国泰金鹿保本增值混合证券投资基金第六个保本期到期的第一次提示性公告

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（以下简称“本基金”）为契约型开放式证券投资基金，基金管理人和基金注册登记机构为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的保本周期为2年。第6个保本期自2016年9月8日起至2018年9月8日止，由于该日为非工作日，则第6个保本期的到期日顺延至2018年9月10日。

特此提示如下：

1、本基金第6个保本期到期后，不再符合中国证监会《关于避险策略基金的指导意见》的规定，本基金将依照法定程序实施基金转型。

2、本基金第6个保本期到期日（2018年9月10日）及随后设置的过渡期，为本基金第6个保本期的到期选择期。到期选择期的安排以届时基金管理人发布的公告为准。

敬请投资人知悉，并提前做好赎回准备或相关安排。敬请关注本基金的后续相关公告。

国泰基金管理有限公司
2018年8月10日

关于国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金实施转型的第二次提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“我公司”）旗下管理的国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“民安增益定开混合”）于2018年6月13日至2018年7月16日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。本次会议议案于2018年7月17日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。我公司已于2018年7月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站（www.gtfund.com）发布了《国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》和《关于国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金实施转型的提示性公告》。根据本次持有人大会决议，现将实施转型的相关事项再次提示如下：

一、本基金正式实施转型日为2018年8月15日。

二、转型方案实施情况

1、关于基金合同等法律文件的修订

根据《关于国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》分别修订为《国泰民安增益纯债债券型证券投资基金基金合同》、《国泰民安增益纯债债券型证券投资基金托管协议》，并据此编制《国泰民安增益纯债债券型证券投资基金招募说明书》。本基金已经中国证监会证监许可[2018]966号《关于准予国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册。《国泰民安增益纯债债券型证券投资基金基金合同》、《国泰民安增益纯债债券型证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

2、关于选择期的安排和开放申购、赎回业务

本次转型实施前的选择期为自2018年7月18日起至2018年8月14日止，共20个工作日。选择期期间，民安增益定开混合开放申购和赎回业务。基金份额持有人在民安增益定开混合正式实施转型前可选择赎回，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的民安增益定开混合基金份额将默认转型为国泰民安增益纯债债券型证券投资基金基金份额。在选择期期间，由于本基金需应对赎回等情况，豁免民安增益定开混合基金合同中约定的投资组合比例限制及封闭期、开放期等条款，基金管理人根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等，具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

特此公告

国泰基金管理有限公司
2018年8月10日

关于以通讯方式召开国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议的基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人国泰基金管理有限公司决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2018年8月10日起至2018年9月9日17:00（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票及授权委托书的寄达地点：

基金管理人：国泰基金管理有限公司

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉里大厦16层-19层

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

持有人大会专线/客服电话：（400-888-8688转0）

邮政编码：200082

请在信封表面注明：“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8688，021-31089000咨询。

二、会议审议事项

《关于国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型相关事项的议案》（见附件一）

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年8月29日，因2018年8月29日交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（www.gtfund.com）下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件；事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件）；

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（6）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（7）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于2018年9月9日17:00以前通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，因；专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

本基金管理人的办公地址及联系方式如下：

基金管理人：国泰基金管理有限公司

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉里大厦16层-19层

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

邮政编码：200082

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8688，021-31089000咨询。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）代表的监督下进行计票，并由公正机关对其计票过程予以公证。如基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人的表决权

基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（2）表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（3）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、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不少于权益登记日基金总份额的百分之五十（含百分之五十）；

2、《关于国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型相关事项的议案》须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和基金合同的规定，本次持有人大会需要有效表决票所代表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（含二分之一）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，根据《基金法》，本基金管理人可在规定时间内发出二次召集本次基金份额持有人大会，重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间本基金基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者本基金基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：国泰基金管理有限公司

持有人大会专线/客服电话：（400-888-8688转0）

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

传真：021-31081700

电子邮件：service@gtfund.com

网址：www.gtfund.com

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系方式：021-62154848

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、本基金当期保本期自2016年9月8日起至2018年9月10日止，2018年9月10日及随后设置的过渡期，为当期保本期的到期选择期。到期选择期的安排以届时基金管理人发布的公告为准。

