（上接B085版）

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007年4月11日至2007年12月31日	58.30%	1.69%	32.70%	1.41%	25.60%	0.28%
2008年度	-53.83%	2.33%	-47.00%	1.84%	-6.83%	0.49%
2009年度	84.39%	1.48%	48.51%	1.23%	35.88%	0.25%
2010年度	10.11%	1.22%	-8.02%	0.92%	18.13%	0.30%
2011年度	-23.76%	0.93%	-13.17%	0.75%	-10.59%	0.18%
2012年度	-5.06%	0.96%	3.57%	0.71%	-8.63%	0.25%
2013年度	29.66%	1.25%	-3.18%	0.75%	32.84%	0.50%
2014年度	11.10%	1.20%	34.22%	0.71%	-23.12%	0.49%
2015年度	60.21%	3.06%	10.08%	1.59%	50.13%	1.47%
2016年度	-20.58%	1.85%	-6.54%	0.94%	-14.04%	0.91%
2017年度	11.35%	0.96%	4.54%	0.36%	6.81%	0.60%
2018年上半年	-10.91%	1.22%	-8.22%	0.71%	-2.69%	0.51%
2007年4月11日至2018年6月30日	95.32%	1.65%	10.84%	1.09%	84.48%	0.56%

第十二节 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

（一）基金管理人的管理费；

（二）基金托管人的托管费；

（三）基金财产拨划支付的银行费用；

（四）基金合同生效后的信息披露费用；

（五）基金份额持有人大会费用；

（六）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

（七）基金的证券交易费用；

（八）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；

（九）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、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列支，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

（一）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×年管理费率÷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，支付日期顺延。

（二）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0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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，支付日期顺延。

（三）除管理费和托管费之外的基金费用，由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的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、律师费以会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

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

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

第十四节 对基金招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2018年5月25日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；

2、更新了“第三节 基金管理人”中的相关内容；

3、更新了“第四节 基金托管人”中的相关内容；

4、更新了“第五节 相关服务机构”中销售机构的相关信息；

5、更新了“第九节 基金份额的申购、赎回与转换”中的相关内容；

6、更新了“第十节 基金的投资”中基金投资组合报告内容，更新至2018年9月30日；

7、更新了“第十一节 基金的业绩”，更新至2018年6月30日；

8、更新了“第二十四节 其他应披露的事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇一八年十一月二十四日

关于国泰新目标收益保本混合型证券投资基金保本期到期处理规则及变更为国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金的公告

国泰新目标收益保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同于2015年12月2日生效，基金管理人为中国证券投资基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的保本期为每3年一个周期，目前处于第一个保本期的正常运作中。本基金第一个保本期由重庆三峡融资担保集团股份有限公司（其前身为“重庆三峡担保集团股份有限公司”）提供连带责任保证，第一个保本期将于2018年12月1日到期。按照本基金基金合同的约定，“保本期到期日”，若本基金不符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，变更为非保本的混合型基金，基金名称和应变更为“国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。

本基金第一个保本期到期日不再符合保本基金存续条件，本基金将按照《基金合同》的约定变更为非保本的混合型基金，即“国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金”，变更后基金简称、托管协议和招募说明书分别修订为《国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，调整的内容包括但不限于保留并适用《国泰新目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》关于变更后的国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金的相关内容，并根据现行有效的法律法规规定，在《国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等信息披露文件中，充分了解和充分风险揭示，充分了解相关投资风险，自主决定是否投资本基金，并审慎判断投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

3、本公告的最终解释权归本公司所有。投资人欲了解更多详细情况，可拨打本公司的客户服务电话400-888-8688进行咨询。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

二〇一八年十一月二十四日

国泰新目标收益保本混合型证券投资基金保本期到期的提示性公告

国泰新目标收益保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）当前保本期将于2018年12月3日到期，当前保本期的到期选择期为2018年12月3日，基金份额持有人可选择赎回本基金，转换为本基金管理人管理的其他基金，或者不进行选择而自动默认转为变更后的“国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金”，即自2018年12月4日起本基金更名为“国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金”，即自2018年12月4日起变更后的基金简称为“国泰多策略收益灵活配置混合”，基金代码仍为“000192”。

基金份额持有人认购并持有当前保本期到期的基金份额适用保本条款。且基金份额持有人在到期选择期内将持有当前保本期到期的基金份额进行赎回或者转换操作的，无需支付赎回费用。

基金份额持有人当期保本期开始后申购的或转换转入的基金份额不适用保本条款。且将当期保本期开始后申购的或转换转入的基金份额在选择赎回或转换转出时需适用相应的赎回费率，支付赎回费用。

本基金管理人于2018年11月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本基金管理人网站上刊登了《关于国泰新目标收益保本混合型证券投资基金保本期到期处理规则及变更为国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金的公告》。敬请您及时做出基金份额赎回、转换转出或继续持有的投资决定，请关注您持有的保本基金份额变更为非保本的混合型基金的相关风险。

