# 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基金份额持有人大会的第二次提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2018年11月24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的第二次提示性公告》。

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”）的有关约定,国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（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

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》（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11月26日,即2018年11月26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等）;

（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）,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）;

（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自2018年11月26日起,至2018年12月25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:专人送达的以实际送交时间为准;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（中国建设银行股份有限公司）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》须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间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:中国建设银行股份有限公司

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、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决议内容进行修改。

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:《授权委托书》

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》

国泰基金管理有限公司

2018年11月27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》、《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,同时根据现行有效的法律法规相应修改《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<br>2018年月日 | | | |
| 说明:<br>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。<br>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。<br>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。 | | | |

（本表决票可剪报、复印或登录国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金管理人网站（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12月25日的以通讯方式召开的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，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。若国泰策略收益灵活配置混合型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”,指持有人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在填写完整并签字盖章后均为有效。

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本基金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、本次国泰策略收益修改基金合同等相关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修改基金合同等相关事项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、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”（以下简称“本基金”）。

（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投资回报。”

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,股票、股指期货、权证等资产占基金资产的30%-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,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。

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。”

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）、港股通标的股票、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。

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和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。

如法律法规或监管机构以后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。”

3、投资策略

原合同:

“1、资产配置策略

本基金管理人依据Melva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,努力为从估值层面持有人发掘价值。

（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、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

本基金将根据风险管理的原则,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,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预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。

1、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。

2、股票投资策略

本基金以多因子alpha模型为基础,结合组合优化策略,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合。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,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

（1）内地股票投资策略

1）多因子alpha模型

多因子alpha模型在对中国证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据实证检验的基础上,结合市场环境分析与判断,发掘并挑选出影响证券价格的各类因子并配以权重,进行量化分析,建立股票价值评估体系,捕捉市场的投资机会。本基金多因子alpha模型使用的因子可以归为以下几类:价值因子、成长因子、盈利质量因子、技术面因子、市场预期因子等,其包含的具体指标大致如下:

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成长因子

成长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。

③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。

④技术面因子

技术面因子可以参考以下指标:反转、动量、流动性、换手率等。

⑤市场预期因子

市场预期因子包括:分析师对估值、成长等财务指标的预期,以及预期的变化等。

此外,基金管理人将依据经济周期、市场状况的变化,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）控制组合风险

本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施,控制投资组合的投资风险,力求将组合的风险控制在预期范围内。

3）减少交易成本

本基金在组合调整时将综合比较组合调整带来的潜在收益和组合调整的成本。其中,组合调整的成本既包括固定的交易成本,也包括交易的冲击成本。本基金在交易时将利用交易技术尽可能减少市场冲击,降低交易成本。

4）组合优化及调整

本基金将综合考虑市场变化、预期回报、预期风险以及交易成本等因素,对上述模型的选股结果进行优化,以确定个股的权重,构建风险收益最优的组合。

（2）港股通标的股票投资策略

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)境外投资额度进行境外投资。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、高股息等因子精选港股通标的股票。本基金将重点关注:

1）A股稀缺性行业个股,如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等;

2）具有持续领先优势或核心竞争力的企业;

3）盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司;

4）与A股同类公司相比具有估值优势的公司。

3、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。本基金将密切关注国内外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。

4、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率,力求稳健的超额收益。

5、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。

6、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。

7、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。

8、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。”

4、组合限制

原合同:

“基金的投资组合应遵循以下限制:

（1）本基金的投资组合比例为:股票、股指期货、权证等资产占基金资产的30%-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;

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金以后,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%;

（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,不超过该证券的10%;

（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;

（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%;本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为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依据下列标准建构组合:

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%;

②本基金在任何交易日日终，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;

③本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%;

④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;

⑤本基金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）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

（18）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本基金合同约定的投资范围保持一致;

（19）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;

（20）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）、（13）、（18）、（19）项另有约定外,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3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。”

修改为:

“基金的投资组合应遵循以下限制:

（1）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%;

（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后,本基金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;

