60
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	-	-
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	银行存款和结算备付 金合计	122,075,453.77	38.19
7	其他各项资产	677,533.32	0.21
8	合计	319,642,687.71	100.00

### 2、按行业分类的股票投资组合

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、按市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	占基金资产净值比例 (%)
1	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF 基金	开放式	US Commodity Funds LLC	47,608,040.70	15.37
2	PROSHARES ULTRA BLOOMBERG CRUDE OIL	ETF 基金	开放式	ProShares	47,215,681.92	15.25
3	UNITED STATES BRENT OIL FUND	ETF 基金	开放式	US Commodity Funds LLC	41,124,603.52	13.28
4	POWERSHARES DB OIL FUND	ETF 基金	开放式	DB Commodity Services	40,511,001.05	13.08
5	UNITED STATES 12 MONTH OIL FUND LP	ETF 基金	开放式	US Commodity Funds LLC	20,335,065.24	6.57

6	POWERSHARES DB PRECIOUS METALS FUND	ETF 基金	开 放 式	DB Commodity Services	22,724.88	0.01
7	POWERSHARES DB AGRICULTURE FUND	ETF 基金	开 放 式	DB Commodity Services	13,717.21	0.00
8	ISHARES S&P GSCI COMMODITY INDEX FUND	ETF 基金	开 放 式	BlackRock Fund Advisor	12,120.75	0.00
9	POWERSHARES DB COMMODITY INDEX FUND	ETF 基金	开 放 式	DB Commodity Services	10,604.13	0.00
10	ISHARES SILVER TRUST	ETF 基金	开 放 式	BlackRock Fund Advisor	9,812.04	0.00

#### 8、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	20,805.74
5	应收申购款	656,727.58
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	677,533.32

(4) 截至2015年3月30日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 截至2015年3月30日，本基金未持有权证。

## 九、重大事件揭示

本基金以下信息披露事项均已通过指定报刊以及基金管理人网站(www.gtfund.com)进行公开披露, 并已报送相关监管部门备案。

序号	公告日期	公告名称	报纸
1	2012/5/4	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
2	2012/6/1	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
3	2012/6/1	国泰基金管理有限公司关于增加国泰大宗商品配置证券投资基金参加各渠道网上银行、基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
4	2012/6/28	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
5	2012/7/9	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加众禄基金网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
6	2012/7/9	关于新增众禄基金代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
7	2012/7/13	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加数米基金网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
8	2012/7/13	关于新增数米基金网代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
9	2012/7/13	国泰基金管理有限公司关于开通银联支付浦发银行、中信银行、光大银行等5家银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》

10	2012/8/9	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
11	2012/8/9	关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
12	2012/8/16	国泰基金管理有限公司关于开通通联支付中国农业银行借记卡、中国建设银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
13	2012/8/18	关于新增好买基金代理销售国泰基金旗下部分基金并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
14	2012/8/22	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
15	2012/8/22	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》
16	2012/8/29	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
17	2012/9/6	国泰基金管理有限公司关于调整旗下基金在众禄基金定期定额投资起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
18	2012/9/6	国泰基金管理有限公司关于开展公司网上交易定期定额赎回业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
19	2012/9/14	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加浙商证券有限责任公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
20	2012/9/14	关于新增西南证券股份有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
21	2012/9/14	关于新增新时代证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》

22	2012/9/14	关于新增浙商证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
23	2012/9/14	关于新增中银国际证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
24	2012/10/16	国泰基金管理有限公司关于在国海证券开通旗下基金定期定额投资计划及参加定投网上交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
25	2012/10/18	国泰基金管理有限公司关于开通通联支付交通银行、邮储银行等四家银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
26	2012/10/30	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）临时暂停申购赎回等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
27	2012/10/31	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）临时暂停申购赎回等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
28	2012/11/13	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
29	2012/11/19	国泰基金管理有限公司关于开通银联支付广发银行、浙商银行、温州银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
30	2012/11/20	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
31	2012/11/28	国泰基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加中国银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
32	2012/11/29	关于新增国都证券有限责任公司代理销售国泰基金旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
33	2012/12/5	国泰基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户直销网上交易业务并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
34	2012/12/11	国泰基金管理有限公司关于提	《中国证券报》、《上

		醒投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
35	2012/12/19	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
36	2012/12/26	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
37	2012/12/31	国泰基金管理有限公司关于继续参加中信建投证券基金定期定额业务网上申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
38	2013/1/16	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
39	2013/1/25	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加上海天天基金销售有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
40	2013/1/25	关于新增上海天天基金销售有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
41	2013/2/6	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
42	2013/3/6	国泰基金管理有限公司副总经理离任公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
43	2013/3/26	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
44	2013/4/1	国泰基金管理有限公司关于开通通联支付工商银行、中国银行和民生银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
45	2013/4/23	国泰基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户网上直销定投业务并实施费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
46	2013/4/24	关于新增东莞农村商业银行、广州农村商业银行代理销售国	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券

