

---

---

国泰国证医药卫生行业指数分级  
证券投资基金更新招募说明书  
(2018 年第一号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

截止日：二〇一八年二月二十八日

---

---

## 目 录

重要提示.....	1
第一部分 绪言.....	3
第二部分 释义.....	3
第三部分 基金管理人.....	8
第四部分 基金托管人.....	22
第五部分 相关服务机构.....	25
第六部分 基金份额分级与净值计算规则.....	42
第七部分 基金的募集.....	44
第八部分 基金合同的生效.....	45
第九部分 医药 A 份额与医药 B 份额的上市交易.....	45
第十部分 国泰医药份额的申购、赎回与转换.....	46
第十一部分 场内份额配对转换.....	56
第十二部分 基金的投资.....	59
第十三部分 基金的业绩.....	68
第十四部分 基金的财产.....	68
第十五部分 基金资产估值.....	69
第十六部分 基金费用与税收.....	73
第十七部分 基金的收益与分配.....	75
第十八部分 基金份额折算.....	76
第十九部分 医药 A 份额和医药 B 份额的终止运作.....	84
第二十部分 基金的会计与审计.....	85
第二十一部分 基金的信息披露.....	86
第二十二部分 风险揭示.....	91
第二十三部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	98
第二十四部分 基金合同内容摘要.....	100
第二十五部分 托管协议内容摘要.....	114
第二十六部分 对基金份额持有人的服务.....	125
第二十七部分 其他应披露事项.....	126

---

---

第二十八部分 招募说明书存放及查阅方式.....	128
第二十九部分 备查文件.....	128

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]163 号文核准募集。本基金合同生效日为 2013 年 8 月 29 日。基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

国泰医药份额是本基金基础份额，属于证券投资基金中的高风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。医药 A 份额和医药 B 份额通过场内的国泰医药份额按照 1:1 的基金份额配比分拆而来。按照基金合同的约定，具有与国泰医药份额不同的风险收益特征。医药 A 份额的风险与预期收益较低，医药 B 份额风险较高、预期收益相对较高。由于医药 B 份额内含杠杆机制的设计，医药 B 份额净值的变动幅度将大于国泰医药份额和医药 A 份额净值的变动幅度，即医药 B 份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。医药 B 份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。医药 A 份额和医药 B 份额可通过基金合同约定的配对转换方式合并为场内的国泰医药份额，或通过基金合同约定的份额折算方式，折算为场内的国泰医药份额，从而还原为本基金基础份额的风险收益特征。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 2 月 28 日，投资组合报告为 2017 年 4 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日。

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《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》”）和其他法律法规的有关规定以及《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”）编写。基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。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。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，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：指国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指国泰基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《国泰国证医药卫生行业指数分级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《国泰国证医药卫生行业指数分级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《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金份额发

售公告》

8、上市交易公告书：指《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之医药 A 与医药 B 基金份额上市交易公告书》

9、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

10、《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，自 2004 年 6 月 1 日起实施并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《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

11、《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

12、《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

13、《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

14、《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

15、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所交易规则》及不时作出的修订；中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及不时作出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

18、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

19、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

20、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

21、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资

于中国证券市场，并取得中国国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

22、投资者：指个人投资者、机构投资者和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

23、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者

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，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

25、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代理协议，代为办理基金销售业务的机构

26、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者开放式基金账户和深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、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

27、注册登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、场外：指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

29、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

30、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统

31、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统。通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统

32、基金份额结构：本基金的基金份额包括国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的基础份额（简称“国泰医药份额”）、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“医药 A 份额”）和国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“医药 B 份额”）。其中，医药 A 份额和医药 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变



- 33、国泰医药份额：指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
- 34、医药 A 份额：指国泰医药份额按基金合同约定规则所分离的稳健收益类份额
- 35、医药 B 份额：指国泰医药份额按基金合同约定规则所分离的积极收益类份额
- 36、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额
- 37、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额
- 38、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统
- 39、深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统
- 40、交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户
- 41、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 42、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
- 43、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月
- 44、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 45、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 46、T 日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 47、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
- 48、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 49、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
- 50、标的指数：指国证医药卫生行业指数
- 51、上市交易：指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖医药 A 份额、医药 B 份额的行为

52、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份国泰医药份额的场内份额申请转换成 1 份医药 A 份额与 1 份医药 B 份额的行为

53、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份医药 A 份额与 1 份医药 B 份额进行配对申请转换成 2 份国泰医药份额的场内份额的行为

54、场内份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金场内的国泰医药份额与医药 A 份额、医药 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆与合并