2、若本次基金份额持有人大会召集失败或议案未获得表决通过，由于本基金不再符合保本基金的存续条件，本基金将按照法律法规和基金合同的约定实施转型。特此提示持有人知悉并提前做好退出安排。

3、若本次基金份额持有人大会审议的转型事项获表决通过并生效，则本基金基金合同将按照决议内容进行修订，本基金基金份额将变更登记为国泰金鹿混合型证券投资基金基金份额。

4、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

5、上述基金份额持有人大会有关公告可通过国泰基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8688，021-31089000咨询。

6、关于本次议案的说明见附件四《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案说明书》。

7、本通知的有关内容由国泰基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型相关事项的议案》

附件二：《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案说明书》

国泰基金管理有限公司
2018年8月10日

附件一：

关于国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型相关事项的议案

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人：

因国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（以下简称“国泰金鹿保本”）无法满足《关于避险策略基金的指导意见》进入下一运作周期的相关要求，为保证国泰金鹿保本的平稳运作，维护基金份额持有人利益，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》、《关于避险策略基金的指导意见》和《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对国泰金鹿保本实施转型并修改《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案说明书》。

实施国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案，提议投权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰金鹿保本实施转型。

以上议案，请予审议。

国泰基金管理有限公司
2018年8月10日

附件二：

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：		
证件号码（身份证件号/营业执照号）	基金账户号	
审议事项	同意	反对	弃权
关于国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型相关事项的议案			
基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章		2018年月日

说明：

1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见，基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见，表决意见代表基金份额持有人所填基金账户号的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。

2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决。

3、本表决票中“基金账户号”，指持有国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的国泰金鹿保本增值混合证券投资基金所有份额。

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（www.gtfund.com）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：

授权委托书

兹委托_____代表本人（或本机构）参加投票截止日为2018年9月9日的以通讯方式召开的国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若国泰金鹿保本增值混合证券投资基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：_____

委托人基金账户号：_____

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）：_____

委托日期：2018年月日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“基金账户号”，指基金份额持有人持有国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的国泰金鹿保本增值混合证券投资基金所有份额。

2、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金（以下简称“国泰金鹿保本”）基金合同于2006年4月28日生效。为更好地满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于避险策略基金的指导意见》和《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，国泰金鹿保本基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型相关事项的议案》。

2、本次国泰金鹿保本转型事项属对国泰金鹿保本原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

3、本次国泰金鹿保本转型事项须经参加本次基金份额持有人大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

4、基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

5、中国证监会对本次国泰金鹿保本变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次国泰金鹿保本的转型方案或变更注册后基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

二、国泰金鹿保本转型方案要点

转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“国泰金鹿保本增值混合证券投资基金”变更为“国泰金鹿混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

（二）删除保本保障机制

国泰金鹿混合型证券投资基金不含任何保本保障机制。

（三）转型后基金的基本情况

1、基金名称

国泰金鹿混合型证券投资基金

2、基金的类别

混合型证券投资基金

3、基金的运作方式

契约型开放式

4、基金的投资目标

本基金主要依据价值投资经典指标，投资于具有良好盈利能力和价值被低估的股票，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

5、基金份额面值

本基金的份额面值为人民币1.00元。

6、基金存续期限

不定期

7、基金转型

指对包括国泰金鹿保本增值混合证券投资基金删除保本保障机制、修改投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、基金费用、收益分配原则、更名为“国泰金鹿混合型证券投资基金”等一系列事项的统称。

（四）转型后基金的投资

1、投资目标

本基金主要依据价值投资经典指标，投资于具有良好盈利能力和价值被低估的股票，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证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）。

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，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

3、投资策略

（1）资产配置策略

本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

（2）股票投资策略

①盈利能力股票筛选

本基金的股票资产投资主要以具有投资价值的股票作为投资对象，采取自下而上精选个股策略，利用ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司，构成具有盈利能力的股票备选池。在筛选具有盈利能力的股票时，本基金主要遵循以下标准：

①对于非金融行业，选择过去三年的平均ROIC筛选行业前1/3的个股。ROIC,即投资资本回报率，计算公式为净利润／全部投入资本，其中全部投入资本=股东权益(不含少数股东权益)+负债合计－无息流动负债－无息长期负债。该指标主要用于衡量企业运用所有债权人和股东投入为企业获得现金盈利的能力，也用来衡量企业创造价值的能力；