（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%;

（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（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%;

（5）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%;

（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;

（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%;本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

（16）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本基金合同约定的投资范围保持一致;

（17）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合:

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%;

②本基金在任何交易日日终，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;

③本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%;

④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;

⑤本基金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%;

（18）本基金投资于股票期权的投资限制如下:

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本基金未平仓的期权合约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;

（19）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;

（20）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

（21）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;

（22）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）、（13）、（16）、（19）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。

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。”

5、业绩比较基准

原合同:

“本基金的业绩比较基准:60%*沪深300指数收益率+40%*中证全债指数收益率”

修改为:

“本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%”

（三）基金资产估值、信息披露等相关内容

前述内容调整涉及的基金资产估值、信息披露等内容一并修改。同时增加了摆动定价等条款,具体请见附件《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》。

（四）巨额赎回的处理方式

原合同:

“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、律师费和诉讼费;

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

赎回费率由:

| 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》、《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》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》及赎回费率,并相应修改更新托管协议及招募说明书。

（七）修改后的基金合同的生效

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自本次基金份额持有人大会决议生效公告之日起,修改后的《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》生效,原《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

三、基金管理人就相关事项的说明

（一）国泰策略收益的历史沿革

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。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】364号文）核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司、基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金于2013年7月12日至2013年8月8日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年8月12日生效。

依据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,国泰目标收益保本混合型证券投资基金的第一个保本期于2014年12月29日提前到期并进入过渡期,过渡期结束后的下一日起,由于不符合保本基金存续条件，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”,《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年1月16日生效。

（二）修改基金合同有利于保护基金份额持有人利益

本次基金合同修改后可以更好地满足投资者需求，并使基金法律文件符合现行法律法规与监管政策的要求,有利于维护基金份额持有人利益。

（三）基金合同修改的可行性

1、基金合同修改事项不存在法律障碍

《基金法》第四十七条规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权:……（二）决定修改基金合同的重要内容……”。

《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,国泰策略收益基金合同修改事项不存在法律方面的障碍。

2、基金合同修改不存在技术障碍

国泰策略收益基金合同修改后，国泰量化策略收益混合型证券投资基金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、修改基金合同的主要风险及预备措施

（一）修改基金合同方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计修改方案之前,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,对基金合同修改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）基金合同修改前后的运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金合同修改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:《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》

附件:

《国泰量化策略收益混合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,其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与基金合同有冲突,均以基金合同为准。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、国泰量化策略收益混合型证券投资基金由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来。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。国泰目标收益保本混合型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更为本基金的注册，并不表明中国证监会对本基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件,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。

四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息,其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的,如与基金合同有冲突,以基金合同为准。

五、本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

六、本基金资产投资于港股时,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请参见招募说明书“风险揭示”章节的相关内容。

七、本基金量化模型仅用于资产配置、选股和组合优化等,不基于量化模型进行高频程序化交易。本基金采用量化投资策略,存在源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。具体风险请参见招募说明书“风险揭示”章节的相关内容。

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:指国泰基金管理有限公司

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、决议、通知等

8、《基金法》: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,经由上海证券交易所和深圳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法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

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:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,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,办理基金销售业务的机构

25、注册登记业务:指基金注册登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

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代为办理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导致基金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、基金变更:指包括国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金修改投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费率、修订基金合同并更名为“国泰量化策略收益混合型证券投资基金”等一系列事项的统称

33、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日:指自T日起第n个工作日（不包含T日）

36、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》:指《国泰基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守

