

---

# 关于召开金泰证券投资基金基金份额持有人大会的公告

## 一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《金泰证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，金泰证券投资基金（以下简称“金泰基金”或“本基金”）的基金管理人国泰基金管理有限公司决定以现场方式召集本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

- 1、会议时间：2012年11月1日上午9时30分。
- 2、会议地点：北京远通维景国际大酒店。
- 3、召开方式：现场方式。
- 4、会议登记截止时间：2012年11月1日上午9点15分。

基金份额持有人或其代理人应当按照本公告的要求，携带必需的文件于会议登记截止时间前到达会议地址办理会议登记手续，会议登记于2012年11月1日上午8点整开始办理。会议登记截止时间后，不再对未登记的基金份额持有人或其代理人进行登记，未登记的持有人或其代理人不得入场参加会议。

## 二、会议审议事项

《关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

## 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2012年10月11日，即在2012年10月11日上海证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）上海分公司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、会议的议事程序和表决方式

- 1、基金管理人授权的大会主持人宣布会议开始；
- 2、大会主持人宣布与会的基金份额持有人和代理人数量及其所持有的基金份额总数、

---

占权益登记日基金总份额的比例；

3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；

4、大会主持人确定和公布监票人，在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；

5、大会主持人公布监督人、见证律师、公证机构和公证员；

6、大会主持人宣读议案；

7、享有表决权的与会人员对议案进行审议，并进行表决；

8、监票人在基金份额持有人表决后立即进行清点，计票过程将由公证机关予以公证；

9、大会主持人当场公布计票结果；

10、形成大会决议，由见证律师就本次会议召开的程序以及持有人大会形成的决议的合法性、合规性发表法律意见，并由公证员就本次会议的程序和计票结果发表公证意见。

#### **五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件**

1、个人持有人出席会议的，需提供本人有效身份证件原件及正反面复印件；

2、机构持有人出席会议的，需提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（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），和代表机构持有人出席会议的授权代表的有效身份证件原件及正反面复印件、机构持有人所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该机构持有人出席会议的其他证明文件；

3、合格境外机构投资者出席会议的，需提供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、取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及代表该合格境外机构投资者出席会议的授权代表的有效身份证件原件及正反面复印件、机构持有人所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该机构持有人出席会议的其他证明文件；

4、基金份额持有人委托基金管理人或其他符合法律规定的机构和个人等代理人出席本次大会的，还应按照本公告第六条的规定，提供相关资料。

#### **六、授权**

本基金的基金份额持有人如不能亲自出席本次大会，可以授权委托基金管理人或其他

---

符合法律规定的机构和个人等代理人出席会议并投票。

1、个人持有人委托他人出席会议的，需要提交持有人签字的授权委托书（内容及格式参考本公告附件二）和持有人有效身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件原件及正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（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），和代表受托机构出席会议的个人的有效身份证件原件及正反面复印件及受托机构授权委托书。

2、机构持有人委托他人出席会议的，需要提交持有人加盖公章的授权委托书（内容及格式参考本公告附件二）和持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件原件及正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（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），和代表受托机构出席会议的个人的有效身份证件原件及正反面复印件及受托机构授权委托书。

3、基金份额持有人授权基金管理人出席会议并邮寄授权委托书的，应将个人持有人的有效身份证件正反面复印件或机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）以及经个人持有人签字或机构持有人加盖公章的授权委托书（内容及格式参考本公告附件二）于 2012 年 10 月 31 日下午 5 点 30 分前邮寄至以下任一地址：

（1）北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 5 楼（F526-530），国泰基金管理有限公司，联系人：惠阳

（2）上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼，国泰基金管理有限公司，联系人：何晔

基金管理人接受邮寄授权委托书的截止时间以收到时间为准。请持有人充分考虑邮寄在途时间。

## **七、基金份额持有人大会预登记**

### **1、现场方式预登记**

基金份额持有人采用现场方式进行预登记的，应当按照本公告第五条的规定提供相关

---

资料。现场方式预登记地址：

(1) 北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 5 楼 (F526-530)，联系人：惠阳

(2) 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼，联系人：何晔

## 2、传真方式预登记

在预登记时间内，基金份额持有人可凭上述资料的传真件向基金管理人进行预登记，传真号为 021-38561700（确认电话为：021-38569000，联系人：何晔）

## 3、预登记时间

2012 年 10 月 12 日至 2012 年 10 月 29 日，每天 9：00---17：00，周六、周日及法定节假日除外，基金管理人将为基金份额持有人办理现场方式预登记或传真方式预登记。