		泰基金旗下部分产品并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	时报》、《证券日报》
47	2013/4/26	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
48	2013/5/4	关于新增宁波银行代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
49	2013/5/22	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
50	2013/5/31	国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
51	2013/6/18	关于新增上海利得基金销售有限公司代理销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
52	2013/6/18	关于国泰基金管理有限公司旗下基金参加上海利得基金销售有限公司网上交易申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
53	2013/6/25	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
54	2013/6/29	国泰基金管理有限公司关于在好买基金开通旗下基金定期定额业务及参加定投网上交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
55	2013/7/1	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
56	2013/7/3	国泰基金管理有限公司关于旗下开放式基金继续参加交通银行网上银行及手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
57	2013/7/10	国泰基金管理有限公司关于网上交易平台支持港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
58	2013/7/18	国泰基金管理有限公司关于开	《中国证券报》、《上

		通通联支付汉口银行借记卡与大连银行借记卡网上基金直销业务并实施申购费率优惠的公告	海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
59	2013/7/19	关于诺亚正行新增销售国泰基金管理有限公司旗下基金并开通定期定额投资、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
60	2013/8/14	关于新增开源证券有限责任公司销售国泰基金旗下部分产品并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
61	2013/8/22	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
62	2013/8/28	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
63	2013/8/29	关于国泰基金管理有限公司新增北京展恒基金销售旗下基金并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
64	2013/9/18	国泰基金管理有限公司副总经理离任公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
65	2013/11/1	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
66	2013/11/25	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
67	2013/12/6	关于万银财富新增销售国泰基金管理有限公司旗下基金并开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
68	2013/12/10	关于国泰基金旗下基金参加嘉实财富管理有限公司网上及柜台交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
69	2013/12/10	关于新增嘉实财富管理有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
70	2013/12/19	国泰大宗商品配置证券投资基金	《中国证券报》、《上

		金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	海证券报》、《证券时报》
71	2013/12/24	关于新增晋商银行股份有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
72	2013/12/26	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
73	2014/1/15	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
74	2014/1/16	关于同花顺基金新增销售国泰基金管理有限公司旗下基金并开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
75	2014/2/12	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
76	2014/2/24	国泰基金管理有限公司总部迁址公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
77	2014/3/15	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
78	2014/4/10	国泰基金管理有限公司关于参加中金公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
79	2014/4/12	关于浙商银行股份有限公司新增销售国泰基金管理有限公司旗下部分基金并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
80	2014/4/15	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
81	2014/4/29	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
82	2014/5/21	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
83	2014/6/6	国泰基金管理有限公司关于董	《中国证券报》、《上

		事、监事、高级管理人员及其他从业人员子公司兼职情况公告	海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
84	2014/7/1	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
85	2014/7/1	国泰基金管理有限公司关于参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
86	2014/8/20	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
87	2014/8/27	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
88	2014/9/24	国泰基金管理有限公司副总经理离任公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
89	2014/10/29	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
90	2014/10/29	国泰基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
91	2014/11/5	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
92	2014/11/24	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
93	2014/12/11	国泰基金管理有限公司关于在华宝证券开通旗下基金定期定额投资计划及参加网上交易申购（含定投）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
94	2014/12/13	国泰基金管理有限公司总经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
95	2014/12/19	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

96	2014/12/24	关于新增华安证券代理销售国泰基金旗下部分产品并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
97	2014/12/26	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
98	2015/1/5	关于新增北京增财基金销售有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
99	2015/1/14	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
100	2015/1/17	国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
101	2015/1/31	国泰基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员及其他从业人员子公司兼职情况公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
102	2015/2/11	国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
103	2015/2/13	关于新增中原证券股份有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
104	2015/3/4	国泰基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
105	2015/3/16	关于新增国泰基金管理有限公司旗下部分基金参加齐鲁证券网上交易申购（含定投）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
106	2015/3/21	关于新增上海联泰资产管理有限公司销售国泰基金旗下部分基金并开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》

---

## 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）中国证监会核准国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）募集的文件；

- 
- (二) 《国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）基金合同》；
  - (三) 《国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）招募说明书》；
  - (四) 《国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）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