②对于金融行业，选择过去三年的平均ROE行业排在前1/2的个股。ROE,即净资产收益率，计算公式为净利润除以平均股东权益。该指标反映股东权益的收益水平，指标值越高，说明投资带来的收益越高；

③滚动一年股息率前100名的个股，股息率(Dividend Yield),即当期股息（此处红利仅指现金股息）除以当前股价。股息率是衡量企业是否具有投资价值的重要标尺之一。

②价值评估分析

本基金通过价值评估分析，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票池。价值评估分析主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、股息贴现模型等，基金管理人根据不同行业特征和市场特征灵活进行运用，努力从估值层面为持有人发掘价值。

③实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过对上市公司的外部合作机构和相关行政管理部门进一步调研，对上述结论进行核实。

4）投资组合建立和调整

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立和调整投资组合。在投资组合管理过程中，本基金还将注重投资品种的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

③）债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

（4）资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（5）中小企业私募债投资策略

本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。

（6）非公开发行股票投资策略

本基金从发展前景和估值水平两个角度出发，通过定性和定量分析相结合的方法评价定向增发项目对上市公司未来价值的影响。结合定向增发发行价格与市场交易价格价差的大小，理性做出投资决策。

（7）权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下稳健的超额收益。

（8）股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。

（9）国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

4、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金股票资产投资比例为基金资产的60%-95%；

2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%；

6）本基金投资于权证的投资限制如下：

①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%；

②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%；

③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%；

7）本基金投资于资产支持证券的投资限制如下：

①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%；

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20%；

③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%；

④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%；

⑤本基金应按照于信用级别评级为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；

8）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金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；

9）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%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

10）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

①本基金在任何交易日日终，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%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约和国债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95%，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；

②本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

③本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；

④基金管理人在一个交易日内交易（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%；

11）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

①本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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95%，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；

②在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

③在任何交易日内，本基金交易（不包括平仓）的国债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%；

④本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

12）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

14）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

15）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

16）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。

除上述第2、7）项第5目、13）、15）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的从其规定。

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。基金托管人对基金的投资监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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或以变更后的规定为准。

（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。

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

（3）关联交易

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，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同意过。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。

5、业绩比较基准

沪深300指数收益率×80%＋中债综合指数收益率×20%。

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

1）沪深300指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；

2）沪深300指数编制和发布有一定的历史，有较高的知名度和市场影响力；

3）沪深300指数是中证指数有限公司编制推出的沪深两个市场第一个统一指数；

4）中债综合指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数。该指数的样本主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等。

基于本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

随着法律法规和市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应自调整前2个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

6、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中等预期风险和预期收益的产品。

（五）转型后基金的费用

1、申购费

本基金基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M（50万	1.50%
50万≤M（200万	1.20%
200万≤M（500万	0.80%
M≥500万	按笔收取，1000元/笔

申购费用由基金份额申购人承担，在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、赎回费

本基金的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（N）	赎回费率
N（7日	1.50%
7日≤N（30日	0.75%
30日≤N（180日	0.50%
N≥180日	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30日但少于90日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于或等于90日但少于180日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于或等于180日的投资人不收取赎回费。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、管理费与托管费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。

（六）转型后基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（七）摆动定价机制

摆动定价机制指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

（八）授权基金管理人修订基金合同

除上述转型方案要点外，考虑到国泰金鹿保本获批以来，《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规颁布实施或陆续修改和基金管理人的情况变化，基金管理人需要根据现行有效的法律法规、监管机构要求、基金管理人与基金托管人信息更新及转型后的国泰金鹿混合型证券投资基金的产品特征修订《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》的相关内容，修订后的内容请见附件《国泰金鹿混合型证券投资基金基金合同》。

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》，并相应修改更新托管协议及招募说明书。

（九）《国泰金鹿混合型证券投资基金基金合同》的生效

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自基金管理人届时公告的国泰金鹿保本正式实施转型之日起，修订后的《国泰金鹿混合型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》自同日起失效。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规和监管机构要求及《国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金合同》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

五、申购赎回业务

1、基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售机构柜台或以销售机构规定