55、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的公告，在本基金份额与基金管理人管理的其他基金基金份额间的转换行为

56、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，包括系统内转托管和跨系统转托管

57、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为

58、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

59、认购：指在基金募集期内，投资者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

60、申购：指基金合同生效后，投资者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

61、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

62、定期定额投资计划：指投资者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者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

63、巨额赎回：指本基金单个开放日，国泰医药份额净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额（包括国泰医药份额、医药 A 份额与医药 B 份额）的 10%

64、元：指人民币元

65、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、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

66、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息和基金应收申购款及其他资产的价值总和

67、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

68、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

69、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

70、指定媒体：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体

71、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 基金管理人

#### 一、基金管理人概况

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

成立时间：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：（021）31089000，4008888688

股本结构：

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

#### 二、基金管理人管理基金的基本情况

截至 2018 年 2 月 28 日，本基金管理人共管理 108 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国

泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(由金鼎证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(由金盛证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金(由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来,国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投

资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿信平衡混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰安心回报混合型证券投

资基金、国泰民润纯债债券型证券投资基金、国泰润享纯债债券型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金。另外，本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

### 三、主要人员情况

#### 1、董事会成员：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982年1月至1992年10月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992年11月至1998年2月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理。1998年3月至2015年10月在国泰基金管理有限公司工作，其中1998年3月至1999年10月任总经理，1999年10月至2015年8月任董事长。2015年1月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任纪委书记，2015年3月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016年8月至11月，在建投投资有限责任公司、建投传媒华文公司任监事长、纪委书记。2016年11月起任公司党委书记，2017年3月起任公司董事长、法定代表人。

方志斌，董事，硕士研究生。2005年7月至2008年7月，任职宝钢国际经营财务部。2008年7月至2010年2月，任职金茂集团财务总部。2010年3月至今，在中国建银投资有限责任公司工作，历任长期股权投资部助理业务经理、业务经理，战略发展部业务经理、处长。2014年4月至2015年11月，任建投华科投资有限责任公司董事。2014年2月至2017年11月，任中国投资咨询有限责任公司董事。2017年12月起任公司董事。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006年7月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任股权管理部业务副经理、业务经理，资本市场部业务经理，策略投资部助理投资经理，公开市场投资部助理投资经理，战略发展部业务经理、组负责人，战略发展部处长，现任战略

发展部总经理助理。2014年5月起任公司董事。

Santo Borsellino，董事，硕士研究生。1994-1995年在BANK OF ITALY负责经济研究；1995年在UNIVERSITY OF BOLOGNA任金融部助理，1995-1997年在ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP - SOFIPA SpA任金融分析师；1999-2004年在LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL任股票保险研究员；2004-2005年任URWICK CAPITAL LLP合伙人；2005-2006年在CREDIT SUISSE任副总裁；2006-2008年在EURIZONCAPITAL SGR SpA历任研究员/基金经理。2009-2013年任GENERALI INVESTMENTS EUROPE权益部总监。2013年6月起任GENERALI INVESTMENTS EUROPE总经理。2013年11月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员（FCII）及英国特许保险师（Chartered Insurer）。1989年至1994年任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994年至1996年任中国保险（欧洲）控股有限公司总裁助理；1996年至1998年任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998年至2017年任忠利亚洲中国地区总经理；2002年至今任中意人寿保险有限公司董事；2007年至今任中意财产保险有限公司董事；2007年至2017年任中意财产保险有限公司总经理；2013年至今任中意资产管理有限公司董事；2017年至今任忠利集团大中华区股东代表。2010年6月起任公司董事。

吕胜，董事，硕士。1991年7月至1994年6月，在水利水电规划设计总院任科员。1994年6月至1997年1月，在电力工业部经济调节司任副主任科员、主任科员。1997年1月至2003年1月，在国家电力公司财务与资产管理部任一级职员、副处长。2003年1月至2008年1月，在国家电网公司建设运行部任处长。2008年1月至2008年8月，在国网信息通信有限公司任总会计师、党组成员。2008年8月至2017年12月在英大泰和财产保险股份有限公司任总会计师、党组成员。2017年12月至今，在中国电力财务有限公司任总会计师、党委委员。2018年3月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，22年金融从业经历。1996年7月至2004年12月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004年12月至2011年1月在中国建银投资有限责任公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011年1月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012年11月至2016年7月7日任公司副总经理，2016年7月8日起任公司总经理及公司董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院

执教，先后任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2013年起兼任金诚信矿业管理股份有限公司（目前已上市）独立董事，2015年5月起兼任北京采安律师事务所兼职律师。2010年6月起任公司独立董事。