## 4、关于预登记的说明

基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况，以便为持有人大会召开进行相应准备。持有人大会会议入场前仍需按照本公告第五条的规定提供相关资料办理现场会议登记，请各基金份额持有人予以积极配合。

## 八、计票

1、基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与基金管理人授权的一名监督员共同担任监票人；

2、监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果；

3、如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次；

## 4、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公告规定，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参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；

(2) 如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认的，或表决票上的签字填写不完整、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，均

---

为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；

(3) 计票过程由公证机关予以公证。

## 九、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权代理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占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

2、《关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案》应当由出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 2/3 以上通过；

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核准，基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准之日起生效。

## 十、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：何晔

联系电话：021-38569000

传真：021-38561700

电子邮件：[service@gtfund.com](mailto:service@gtfund.com)

网址：[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)

2、公证机构：北京市方正公证处

3、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

## 十一、重要提示

1、本次会议将于 2012 年 11 月 1 日上午 9 时 30 分召开，届时基金管理人、基金托管人、基金管理人聘请的见证律师和公证机关人员将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件于当日上午 8 时之前到达会议地点，以便验证入场。会议登记截止时间为当日上午 9 点 15 分。会议登记截止时间后，不再对未登记的基金份额持有人或其代理人进行登记，未登记的持有人或其代理人不得入场参加会议。

---

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电 400 888 8688 咨询。

3、基金份额持有人做出授权时，可下载、复印授权委托书。

4、如基金份额持有人授权代理人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，应提前或在登记时向召集人说明，并以其本人亲自投票的表决意见为准。

5、基金管理人将向上海证券交易所申请本基金自 2012 年 10 月 12 日开始持续停牌。基金管理人将于基金份额持有人大会决议公告后向上海证券交易所申请复牌。

6、本公告的有关内容由国泰基金管理有限公司解释。

附件一：《关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：授权委托书样本

国泰基金管理有限公司

2012 年 9 月 28 日

---

附件一：

## 关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案

金泰证券投资基金基金份额持有人：

鉴于金泰证券投资基金（下称“金泰基金”）将于 2013 年 3 月 26 日到期，为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》、《证券投资基金运作管理办法》和《金泰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工商银行股份有限公司协商一致，提议对金泰基金实施转型。《金泰证券投资基金转型方案说明书》见本议案之附件。

为实施金泰基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次金泰基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，以及根据《金泰证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《金泰证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

国泰基金管理有限公司

---

## 《关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案》之附件

### 《金泰证券投资基金转型方案说明书》

#### 一、声明

1、鉴于金泰证券投资基金（简称“金泰基金”）基金合同将于 2013 年 3 月 26 日到期，为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》、《证券投资基金运作管理办法》和《金泰证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国工商银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议关于金泰证券投资基金转型有关事项的议案。

2、本次金泰基金转型方案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人及代理人所持表决权的 2/3 以上通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。中国证监会对本次金泰基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

#### 二、金泰基金转型方案要点

金泰基金转型方案的主要内容如下：

##### （一）转换基金运作方式

金泰基金由封闭式基金转型为开放式基金，在完成有关转型程序后，开放申购、赎回等业务。

##### （二）调整基金存续期限

基金存续期由 2013 年 3 月 26 日到期调整为无限期存续。

（三）授权基金管理人向上海证券交易所申请终止或提前终止基金的上市交易并进行变更登记

基金在上海证券交易所终止或提前终止上市交易后，基金管理人将进行基金份额更名以及必要的信息变更；中国证券登记结算有限责任公司将为基金份额持有人办理基金份额的初

---

始登记。在基金开放赎回业务后，原基金份额持有人可通过场内上海证券交易所开放式基金销售系统（以下简称“上证基金通”）或在办理相关手续后通过场外销售机构办理基金份额的赎回。

#### （四）调整基金的投资目标、投资范围和投资策略

##### 1、投资目标

金泰基金投资目标是“为投资者分散和减少投资风险，确保基金资产的安全，并谋求基金长期稳定的投资收益”。

**投资目标拟调整为**“在有效控制风险的前提下，追求相对稳定的回报”。

##### 2、投资范围

金泰基金投资范围是：“本基金投资范围仅限于国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具”。

##### **投资范围拟调整为：**

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（含中小企业私募债）、中期票据、债券回购、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款、协议存款、大额存单等）、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）。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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-50%；债券、银行存款等固定收益类资产、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 50%-100%；其中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%。