2015年4月1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

#### (一) 基金管理人的权利

- 1.自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- 2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 3.发售基金份额；
- 4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 5.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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据有关规定，选择、更换或撤消证券经纪代理商以及证券登记机构，并对其行为进行必要的监督；
- 7.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 8.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 9.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；
- 10.自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 11.选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 12.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 13.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

- 
- 14.依法召集基金份额持有人大会；
  - 15.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(二) 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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，基于谨慎的原则，控制基金资产的流动性风险，保证基金资产正常运作；

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. 确保管理人发送的交易数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据真实、准确、完整，因数据原因造成基金资产或其他当事人的财产损失，由基金管理人承担赔偿责任；

6. 严格遵守境内有关法律法规、基金合同的规定，始终将基金持有人的利益置于首位，以合理的依据提出投资建议，寻求基金的最佳交易执行，公平客观对待所有客户，始终按照基金的投资目标、策略、政策、指引和限制实施投资决定，充分披露一切涉及利益冲突的重要事实，尊重客户信息的机密性；

7.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；

8. 确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具；严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定，确定清晰、可执行的投资范围和投资比例，并在规定时间内，对超范围、超比例的投资进行调整，并承担相应的责任；

9. 确保基金管理人向基金托管人发送的基金认购、申购和赎回数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据的真实、准确和完整，因数据原因造成基金财产或其他当事人损失的，由基金管理人负责赔偿；

10、委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；

- 
11. 与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排,应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行;
  12. 进行境外证券投资,应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定;
  13. 如需在托管人选择的机构之外保管、登记基金财产,应严格审查,保证基金财产的安全,以及相关资产收益准确、按时归入基金财产;
  14. 严格按照全球投资表现标准(GIPS)选取投资业绩标准;
  15. 除依据《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定外,不得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;
  16. 依法接受基金托管人的监督;
  17. 计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
  18. 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;
  19. 按规定受理申购和赎回申请,严格控制基金投资产品的流动性风险,确保及时、足额支付赎回款项;
  20. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
  21. 编制季度、半年度和年度基金报告;
  22. 及时复核基金托管人提供的公司行为信息;
  23. 严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
  24. 保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、《试行办法》和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,不得向他人泄露;
  25. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
  26. 依据《基金法》、《运作办法》、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;
  27. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

---

28.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

29.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；

30.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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

31.基金托管人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托管人追偿；

32.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

33.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；

34.执行生效的基金份额持有人大会决议；

35.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

36.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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

37.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利

1.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收入；

2.选择、更换负责境外资产托管业务的境外托管人；

3.监督基金管理人对本基金的投资运作；

4.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

5.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

6.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7.依法召集基金份额持有人大会；

8.按规定取得基金份额持有人名册资料；

---

9.法律法规和基金合同规定的其他权利。

（四）基金托管人的义务

- 1.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；
- 2.对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 3.除依据《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益；
- 4.保护持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、国家外汇局报告；
- 5.安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；
- 6.按照规定监督基金管理人的投资运作，确保基金按照有关法律法规和基金合同约定的投资目标和限制进行管理；
- 7.按照有关法律法规和基金合同的约定执行基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- 8.确保基金的份额净值按照有关法律法规和基金合同规定的方法进行计算；
- 9.确保基金按照有关法律法规和基金合同的规定进行申购、认购、赎回等日常交易；
- 10.确保基金根据有关法律法规和基金合同确定并实施收益分配方案；
- 11.按照有关法律法规和基金合同的规定，基金托管人对由基金托管人或其委托的境外托管人实际有效控制的证券承担安全保管责任；
- 12.每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和国家外汇局报告基金境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；
- 13.安全保管可以承担保管责任的基金资产，开设或委托开设资金账户和证券账户；
- 14.办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
15. 保存基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

- 
- 16.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；
  - 17.保守基金商业秘密，除《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
  - 18.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；
  - 19.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
  - 20.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - 21.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
  - 22.按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - 23.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；
  - 24.按照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自行召集基金份额持有人大会；
  - 25.因违反基金合同导致基金财产损失，应对直接损失承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
  - 26.选择的境外托管人，应符合《试行办法》第十九条的规定；
  - 27.对基金的境外财产，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，托管人应当承担相应责任。
  - 28.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
  - 29.参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；
  - 30.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业监督管理机构，并通知基金管理人；
  - 31.执行生效的基金份额持有人大会决议；
  - 32.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

---

33.保存与基金托管人职责相关的基金份额持有人名册；

34.法律法规、中国证监会和国家外汇局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

因基金管理人原因造成基金托管人无法正常履行上述义务，由基金管理人承担责任，并对造成的基金财产损失承担相关赔偿责任。

如适用的法律法规和规章制度不再要求托管人履行上述职责的，托管人按照变更后的相关规定履行职责。

#### （五）基金份额持有人的权利

- 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.依法申请赎回其持有的基金份额；
- 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9.法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### （六）基金份额持有人的义务