常瑞明，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起在工商银行工作，历任河北沧州市支行主任、副行长；河北省分行办公室副主任、信息处处长、副处长；河北保定市分行行长、党组副书记、书记；河北省分行副行长、行长、党委书记；2004年起任工商银行山西省分行行长、党委书记；2007年起任工商银行工会工作委员会常务副主任；2010年至2014年任北京银泉大厦董事长。2014年10月起任公司独立董事。

黄晓衡，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1975年7月至1991年6月，在中国建设银行江苏省分行工作，先后任职于计划处、信贷处、国际业务部，历任副处长、处长。1991年6月至1993年9月，任中国建设银行伦敦代表处首席代表。1993年9月至1994年7月，任中国建设银行纽约代表处首席代表。1994年7月至1999年3月，在中国建设银行总行工作，历任国际部副总经理、资金计划部总经理、会计部总经理。1999年3月至2010年1月，在中国国际金融有限公司工作，历任财务总监、公司管委会成员、顾问。2010年4月至2012年3月，任汉石投资管理有限公司（香港）董事总经理。2013年8月至2016年1月，任中金基金管理有限公司独立董事。2017年3月起任公司独立董事。

吴群，独立董事，博士研究生，高级会计师。1986年6月至1999年1月在中国财政研究院研究生部会计教研室工作，历任讲师、副研究员、副主任、主任。1991年起兼任中国财政研究院研究生部（财政部财政科研所研究生部）硕士生导师。1999年1月至2003年6月在沪江德勤北京分所工作，历任技术部/企业风险管理部高级经理、总监，管理咨询部总监。2003年6月至2005年11月，在中国电子产业工程有限公司工作，担任财务部总经理。2014年9月至2016年7月兼任中国上市公司协会军工委员会副会长，2016年8月起兼任中国上市公司协会军工委员会顾问。2005年11月至2016年7月在中国电子信息产业集团有限公司工作，历任审计部副主任、资产部副主任（主持工作）、主任。2012年3月至2016年7月，担任中国电子信息产业集团有限公司总经济师。2003年1月至2016年11月，在



中国电子信息产业集团有限公司所投资的境内外多个公司担任董事、监事。2017 年 5 月起兼任首约科技（北京）有限公司独立董事。2017 年 10 月起任公司独立董事。

## 2、监事会成员：

梁凤玉，监事会主席，硕士研究生，高级会计师。1994 年 8 月至 2006 年 6 月，先后于建设银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作，任业务经理、副行长、副总经理等职。2006 年 7 月至 2007 年 3 月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007 年 4 月至 2008 年 2 月在中国投资咨询公司任财务总监。2008 年 3 月至 2012 年 8 月在中国建银投资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012 年 9 月至 2014 年 8 月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014 年 12 月起任公司监事会主席。

Yezdi Phiroze Chinoy，监事，大学本科。1995 年 12 月至 2000 年 5 月在 Jardine Fleming India 任公司秘书及法务。2000 年 9 月至 2003 年 2 月，在 Dresdner Kleinwort Benson 任合规部主管、公司秘书兼法务。2003 年 3 月至 2008 年 1 月任 JP Morgan Chase India 合规部副总经理。2008 年 2 月至 2008 年 8 月任 Prudential Property Investment Management Singapore 法律及合规部主管。2008 年 8 月至 2014 年 3 月任 Allianz Global Investors Singapore Limited 东南亚及南亚合规部主管。2014 年 3 月 17 日起任 Generali Investments Asia Limited 首席执行官。2016 年 12 月 1 日起任 Generali Investments Asia Limited 执行董事。2014 年 12 月起任公司监事。

刘锡忠，监事，研究生。1989 年 2 月至 1995 年 5 月，中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1995 年 6 月至 2005 年 6 月，在华北电力集团财务有限公司工作，历任部门经理、副总经理。2005 年 7 月起在中国电力财务有限公司工作，历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任，现任风险管理部主任。2017 年 3 月起任公司监事。

邓时锋，监事，硕士研究生。曾任职于天同证券。2001 年 9 月加盟国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、社保 111 组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理，2008 年 4 月至 2018 年 3 月任国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2009 年 5 月至 2018 年 3 月兼任国泰区位优势混合型证券投资基金（原国泰区位优势股票型证券投资基金）的基金经理，2013 年 9 月至 2015 年 3 月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，2015 年 9 月至 2018 年 3 月兼任国泰央企改革股票型证券

投资基金的基金经理。2017年7月起任权益投资总监。2015年8月起任公司职工监事。

倪莹，监事，硕士研究生。1998年7月至2001年3月，任新晨信息技术有限责任公司项目经理。2001年3月加入国泰基金管理有限公司，现任信息技术部总监、运营管理部总监。2017年2月起任公司职工监事。