##### 3、投资策略

金泰基金投资策略是：

本基金投资时，根据宏观经济环境及其对证券市场的影响，决定投资策略；根据货币政策的变化、利率的走势，决定国债在投资组合中的比例；根据对行业及地区经济发展状况的深入研究，决定股票投资重点；根据对上市公司的调查研究，确定具体的股票投资组合。

本基金的股票投资将以中长期投资为主，在充分研究的前提下，主要投资于绩优股和高成长股，以保证基金资产的稳定收益，实现基金资产的增值。

在股票投资组合中，将保留一定比例的短期投资。短期投资主要根据市场变化，相机抉择，灵活投资，在防范风险的前提下，增加基金的收益。

为保证基金资产的流动性和收益性，在国债投资组合中，长期国债和短期国债将保持适当的比例。

### 投资策略拟调整为：

#### I 大类资产配置

本基金的资产配置分为二个层次，首先应用投资时钟，分析当前所处的经济周期，以确定大类资产的配置比例；其次是在确定大类资产的配置比例后，应用 Melva 资产评估系统进行日常的动态股票资产配置。

#### 1、投资时钟的运用

本基金运用投资时钟，根据对经济增长和通货膨胀的分析，判断当前时段在经济周期中所处的具体位置，并以此确定所投资的大类资产种类及不同类别资产的投资优先级别。

衰退阶段，经济增长停滞。超额的生产能力和下跌的大宗商品价格驱使通货膨胀率更低。企业赢利微弱并且实际的收益率下降，失业率处于高位。随着央行下调短期利率，试图刺激经济回复到长期增长趋势，收益率曲线急剧下行。此阶段债券是最佳的资产选择。

复苏阶段，宽松的货币政策发挥效力，经济加速增长到长期增长趋势附近，因剩余产能充足，通胀水平仍在下降；因边际成本较低，公司毛利快速增长，盈利增长强劲。此阶段股票是最佳的资产选择。

过热阶段，经济增长率仍处于长期增长趋势之上，因资源与产能限制，通胀压力显现；公司收入增长仍然较快，但通胀与成本压力逐渐拖累其业绩表现。央行加息试图使经济增长率向长期增长趋势回落。随着收益率曲线上行和平坦，债券表现不佳。股票投资收益依赖于强劲的利润增长和价值重估两者的权衡。此阶段大宗商品是最好的资产选择。

滞胀阶段，经济增长率降到长期增长趋势之下，但通胀却继续上升。生产不景气，产量下滑，企业为了保持盈利意图提高产品价格，导致工资-价格螺旋上涨。企业的盈利恶化，股票表现不佳，此阶段现金是最佳的选择。

#### 资产配置示意图

阶段	增长率	通货膨胀	最佳资产类别
衰退	↓	↓	债券
复苏	↑	↓	股票

过热	↑	↑	大宗商品
滞涨	↓	↑	现金

## 2、Melva 资产评估系统的运用

本基金运用基金管理人的资产配置评估模型（Melva），通过宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关因素的分析判断，采用评分方法确定配置比例，以进行日常的动态股票资产配置。

### II 股票投资策略

本基金个股选择主要是从两个角度考虑，一个角度是选择盈利能力强、确定性高、估值安全的上市公司；另一个角度是根据事件驱动策略选择受益于事件因素或市场估值未能充分体现事件影响的上市公司。

#### 1、盈利能力股票选择

##### （1）通过定量、定性分析，构建备选股票池

股票投资采取自下而上精选个股的策略，利用 ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力较强的上市公司，构成具有盈利能力的股票备选池。

针对股票备选池中的股票，进一步进行深入研究，重点关注以下几个方面：

1) 公司的商业模式是否具有持续性、商业模式中的企业竞争力是否足够强、以及是否能够提供持续的净现金流；

2) 公司管理层的专业素质和道德品质、管理层利益与股东利益的相关性、以及管理层过去的言行与诚信记录。

##### （2）价值评估分析

本基金通过价值评估分析，选择价值被低估的上市公司，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。关注公司的价格是否足够便宜和安全，便宜是基于多个估值指标的横向和纵向比较，安全是基于股价处于过去各个阶段的相对位置。

具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率法、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，本基金管理人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。

## 2、事件驱动策略

在个股选择上，本基金还将应用事件驱动策略，通过对影响上市公司当前及未来价值的事件性因素进行全面的分析，深入挖掘受益于事件因素或市场估值未能充分体现事件影响的上市公司股票，在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下，精选个股，并依据事件影响的深入对其进行动态调整。

