关于以通讯方式召开国泰宁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的第一次提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2018年10月17日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）发布了《关于以通讯方式召开国泰宁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的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布《关于以通讯方式召开国泰宁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的第一次提示性公告》。

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《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“基金管理人”）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10月17日起至2018年11月19日17:00止（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号楼嘉昱大厦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：“国泰宁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

《关于国泰宁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》（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10月17日，即2018年10月17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，并提供机构投资者在表决票上签字或盖章，并提供本人投资者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等）；

（5）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；

（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自2018年10月17日起，至2018年11月19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：“国泰宁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专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：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号楼嘉昱大厦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（宁波银行股份有限公司）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，所提供文件符合本公议通知规定，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、本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有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）；

2、《关于国泰宁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》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；

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投权

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就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非投权文件另有载明，本次基金份额持有人大会投权期间本基金基金份额持有人作出的各投权依然有效，但如果投权方式发生变化或者本基金基金份额持有人重新作出投权，则以最新方式或最新投权为准，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：宁波银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

联系人：林帅

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、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。

2、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设立为国泰中证500指数增强型证券投资基金基金份额。

3、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。

4、关于本次议案的说明见附件四《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》。

5、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：《关于国泰宁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》

附件二：《国泰宁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票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《国泰宁益定期开放灵活配置混合型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10月18日

附件一：

关于国泰宁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

国泰宁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：

根据市场环境变化，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰宁益定期开放灵活配置混合型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（宁波银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于国泰宁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》。

2、本次国泰宁益定开混合转型事项属对国泰宁益定开混合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受理并公告。

3、本次国泰宁益定开混合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三分之二以上（含三分之二）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宁益定开混合变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次国泰宁益定开混合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、国泰宁益定开混合转型方案要点

转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金”变更为“国泰中证500指数增强型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

（二）转型后基金的类别

股票型证券投资基金。

（三）转型后基金的运作方式

契约型开放式。

（四）转型后基金的投资

Ⅰ投资目标

本基金为指数增强型基金，力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。

Ⅱ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）、港股通标的股票、权证、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权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。

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定参与融资和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%（其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%），投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券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。

如未来法律法规或监管机构允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

Ⅲ投资策略

1、股票投资策略

（1）指数化投资策略

本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。

（2）指数增强策略

本基金为指数增强型基金，在复制标的指数的基础上，主要利用指数增强量化投资策略，优选标的指数成份股及备选成份股，预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与指数成份股相关度高的股票，力求获取超越标的指数的超额收益。

指数增强量化投资策略以国泰量化多因子模型为基础，结合组合优化模型，精选具有较高投资价值的股票构建投资组合。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度上的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会。

1）精选内地个股

国泰量化多因子模型基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、收益因子、成长性因子、风险因子和流动性因子等六大类对股票超额收益具有较强解释度的因子，通过构建多因子模型进行量化分析，建立股票价值评估体系。

①价值因子

价值因子可以参考以下指标：市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）等。

②盈利质量因子

本基金考察投资标的的盈利质量，可以参考以下指标：总资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）、销售毛利率、资产负债率、自由现金流等。

③收益因子

收益因子可以参考以下指标：派息率等。

④成长性因子

成长性因子可以参考以下指标：PEG、营业收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、可持续增长率（留存收益率*净资产收益率）等。

⑤风险因子

风险因子可以参考以下指标：股价波动率、价格动量等。

⑥流动性因子

流动性因子可以参考以下指标：成交量、换手率、流通市值等。

根据评价结果优选股票，构建股票投资组合。此外，基金管理人将依据市场环境的变化，定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，动态调整并更新各类因子的具体组合及权重。

2）精选港股通标的股票

本基金将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资顾问进行境外投资。本基金将运用量化模型和基本面研究相结合的方式，根据高质量、高成长、高盈利等因子精选港股通标的股票。

（3）风险控制与调整

本基金为指数增强型基金，在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.50%，年跟踪误差不超过8%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注市场利率、汇率、物价水平等宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

3、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。

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、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动的风险，力求稳健的超额收益。

6、股指期货投资策略

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

7、股票期权投资策略

本基金投资于股票期权按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。

8、融资与转融通证券出借投资策略

本基金在参与融资与转融通证券出借业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金组合风险控制情况等因素的研究和判断，决定融资规模与转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑融资与转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。

Ⅳ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不低于80%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券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；

（3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算），其市值不超过基金资产净值的10%，但完全按照指数的构成比例进行投资的部分不受前述限制；

（4）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，但完全按照指数的构成比例进行投资的部分不受前述限制；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券的10%，但完全按照指数的构成比例进行投资的部分不受前述限制；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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%；

（13）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；

（14）基金administration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；

（15）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；

（16）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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；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%；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；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%；

（17）本基金参与股票期权交易，应当遵守下列要求：

①本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；

②本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

③本基金未设立合约期权合约的面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（18）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

（19）本基金参与转融通证券出借交易的，每个交易日日终，本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（20）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%。