39、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

41、基金转换:指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

42、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

43、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

45、元:指人民币元

46、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

47、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

48、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

51、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

52、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

53、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

54、不可抗力:指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分基金的基本情况

一、基金名称

国泰量化策略收益混合型证券投资基金

二、基金的类别

混合型证券投资基金

三、基金的运作方式

契约型开放式

四、基金的投资目标

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投资回报。

五、基金的存续期限

不定期

第四部分基金的历史沿革

国泰量化策略收益混合型证券投资基金由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来。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。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】364号文）核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司、基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金于2013年7月12日至2013年8月8日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年8月12日生效。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金保本期一般最长为每3年一个周期,在每一保本期内均设置该保本期的目标收益率,在运作期间,如基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过预设目标收益率,则国泰目标收益保本混合型证券投资基金当期保本期提前到期。国泰目标收益保本混合型证券投资基金第一个保本期的目标收益率为15%。自2014年11月24日起至2014年12月12日止国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过15%，即国泰目标收益保本混合型证券投资基金已于2014年12月12日满足第一个保本期提前到期的条件。依据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,国泰目标收益保本混合型证券投资基金的第一个保本期提前到期并进入过渡期,过渡期结束后的下一日起,由于不符合保本基金存续条件,国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,变更后基金合同、托管协议和招募说明书分别修改为《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《国泰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、投资限制以及基金费率等条款的约定,并根据现行有效的法律法规规定,在对持有人无实质性不利影响的前提下对基金合同的其他条款进行了修订。自过渡期结束后的下一日起,《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》失效,《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

自201X年XX月XX日至201X年XX月XX日国泰策略收益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》,内容包括国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金修改投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费率、修订基金合同并更名为“国泰量化策略收益混合型证券投资基金”等事项。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自201X年XX月XX日起,由《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》生效,原《国泰策略收益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,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

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招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,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

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若该交易日为非港股通交易日，则基金管理人有权暂停办理基金份额的申购和赎回业务）。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

4、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立,注册登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;注册登记机构确认赎回时,赎回生效。基金份额持有人赎回生效后,基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日）,在正常情况下,本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）到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由于投资人的过错产生的任何损失由投资人自行承担。

基金管理人可在法律法规允许的范围内,依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整,并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

五、申购和赎回的数量限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、申购费用由投资人承担,不列入基金财产。

5、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。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。其中,对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金销售费用。

8、当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。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、港股通交易每日额度不足。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。发生上述第8项情形时,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回:当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回:当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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。

（3）暂停赎回:连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日,基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法》的有关规定,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

十二、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

十三、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十四、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十五、基金份额的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

十六、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由注册登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将与基金托管人协商一致并提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十七、如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第七部分基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

名称:国泰基金管理有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

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

设立日期:1998年3月5日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字【1998】5号

组织形式:有限责任公司

注册资本:壹亿壹仟万元人民币

存续期限:持续经营

联系电话:400-888-8688

（二）基金管理人的权利与义务

1、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）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;

（2）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;

（3）销售基金份额;

（4）按照规定召集基金份额持有人大会;

（5）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,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者的利益;

（6）在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

（7）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;

（8）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;

（9）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

（10）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;

（11）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;

（12）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;

（13）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;

（14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;

（15）在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则;

（16）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、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）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申购、赎回和注册登记事宜;

（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,确定基金份额申购、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）按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

（15）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;

（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,法律法规另有规定的从其规定;

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《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）执行生效的基金份额持有人大会的决议;

（25）建立并保存基金份额持有人名册;

（26）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、基金托管人

（一）基金托管人简况

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

法定代表人:田国立

成立时间:2004年9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

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币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

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】12号

（二）基金托管人的权利与义务

1、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,如发现基金管理人有违反《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者的利益;

（4）根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货交易资金清算;

（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。

2、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、基金份额申购、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;如果基金管理人有未执行《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,法律法规另有规定的从其规定;

（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业监督管理机构,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。

三、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、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）依法申请赎回或转让其持有的基金份额;

（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。

2、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。

第八部分基金份额持有人大会

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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设立日常机构。

一、召开事由

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（法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的除外）:

（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）调整基金管理人、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;

（9）变更基金份额持有人大会程序;

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

（11）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

（13）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、在不违背法律法规和《基金合同》的约定,以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改,不需召开基金份额持有人大会:

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取;

（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率,或变更收费方式;

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

（4）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;

（5）本基金推出新业务或服务;