投资人欲了解更多详细情况，可拨打本公司的客户服务电话400-888-8688进行咨询。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

二〇一八年十一月二十四日

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之B类份额的基金份额净值小于或等于0.2500元时，国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：国泰医药，基金代码：160219），医药A份额（场内简称：医药A，基金代码：150130），医药B份额（场内简称：医药B，基金代码：150131）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年11月23日收盘，医药B份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，在此提请投资者密切关注医药B份额近期基金份额净值的波动情况，开警惕可能出现的风险。

针对不定期份额折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于医药A份额、医药B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，医药A份额、医药B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价带来的风险。

二、医药B份额折算后预期风险收益特征将发生变化，不定期份额折算后其将恢复至初始杠杆水平。

三、医药A份额表现为较低预期风险和较低预期收益的特征，在不定期份额折算后，医药A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的医药A份额变为同时持有较低风险收益特征的医药A份额与较高风险收益特征的国泰医药份额的情况，因此，原医药A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加，投资风险将会增加。此外，国泰医药为跟踪国证医药卫生行业指数的基础份额，其投资策略将会随着市场波动发生变化，因此医药A份额持有人将不可能会承担因市场下跌而实现优先约定收益。请投资者认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》了解相关内容。

四、由于触发折算阈值当日，医药B的份额净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日的基金份额净值可能与折算阈值0.2500元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量国泰医药份额、医药A份额、医药B份额的持有人在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停医药A份额与医药B份额的上市交易以及国泰医药份额的申购、赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的《基金合同》及《招募说明书》或者拨打本基金管理人客服电话：400-888-8688。

三、本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读该基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

国泰基金管理有限公司

2018年11月24日

关于以通讯方式召开国泰策略收益灵活配置混合型证券投资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《国泰策略收益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》”）的约定，国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与国泰基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金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11月26日起至2018年12月25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

传真：021-31081700

电子邮箱：service@gtfund.com

网址：www.gtfund.com

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

4、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修改基金合同等相关事项获表决通过并生效，则本基金基金合同将按照表决内容进行修改。

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《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改说明书》。

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：《关于修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》

附件二：《国泰策略收益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：《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改说明书》

国泰基金管理有限公司

2018年11月24日

附件一：

关于修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案

国泰策略收益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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰策略收益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中国建设银行股份有限公司协商一致，提议修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费率等，同时根据前述内容的变动进行相应修改《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改说明书》。

为实施修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的方案，提议授权国泰基金管理人办理本次修改基金合同等相关具体事宜，包括但不限于根据《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改说明书》的有关内容对《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行的修改和补充，以及修改赎回费率等。

以上议案，请予审议。

国泰基金管理有限公司

2018年11月24日

附件二：

国泰策略收益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

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
关于修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金合同相关事项的议案	
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属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”，指持有国泰策略收益灵活配置混合型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策略收益灵活配置混合型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有效，持有人在授权委托书上签字或盖章后均为有效。

附件四：

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改说明书

一、声明

1、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“国泰策略收益”）基金合同于2015年1月16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》和《国泰策略收益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”）等有关规定，国泰策略收益基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国建设银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》。

2、本次国泰策略收益修改基金合同等相关事项属对国泰策略收益原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会备案，已经中国证监会准予变更注册。

3、本次国泰策略收益修改基金合同等相关事项经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二分之一以上（含二分之一）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策略收益变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次国泰策略收益修改基金合同的实质性判断或者保证。

二、修改基金合同等相关事项要点

修改基金合同等相关事项的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”变更为“国泰量化策略收益混合型证券投资基金”（“基金”）。

（二）基金的投资

1、投资目标

修改后为：

“本基金力图通过灵活的大类资产配置，积极把握个股的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。”

修改为：

“本基金通过量化多因子选股策略和基本面研究精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的收益。”

2、投资范围

原合同：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内上市交易的股票（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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

其中，权证、股指期货、权证等资产占基金资产净值的0%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%以上，其中，每个交易日持有扣除股指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。

基金管理人应当充分考虑流动性对投资组合的影响，在充分评估投资品种的流动性、变现时间、变现折价率等因素的基础上，对投资组合进行压力测试，确保投资组合在压力情况下的变现能力能够满足基金的赎回需求。”

修改为：

“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（包括中小板、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、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。”

3、投资比例

原合同：

“本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例为股票资产的0%-20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约初始交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资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。”

修改为：

“若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额50%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额50%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过50%的部分，可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

修改为：

“若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过20%的部分，可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

（五）基金费率

1、基金费用的种类

原合同：

“1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《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；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、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。”

修改为：

“1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《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；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的账户维护费用、银行汇划费用；

8、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

9、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。”