## III 债券投资策略

本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略、可转债策略、回购交易套利策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。

### 1、久期策略

本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极的预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。

在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。

### 2、收益率曲线策略

在组合的久期配置确定以后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

### 3、信用债策略

本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。具体的投资策略包括：

---

(1) 自上而下与自下而上的分析相结合的策略。自上而下即从宏观经济、债券市场、机构行为等角度分析，制定久期、类属配置策略，选择投资时点；自下而上即寻找相对有优势和评级上调概率较大的公司，制定个券选择策略；

(2) 相对投资价值判断策略。根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。由于利差水平受流动性和信用水平的影响，因此该策略也可扩展到新老券置换、流动性和信用的置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券或是流动性更好的债券，或在相同外部信用级别和收益率下，买入内部信用评级更高的债券；

(3) 信用风险评估。信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险收益的信用利差。基准收益率主要受宏观经济政策环境的影响，而信用利差收益率主要受该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线以及该信用债本身的信用变化的影响。债券发行人自身素质的变化，包括公司产权状况、法人治理结构、管理水平、经营状况、财务质量、抗风险能力等的变化将对信用级别产生影响。

本基金管理人将利用内部评级系统来对信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差进行全面的分析。该系统包含定性评级、定量打分以及条款分析等多个不同层面。定性评级主要关注股权结构、股东实力、行业风险、历史违约及或有负债等；定量打分系统主要考察发债主体的财务实力。目前基金管理人共制定了包括煤炭、钢铁、电力、化工等 24 个行业定量财务打分方法，对不同发债主体的财务质量进行量化的分析评估；条款分析系统主要针对有担保的长期债券，通过分析担保条款、担保主体的长期信用水平，并结合担保情况对债项做出综合分析。

#### 4、可转换债券策略

可转换公司债券兼具股票与债券的特性。本基金也将充分利用可转债具有安全边际和进攻性的双重特征，在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，配置溢价率低、具有一定安全边际的可转债进行投资。

#### 5、回购套利策略

回购套利策略也是本基金重要的投资策略之一，把信用债投资和回购交易结合起来，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来博取超额收益，或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。

#### IV 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，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。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。

#### 1、时机选择策略

根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析，决定是否对投资组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。

#### 2、期货合约选择和头寸选择策略

在套期保值的现货标的确认之后，根据期货合约的基差水平、流动性等因素选择合适的期货合约；运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸；对套期保值的现货标的 Beta 值进行动态的跟踪，动态的调整套期保值的期货头寸。

#### 3、展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对期货合约进行展期。理论上，不同交割时间的期货合约价差是一个确定值；现实中，价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差，选择合适的交易时机进行展仓。

#### 4、保证金管理

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

#### 5、投资组合管理策略

本基金建仓时，将根据市场环境，运用股指期货管理建仓成本。

本基金出现较大申购赎回时，将运用股指期货管理组合的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

未来，随着中国证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，基金可相应调整和更新相关投资策略。

#### （五）授权基金管理人修订基金合同

除上述内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《金泰证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基

---

金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据法律法规要求修订《金泰证券投资基金基金合同》的相关内容。

同时由于基金风险收益特征和产品类型发生相应变更，金泰基金的名称将变更为“国泰金泰平衡混合型证券投资基金”。

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、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的内容。修订后的基金合同需经基金管理人和基金托管人签字盖章，报中国证监会核准。

### 三、基金管理人就方案相关事项的说明

#### （一）金泰基金的历史沿革

金泰证券投资基金由国泰证券有限公司（后合并组建国泰君安证券股份有限公司）、上海爱建信托投资有限责任公司、浙江省国际信托投资有限责任公司（后更名为中投信托有限责任公司）和中国电力信托投资有限公司（后改组成立中国电力财务有限公司）四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《金泰证券投资基金基金契约》（后更名为《金泰证券投资基金基金合同》）发起，经中国证监会证监基金字[1998]7号文批准，于1998年3月27日募集成立。金泰基金为契约型封闭式，存续期15年，发行规模为20亿份基金份额。

金泰基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。经上海证券交易所上证上字[1998]第015号文审核同意，于1998年4月7日在上海证券交易所挂牌交易。

#### （二）基金转型有利于保护份额持有人利益

金泰基金基金合同将于2013年3月26日到期。如果任其到期清算，基金份额持有人不仅要承担股票资产变现的冲击成本，还要承担清算费用以及清算期间的机会成本。实施基金转型不但避免了到期清算产生的相关成本，也彻底消除了基金折价交易现象，有利于更好的保护份额持有人利益。

