国泰基金管理有限公司关于以通讯方式召开国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会相关事项的提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）决定以通讯方式召开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”）的基金份额持有人大会。本基金包括基础份额及分级份额：基础份额简称“国泰医药份额”（场内简称“国泰医药”，基金代码“160219”）；分级份额包括“医药A份额”（场内简称“医药A”，基金代码“150130”）和“医药B份额”（场内简称“医药B”，基金代码“150131”）。本次基金份额持有人大会投票表决起止时间为自2020年8月26日起至2020年9月28日17:00止。为保护投资者利益，现基金管理人提示如下：

一、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将医药A份额与医药B份额按照基金份额净值折算为国泰医药份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

二、本基金医药A份额、医药B份额的首次停牌时间为2020年8月26日开市起至当日10:30。本基金医药A份额、医药B份额第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2020年9月29日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

三、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。

国泰基金管理有限公司
2020年8月26日

关于以通讯方式召开国泰国证医药卫生行业指数分级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

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）管理的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”）的基金合同于2013年8月29日生效。本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称“国泰医药份额”（场内简称“国泰医药”，基金代码“160219”）；分级份额包括“医药A份额”（场内简称“医药A”，基金代码“150130”）和“医药B份额”（场内简称“医药B”，基金代码“150131”）。

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”）的有关约定，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议对国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金实施转型，内容包括国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金实施转型，内容包括国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金实施终止清算及分级份额分级运作机制、调整基金份额类别设置，修改基金的投资、基金资产估值、基金的费用与税收、基金的收益与分配、基金合同等内容，更名为“国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）”并修订《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

为实施国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金转型方案，提议权利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，根据规则对有关的法律法规的要求和《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”）等有关规定，国泰医药分级基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国农业银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。

2、本次国泰医药分级转型事项属对国泰医药分级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、本次国泰医药分级转型事项须经参加本次基金份额持有人大会的国泰医药份额、医药A份额与医药B份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰医药份额、医药A份额与医药B份额各自类别内的表决权不少于二分之一以上（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、本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。法律法规另有规定的，从其规定。

5、中国证监会对本次国泰医药分级的变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次国泰医药分级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、国泰医药分级转型方案要点

转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金”变更为“国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）”（以下简称“本基金”）。

（二）取消分级运作机制

转型后本基金将终止分级运作，因而不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制。

（三）终止医药A份额和医药B份额的上市交易

本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理医药A份额和医药B份额的终止上市业务。

（四）转型后的基金份额类别设置

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同类别。在投资人申购基金份额时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

国泰医药份额、医药A份额和医药B份额最终将全部转换为国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额。

本基金开放申购后，投资人可自行选择申购的基金份额类别，本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

（五）转型后基金份额的上市交易

在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请本基金A类基金份额的上市交易。

本基金A类基金份额上市后，投资在证券登记系统中的A类基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的A类基金份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记系统后，方可上市交易。

本基金的上市交易按照深圳证券交易所相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

（六）转型后基金的投资

1、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、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）。

本基金将根据法律法规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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%；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，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

（1）股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

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0.35%，年跟踪误差不超过4%。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。

（4）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。

（5）可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转换债券的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转换债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

（6）融资与转融通证券出借投资策略

本基金在参与融资业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模。本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。

为更好实现投资目标，在加强风险控范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

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）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%；

2）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，本基金持有的现金或者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%；

4）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%；

5）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%；

6）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%；

7）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；

8）基金的产品参与股票发行申购，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%，进入全国银行间回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；

10）本基金参与股指期货交易，遵守以下投资限制：

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100%，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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含押式回购）等；

③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%；

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%；

11）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

12）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%；

13）本基金参与转融通证券出借业务的，遵守以下投资限制：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的30%，出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

②参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的50%；

③最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

④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；

⑤因证券市场波动、上市公司合并、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，基金管理人不得新增出借业务；

14）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；

15）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；

16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第2）、7）、14）、15）项以外约定外，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因素导致基金投资组合比例不符合上述限定投资比例的，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。法律法规另有规定时，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限制为准。

（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。

5、业绩比较基准

国证医药卫生行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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停价或终止发布，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，根据实际情况在按照监管部门要求履行适当程序后对业绩比较基准进行相应调整并及时公告。若变更标的指数并相应调整业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项），无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应经基金托管人同意，报中国证监会备案，并在调整前在至少一种规定媒介上予以公告。

（七）风险收益特征

本基金为股票型指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

（八）摆动定价机制

摆动定价机制是指当本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。

（九）转型后基金的费用

1、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A类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

（4）基金合同生效后的标的指数许可使用费；

（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、仲裁费和诉讼费；

（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）基金上市费及年费；

（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。

2、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。

3、托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。

4、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0.30%年费率计提。

5、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数许可使用费。通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，且收取下限为每季度人民币5万元。

6、申购费

投资人在申购A类基金份额时支付申购费用，申购C类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

A类基金份额与私募证券投资基金申购费率相同，如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M＜50万	1.00%
50万≤M＜100万	0.60%
M≥100万	每笔1,000元

7、赎回费

本基金A类份额的赎回费率如下：

	赎回申请份额持有时间（N）	赎回费率
A类份额赎回费（场外）	N＜7日	1.50%
	7日≤N＜1年	0.50%
	1年≤N＜2年	0.25%
	N≥2年	0.00%
A类份额赎回费（场内）	N＜7日	1.50%
	N≥7日	0.50%