2、赎回费率

赎回费率表：

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%
180日≤N＜365日	0.10%
365日≤N＜730日	0.05%
N≥730日	0.00%

修改为：

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%

（六）授权基金管理人修改基金合同其他内容

除上述对基金合同的修改外，考虑到自国泰策略收益基金合同生效以来，《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“《信息披露管理办法》”）等有关规定及其他监管机构发布的相关规定进行了调整，为确保国泰策略收益基金合同与现行有效的法律法规、监管机构的规定以及基金管理人、基金托管人的最新信息一并修改《国泰策略收益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《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》。

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的规定及《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改说明书》的内容对基金基金合同进行修改，修改后《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及赎回费率等相关事项自基金份额持有人大会决议生效之日起生效。

三、修改基金合同等相关事项的主要内容对照表

修改基金合同等相关事项的主要内容如下：	
更名	基金名称由“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”变更为“国泰量化策略收益混合型证券投资基金”
（二）基金的投资	
1、投资目标	
原合同：	
“本基金力图通过灵活的大类资产配置，积极把握个股的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。”	
修改为：	
“本基金通过量化多因子选股策略和基本面研究精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的收益。”	
2、投资范围	
原合同：	
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内上市交易的股票（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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。	
其中，权证、股指期货、权证等资产占基金资产净值的0%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%以上，其中，每个交易日持有扣除股指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。	
基金管理人应当充分考虑流动性对投资组合的影响，在充分评估投资品种的流动性、变现时间、变现折价率等因素的基础上，对投资组合进行压力测试，确保投资组合在压力情况下的变现能力能够满足基金的赎回需求。	
修改为：	
“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（包括中小板、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、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。”	
3、投资比例	
原合同：	
“1、资产配置策略	
本基金管理人依据Wind资产评估体系，通过考量宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关变量指标的变化，评估确定一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。	
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。	
（2）价值评估分析	
本基通过价值评估分析，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，合理地估值结论，在此基础上，精选具有中国价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EVEBITDA、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选择合适的方法，努力为投资人创造超额收益。	
（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客户和供应商等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	
本基金将在实际运作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，本基金还将注重把投资品种的交易活跃程度，以保证基金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、权证投资策略	
本基金将根据风险控制原则的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数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。	
5、资产支持证券投资策略	
本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。	
6、股指期货投资策略	
本基将根据风险控制原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。	
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、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。	
基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。	
修改为：	
“本基金投资策略包含资产配置和个券选择两个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，通过量化工具对宏观政策、市场情绪环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的方法确定本基金的资产配置比例。根据国泰量化模型优选股期收益高的行业和个股，在严格控制风险的基础上，构建本基金的股票组合。并使用股指期货、股票期权等衍生品工具对冲风险。	
5、资产配置策略	
本基金在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，通过量化工具对宏观政策、市场情绪等方面进行全面研究，再辅以量化模型来确定中短期市场系统风险。通过量化策略来调整仓位，确定本基金在A股、港股通标的股票、债券、现金等类别资产上的投资比例。	
6、股票投资策略	
本基金以多因子alpha模型为基础，结合组合优化等，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合。基金采用量化投资策略，存在股数据错误或数据处理错误等数据风险。此外，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。其体风险请参见招募说明书“风险揭示”章节的相关部分。	
八、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。	
第二部分 释义	
在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：	
1、基金或本基金：指国泰量化策略收益混合型证券投资基金；本基金由“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”变更注册而来，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”变更而来	
2、基金管理人：指中国基金管理有限公司	
3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司	
4、基金合同或本基金合同：指《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充	
5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰量化策略收益混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充	
6、招募说明书：指《国泰量化策略收益混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新	
7、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、通知等	
8、《基法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，并自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订	
9、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	
10、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	
11、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	
12、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订	
13、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票	
14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会	
15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会	
16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的基金份额持有人、基金管理人和基金托管人	
17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人	
18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织	
19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者	
20、人民币合格境外机构投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者	
21、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称	
22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人	
23、基金销售业务：指基金管理人或其代销机构宣传推广基金、销售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	
24、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金份额销售业务的机构	
25、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、结算和基金账户、交易账户的建立和维护，基金份额注册登记系统的开发、运行和维护等业务	
26、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为国泰基金管理有限公司或接受国泰基金管理有限公司委托办理基金注册登记业务的机构	
27、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户	
28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务引起的基金份额变动及结余情况的账户	
29、基金合同生效日：指《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》生效日，原《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同一日失效	
30、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期	
31、存续期：指《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》生效之日起至《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》终止日之间的不定期期限	
32、基金交易：指包括国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售、申购、赎回、转换、转托管、投资定期定额业务、基金份额持有人大会召开事项在内的国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金份额变动及结余情况的交易行为，以及国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同生效后基金管理人为实现基金合同约定的投资目标依法进行的投资