（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。

二、会议召集人及召集方式

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。

（下转B099版）

# 关于国泰利享中短债债券型证券投资基金延长募集期的公告

国泰利享中短债债券型证券投资基金（以下简称本基金）已获中国证监会证监许可【2018】1720号文准予注册募集。本基金已于2018年11月5日开始募集,原定募集时间截止日为2018年11月27日。

为充分满足投资者的投资需求,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》以及《国泰利享中短债债券型证券投资基金基金合同》、《国泰利享中短债债券型证券投资基金招募说明书》、《国泰利享中短债债券型证券投资基金基金份额发售公告》的有关规定,经本基金管理人国泰基金管理有限公司与本基金托管人招商银行股份有限公司以及本基金各销售机构协商一致,决定延长本基金的募集期,调整后的募集时间为2018年11月5日至2018年11月29日。

投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登于2018年11月2日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《国泰利享中短债债券型证券投资基金招募说明书》、《国泰利享中短债债券型证券投资基金基金合同摘要》和《国泰利享中短债债券型证券投资基金基金份额发售公告》等法律文件。

投资人也可访问本基金管理人网站（www.gtfund.com）或拨打全国免长途话费的客户服务电话（400-888-8688）咨询相关情况。

风险提示: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。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018年11月27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第二次提示性公告

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”）基金合同于2015年12月2日生效,基金管理人和注册登记机构为国泰基金管理有限公司（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3日到期。

依据本基金管理人于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的《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》（以下简称“《规则公告》”）,本基金管理人特别提示如下:

1、保本期到期日

第一个保本期到期日为2018年12月3日。

2、保本期到期选择期

本基金第一个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”基金份额。

3、基金变更日

当期保本期到期日的次日起，本基金变更为“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日起变更后的基金合同生效。

4、申购赎回业务开放及暂停的时间安排

（1）自2018年11月24日（含）至2018年12月3日（含）止,本基金日常申购业务、转入业务暂停办理,本基金赎回业务和转出业务正常办理。

（2）自2018年12月4日（含）起,恢复日常申购业务、转入业务,赎回业务和转出业务依旧照常办理,定投业务的办理时间另行公告。

除开始办理定投业务外,上述暂停及开放业务,届时不再另行公告。

5、变更后基金基本情况

本基金变更后,基金名称变更为“国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金”,基金简称变更为“国泰多策略收益灵活配置混合”,基金代码仍为“001922”。

6、到期选择的风险揭示

（1）“国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金”由“国泰新目标收益保本混合型证券投资基金”变更而来。敬请基金份额持有人关注您持有的保本基金份额变更为非保本的混合型基金份额的风险。请您根据本公告及其他相关公告及时做出基金份额赎回、转换转出或继续持有的投资决定。

（2）敬请您在选择继续持有或申购国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金前,仔细阅读本公告及《国泰新目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》中关于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，并关注本基金管理人后续公告的《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,充分了解相关投资风险,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。

本公告仅对本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等重要事项予以提示,其他具体事项和详细规则请参见本基金管理人于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的《规则公告》。

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

二〇一八年十一月二十七日

# 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26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,并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所带来的风险。

二、医药B份额表现为高预期风险、高预期收益的特征,不定期份额折算后其杠杆倍数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,原医药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。此外,国泰医药为跟踪国证医药卫生行业指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌变化,因此原医药A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。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,此折算基准日医药B的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份额的持有人存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。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018年11月27日

# 国泰基金管理有限公司关于新增江苏银行股份有限公司直销账户的公告

为更好地服务于投资者,国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于2018年11月27日起新增江苏银行股份有限公司直销账户,现将具体详情公告如下:

一、新增直销账户信息

开户名称:国泰基金管理有限公司直销专户

开户账号:18200188000394309

开户银行:江苏银行上海分行营业部

人行实时支付系统号:313290050010

二、投资者可通过以下途径了解或咨询相关详情

国泰基金管理有限公司

地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16-19层

客服电话:400-888-8688

网址:www.gtfund.com

风险提示: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27日