本基金A类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，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日的基金份额持有人收取的赎回费，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日的基金份额持有人收取的赎回费，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日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。赎回费中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。

本基金C类份额的赎回费率如下：

	赎回申请份额持有时间（Y）	赎回费率
C类份额赎回费	Y＜7日	1.50%
	7日≤Y＜30日	0.10%
	Y≥30日	0.00%

本基金C类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30日的基金份额持有人不收取赎回费。

（十）转型后基金的收益与分配

1、基金收益分配原则

（1）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（2）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金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；

（3）本基金场外份额的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自动转为相应类别的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；本基金场内份额的收益分配按照深证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执行；

（4）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；

（5）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

3、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在规定媒介公告。

4、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。对于场外份额，当基金份额持有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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内基金份额，则遵循深证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。

（十一）转型后的基金资产估值

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的限售期限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于合投资人回报权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市、且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

6、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7、本基金投资的股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。国家有最新规定的，按其规定进行估值。

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。

9、本基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

（十二）转型后基金的终止条款

《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50个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

（十三）授权基金管理人修订《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金托管协议》、《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金招募说明书》等法律文件

除上述转型方案要点外，考虑到自国泰医药分级基金合同生效以来，相关法律法规及监管细则的不断调整以及市场环境的不断变化，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）的产品特征修订《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》，修订后的内容请见附件《国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）基金合同》，并相应修订《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金托管协议》、《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金招募说明书》。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人对上述文件进行修订。

（十四）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，国泰医药分级将安排不少于20个工作日的选择期（具体以基金管理人公告为准）。选择期期间，基金份额持有人可以选择卖出医药A份额、医药B份额或者赎回国泰医药份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的医药A份额、医药B份额和国泰医药份额将最终转换为国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回的，仍适用国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

由于国泰医药分级在选择期期间需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免国泰医药分级基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人拟此席次相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出、配对转换或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十五）基金份额折算与转换的相关安排

转型选择期届满的次一工作日为分额转换基准日，也是医药A份额、医药B份额终止运作日。基金管理人在分额转换基准日将国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的各类基金份额最终转换成国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额，登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。在份额转换基准日，国泰医药份额的场内份额、医药A份额、医药B份额将最终转换为国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额，国泰医药份额的场外份额将最终转换为国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场外份额。

医药A份额（或医药B份额）的转换比例=份额转换基准日医药A份额（或医药B份额）的基金份额净值/份额转换基准日国泰医药份额的基金份额净值

医药A份额（或医药B份额）基金份额持有人持有的转换而来的国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额数=基金份额持有人持有的转换前医药A份额（或医药B份额）的份额数×医药A份额（或医药B份额）的转换比例

医药A份额（或医药B份额）基金份额持有人持有的转换而来的国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额数=基金份额持有人持有的转换前医药A份额（或医药B份额）的份额数

国泰医药份额的场内份额（或场外份额）基金份额持有人持有的转换而来的国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）A类基金份额的场内份额（或场外份额）的份额数

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人就此落实医药A和医药B份额终止运作日、暂停申购赎回、暂停配对转换、暂停跨系统转托管、基金份额折算与转换等相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十六）转型后的基金的日生效

自基金份额转换基准日的次一工作日起，由《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》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《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金转型方案说明书》以转型方案要点修订基金合同并实施转型方案。

三、基金管理人就风险揭示的重大事项的说明

（一）国泰医药分级的历史沿革

国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】163号）核准，自2013年8月5日起向社会公开募集，于2013年8月23日结束募集工作，并于2013年8月29日获得中国证监会的书面确认，《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》自该日起生效。

1、基金转型的可行性

1.基金转型不存在法律障碍

《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，国泰医药分级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

国泰医药分级转型为国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF）后，在技术系统运作上与基金管理人管理的其他同类基金开无明显差异，因而不存在技术操作上的障碍。

四、基金转型计划的风险及预备措施

（一）基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将医药A份额与医药B份额按照基金份额净值折算为国泰医药份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

（二）基金转型完成后，基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国证券监督管理委员会、中国证券业协会有关规定，提请基金份额持有人大会表决通过的可能。

（三）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）送达时间按照下原则确定：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、本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的国泰医药份额、医药A份额与医药B份额合计份额分别占权益登记日国泰医药份额、医药A份额和医药B份额各自基金总份额50%以上（含50%）；

2、《关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》须经参加基金份额持有人大会的国泰医药份额、医药A份额和医药B份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰医药份额、医药A份额和医药B份额各自类别内的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自表决通过之日起五日内报中国证监会备案。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》的规定，本次持有人大会需要直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的国泰医药份额、医药A份额和医药B份额分别占权益登记日国泰医药份额、医药A份额和医药B份额各自基金总份额50%以上（含50%）。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）

会务常说联系人：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：中国农业银行股份有限公司

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、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将医药A份额与医药B份额按照基金份额净值折算为国泰医药份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、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。

3、根据深圳证券交易所业务规则要求，本基金医药A份额、医药B份额的首次停牌时间为本公告刊登日（2020年8月26日）开市起至当日10:30。本基金医药A份额、医药B份额第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2020年9月29日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4、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。

5、关于本次议案的说明见附件四《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

6、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：《关于国泰国证