- 1.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2.遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构关于开放式基金业务的相关规则及规定；
- 3.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 4.在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；
- 5.不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 6.执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 7.返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理

---

人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

8.法律法规和基金合同规定的其他义务。

(七) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账

户名称而有所改变。

(八) 若基金合同当事人上述各项权利义务与不时修订或新颁布实施的法律法规或中国证监会规定冲突的，以修订后或届时有效的法律法规或中国证监会规定为准。

## 二 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

### (二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 提前终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外）；

(5) 变更基金份额持有人大会程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，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) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
  - (3) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
  - (4) 经中国证监会允许，基金管理人、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
  - (5) 在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；
  - (6) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
  - (7) 对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重大变化；
  - (8) 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；
  - (9) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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.代表基金份额 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，代表基金份额 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.代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- （6）代理投票的授权委托书的内容要求（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；
- （7）表决方式；
- （8）会务常设联系人姓名、电话；
- （9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （10）召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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。

3.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书面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书面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书面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，不影响计票和表决结果。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

1.会议方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式。

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，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，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

（3）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

（4）会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

2.召开基金份额持有人大会的条件

（1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%，下同）；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

（2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称

---

为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

4) 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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上;

5) 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提交的持有基金份额的凭证、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,并与登记结算机构记录相符。

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,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。

(3) 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。

## (六) 议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由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;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

(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:

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。

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) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 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，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的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部

---

有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3.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。

(七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1.基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列（2）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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4.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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.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。

(八) 计票

1.现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果

基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选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，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如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) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果；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，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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。关于本章第（二）条所规定的第（1）-（8）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第（二）条所规定的第（9）、（10）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

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决议。

3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。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。

(十)法律法规或监管部门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

#### (一) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
3. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%；
- 4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；
- 5.登记在注册登记系统的基金份额，其收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，红利再投资方式免收再投资的费用；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 6.登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式为现金分红，投资人不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
7. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；
8. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
9. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

---

## （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

## （三）收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 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，含境外托管人收取的费用；
- 3.基金财产拨划支付的银行费用；
- 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，基金管理人和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。

### 五 基金财产的投资方向和投资限制

#### （一）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。

#### （二）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。

### （三）投资限制

#### 1.组合投资比例限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）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。

（2）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。

（3）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

（4）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（5）基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

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

基金管理人应当在基金合同生效后 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。若基金超过上述（1）-（6）项投资比例限制，应当在超过

---

比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。法律法规另有规定的除外。

## 2.关于投资境外基金的限制

(1) 每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞形基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

(2) 本基金不得投资于以下基金：

- ①其他基金中基金；
- ②联接基金（A Feeder Fund）；
- ③投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

## 3.金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

(1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于该基金资产净值的 100%。

(2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

①所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

## 4.证券借贷交易

本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券

---

市值的 102%。

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以

满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6) 本基金管理人将对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

## 5. 证券回购交易

基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5) 本基金管理人将对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。基金如参与证券借贷交易、正回购交易、逆回购交易，本基金管理人将按照规定建立适当的内控制度、操作程序和进行档案管理。

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 1—6 项约定的投资限制被修改或取消的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整投资限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

## 7. 禁止行为

除中国证监会另有规定外，基金不得有下列行为：

- (1) 购买不动产。
- (2) 购买房地产抵押按揭。
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证。
- (4) 购买实物商品。
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。
- (6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。
- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易。
- (8) 从事证券承销业务。
- (9) 不公平对待不同客户或不同投资组合。
- (10) 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。
- (11) 中国证监会禁止的其他行为。

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，取消或变更上述投资禁止行为的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应取消或调整禁止行为规定，不需经基金份额持有人大会审议。

## 六 基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 基金资产净值：

---

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二) 基金申购、赎回开放日(T日)的基金份额净值在T+1日计算,并在T+2日内公告。本基金份额净值的计算保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五

入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(三) 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,在开始办理基金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基金份额净值;

2.在开始办理基金份额申购或者赎回之后,基金管理人将在每个开放日后的2个工作日内,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金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工作日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述工作日后的2个工作日内,将基金资产净值、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

(一) 本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

- 1.基金份额持有人大会决定终止的;
- 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
- 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
- 4.中国证监会规定的其他情况。

(二) 基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1) 基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

---

(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。

## 2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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。

## 4.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基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5.基金财产清算的公告

---

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6.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 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

#### 九 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

国泰基金管理有限公司

2015 年 4 月 1 日