#### （三）基金调整存续期限的必要性

根据《金泰证券投资基金基金合同》的规定，基金存续期截至2013年3月26日为止。根据有关法律法规的规定，基金转型为开放式基金后，可无限期存续。为避免到期时基金清算产生的相关成本，更好地保护份额持有人利益，基金应调整存续期限。

---

#### （四）基金转型的可行性

##### 1、基金转型不存在法律障碍

《基金法》第七十一条规定，“下列事项应当通过召开基金份额持有人大会审议决定：（三）转换基金运作方式……”。

依据金泰基金的基金合同和《基金法》规定，转换基金运作方式应当经参加持有人大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过。按照基金份额持有人大会的决议，并经中国证监会核准，基金可以转换基金运作方式。

因此，金泰基金由封闭式转为开放式不存在法律方面的障碍。

##### 2、基金转型不存在技术障碍

基金终止上市后，将进行基金份额变更登记。上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及其上海分公司和基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。变更登记完成后，基金份额持有人可使用证券账户通过场内“上证基金通”系统或在办理相关手续后通过场外销售机构办理申购、赎回、转托管等业务，不会导致基金份额持有人无法变现基金份额。基金转型不存在技术障碍。

##### 3、调整投资目标、投资范围和投资策略的可行性

基金转型后，其投资范围、比例限制等应符合法律法规的规定，必须对原有合同中的有关内容进行修订。修订后的投资目标、投资范围和投资策略将进一步突出追求相对稳定回报的目标。

##### 4、授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同需经基金管理人和基金托管人签字盖章，报中国证监会核准。

#### 四、基金转型的主要风险及预备措施

##### （一）转型方案被持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。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）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

### 1、实施集中申购

为降低部分持有人在基金开放后大量赎回对基金平稳运作的影响，在基金终止上市后，基金管理人将以中国证券登记结算有限责任公司作为注册登记机构，通过各销售机构进行集中申购，集中申购期不超过一个月，并于集中申购结束后的1个月内开放日常申购、赎回。

#### （1）集中申购费率

申购金额 M	费率
M < 50 万	1.20%
50 万 ≤ M < 200 万	1.00%
200 万 ≤ M < 500 万	0.60%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

#### （2）赎回费率

持有期限	赎回费率
1 年以内（不含 1 年）	0.50%
1 年到 2 年（不含 2 年）	0.2%
2 年（含 2 年）以上	0

基金份额持有人在基金终止上市前持有的原金泰基金份额，持有期限自《国泰金泰平衡混合型证券投资基金基金合同》生效之日起计算；基金份额持有人通过集中申购和日常申购所得的基金份额，持有期限自注册登记机构确认登记之日起计算。本基金赎回费的 25% 归入基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。

### 2、份额拆分

基金管理人将在基金集中申购验资结束当日，按当日基金份额净值对原金泰基金基金份额进行份额拆分。拆分后，基金份额净值为 1.000 元。

对于基金份额持有人因暂未进行份额托管等原因产生的未领取现金红利，基金管理人将在基金集中申购验资结束当日即原基金份额持有人基金份额拆分日当日按 1.000 元将该持有人的未领取现金红利自动折算为基金份额，记入基金份额持有人的相关账户。

3、基金转型方案公告后，若出现基金折价率持续放大或基金净值剧烈波动等极端情况，基金管理人将根据实际情况，加快转型进程，更早开放基金的日常赎回业务。

## 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：021-38569000

传真：021-38561700

电子邮件：[service@gtfund.com](mailto:service@gtfund.com)

网址：[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)

附件二：

## 授权委托书

兹委托 \_\_\_\_\_ 代表本人（或本机构）出席于  
\_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日召开的金泰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。

个人委托人（签字）： \_\_\_\_\_

机构委托人（加盖公章）：

个人委托人证件号码：

证券账户卡号：

受托人：

个人受托人证件号码：

委托日期： \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日

附注：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。

授权委托书填写注意事项：

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《金泰证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。

2、基金份额持有人可以授权本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、本授权委托书（样本）中“个人委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或购买本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

4、本授权委托书（样本）中“证券账户卡号”，仅指持有金泰基金份额的证券账户卡卡号。同一基金份额持有人拥有多个此类证券账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写证券账户卡号，其他情况可不填写。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金泰基金所有份额。