（21）本基金与私募证券投资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本基金合同约定的投资范围和投资比例规定一致。

（22）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；

（23）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。

除第（2）、（13）、（21）和（22）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、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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10个交易日内进行调整，但中国证监会规定特殊情况除外。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的监督与检查自本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）法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则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。

Ⅴ业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布、维护或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为业绩比较基准很或部分的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

（五）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，确保投资者申购赎回的公平性。

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。

（六）转型后基金的费用

Ⅰ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、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

4、标的指数使用许可费；

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、诉讼费和仲裁费；

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、基金的开户费用、账户维护费用；

11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

12、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。

Ⅱ管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。

Ⅲ C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。

Ⅳ标的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提。标的指数使用许可费的收取下限为每季度人民币50,000元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

Ⅴ申购费

	申购金额（M）	申购费率
A类基金份额	M（20万元	1.00%
	20万元≤M（50万元	0.80%
	50万元≤M（100万元	0.50%
	M≥100万元	按笔收取,1000元/笔
C类基金份额	C类基金份额不收取申购费用	

Ⅵ赎回费

	持有时间（N）	赎回费率
A类基金份额	N（7日	1.50%
	7日≤N（30日	0.75%
	30日≤N（180日	0.50%
	N≥180日	0.00%
C类基金份额	持有时间（N）	赎回费率
	N（7日	1.50%
	7日≤N（30日	0.10%
	N≥30日	0.00%

（七）转型后基金的终止条款

《基金合同》生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

（八）授权基金管理人修改基金合同其他内容

除上述转型方案要点外，考虑到目国泰宁益定开混合基金合同生效以来，《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规陆续修改或颁布实施和基金管理人、基金托管人的情况变化，基金管理人需要根据现行有效的法律法规与监管政策，以及基金管理人、基金托管人的最新信息一并修改《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，修改后具体内容请见附件《国泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》。

综上所述，基金管理人根据清基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》修改《国泰宁益定期开放灵活配置混合型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）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，国泰宁益定开混合将安排不少于20个工作日的选择期。选择期期间，国泰宁益定开混合将开放赎回业务，申购业务暂不办理。基金份额持有人在国泰宁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，其持有的国泰宁益定开混合的基金份额将默认变更设立为国泰中证500指数增强型证券投资基金的基金份额。在选择期期间，由于国泰宁益定开混合需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免国泰宁益定开混合基金合同中约定的投资组合比例限制条款。此外，为了便于基金份额持有人在选择期做出选择，充分保护基金份额持有人利益，选择期期间国泰宁益定开混合的赎回费调整为：

	持有时间（N）	赎回费率
A类基金份额	N（7日	1.50%
	7日≤N（30日	0.75%
	30日≤N（180日	0.50%
	N≥180日	0.00%
C类基金份额	持有时间（N）	赎回费率
	N（7日	1.50%
	7日≤N（30日	0.50%
	N≥30日	0.00%

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况暂停申购、赎回等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十）转型后的基金的生效

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选择期到期国泰宁益定开混合正式实施转型之日起，修订后的《国泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰宁益定期开放灵活配置混合型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《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》转型方案要点修订基金合同并实施转型方案。

三、基金管理人就相关事项的说明

（一）国泰宁益定开混合的历史沿革

国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2485号）注册，自2017年4月28日起向社会公开募集，于2017年7月27日结束募集工作，并于2017年8月1日获得中国证监会的书面确认，《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

（二）基金转型的可行性

1、基金转型不存在法律障碍

《基金法》第八十六条规定，“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过；但是，转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定，“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

因此，国泰宁益定开混合转型事项不存在法律方面的障碍。

2、基金转型不存在技术障碍

国泰宁益定开混合转型为国泰中证500指数增强型证券投资基金后，在技术系统运作上与基金管理人管理的其他同类基金并无明显差异，因而不存在技术操作上的障碍。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）基金转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对基金份额持有人进行了走访，认真听取了相关意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

（二）基金转型后的运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

国泰基金管理有限公司

联系电话：021–31089000

传真：021–31081700

电子邮件：service@gtfund.com

网址：www.gtfund.com

附件：《国泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》

附件：

《国泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》

第一部分前言

一、订立本基金合同的目的，依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的协议不得与基金合同当事人之间权利义务关系的有关约定相冲突，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

三、国泰中证500指数增强型证券投资基金由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来。国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2485号）注册，自2017年4月28日起向社会公开募集，于2017年7月27日结束募集工作，并于2017年8月1日获得中国证监会的书面确认，《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

自2018年XX月XX日至2018年XX月XX日，国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于国泰宁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》，内容包括国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金修改基金类别、运作方式、基金合同终止条款、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费用、更名为“国泰中证500指数增强型证券投资基金”并修订《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等事项。上述基金份额持有人大会决议事项已表决通过之日起生效。自2018年XX月XX日起，由《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰中证500指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

第五部分基金的存续

一、基金份额的变更登记

基金合同生效后，本基金注册登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第六部分基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更销售机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体参见各销售机构的相关公告。投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间