宋凯，监事，大学本科。2008年9月至2012年10月，任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012年12月加入国泰基金管理有限公司，现任纪检监察室副主任、审计部总监助理。2017年3月起任公司职工监事。

### 3、高级管理人员：

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

陈星德，博士，16年证券基金从业经历。曾就职于江苏省人大常委会、中国证券监督管理委员会、瑞士银行环球资产管理香港公司和国投瑞银基金管理有限公司。2009年1月至2015年11月就职于上投摩根基金管理有限公司，历任督察长、副总经理。2015年12月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

李辉，大学本科，18年金融从业经历。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司，2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司，2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司，2005年7月至2007年7月任职于AIG集团，2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司，先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人，2015年8月至2017年2月任公司总经理助理，2017年2月起担任公司副总经理。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，19年证券从业经历。1999年7月至2014年2月就职于中国证监会陕西监管局，历任稽查处副主任科员、主任科员、行政办公室副主任、稽查处二处副处长等；2014年2月至2014年12月就职于中国证监会上海专员办，任副处长；2015年1月至2015年2月就职于上海申乐实业控股集团有限公司，任副总经理；2015年2月至2016年3月就职于嘉合基金管理有限公司，2015年7月起任公司督察长；2016年3月加入国泰基金管理有限公司，2016年3月25日起任公司督察长。

### 4、本基金的基金经理

#### （1）现任基金经理

梁杏，学士，11年证券基金从业经历。2007年7月至2011年6月在华安基金管理有限

公司担任高级区域经理。2011年7月加入国泰基金管理有限公司，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016年6月起任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018年1月起兼任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年6月起任量化投资事业部副总监。

徐成城，硕士研究生，12年证券基金从业经历。曾任职于闽发证券。2011年11月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。2017年2月起任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018年1月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。

## （2）历任基金经理

本基金自基金成立以来至2014年6月23日由章贇担任本基金的基金经理，自2014年6月24日起至2015年4月6日由贾成东担任本基金的基金经理，自2015年4月7日至2016年6月7日由邱晓华担任本基金的基金经理，自2016年6月8日起至2017年2月2日由梁杏担任本基金的基金经理，自2017年2月3日起由梁杏、徐成城共同担任本基金的基金经理。

## 5、本基金投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

陈星德：副总经理

吴晨：固收投资总监、绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作）

邓时锋：权益投资总监、权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：海外投资总监、国际业务部副总监（主持工作）

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

#### 四、基金管理人职责

1、依法募集资金，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发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值与基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其它职责。

#### 五、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）法律法规或中国证监会禁止的其它行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、

法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- （7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （8）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （9）贬损同行，以抬高自己；
- （10）以不正当手段谋求业务发展；
- （11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 六、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，且不利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### 七、基金管理人内部控制制度

1、内部控制制度概述

基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险，保证经营活动的合法合规和有效开展，制定了一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施，形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面，并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。

（1）内部风险控制遵循的原则

1) 全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

2) 独立性原则：公司设立独立的稽核监察部，稽核监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；

3) 相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

4) 保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；

5) 定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

（2）内部会计控制制度

公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求，建立了完善的内部会计控制制度，实现了职责分离和岗位相互制约，确保会计核算的真实、准确、完整，并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立，保护基金资产的独立、安全。

（3）风险管理控制制度

公司为有效控制管理运营中的风险，建立了一整套完整的风险管理控制制度，其内容由一系列的具体制度构成，主要包括：岗位分离和空间分离制度、投资管理控制制度、信息技术控制、营销业务控制、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度、人力资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程，对公司面临的投资风险和管理风险进行有效的控制。

（4）监察稽核制度

公司实行独立的监察稽核制度，通过对稽核监察部充分授权，对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循情况和有效性进行全面的独立监察稽核，确保公司经营的合法合规性和内部控制的有效性。

## 2、基金管理人内部控制制度要素

### （1）控制环境

公司经过多年的管理实践，建立了良好的控制环境，以保证内部会计控制和管理控制的有效实施，主要包括科学的公司治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经营理念、独立的监察稽核职能等方面。

1) 公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事4名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

2) 在组织结构方面，公司设立的执行委员会、投资决策委员会、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

3) 公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

4) 公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

### （2）控制的性质和范围

#### 1) 内部会计控制

公司建立了完善的内部会计控制，保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。

首先，公司根据国家有关法律法规、有关会计制度和准则，制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及会计业务控制流程，做好基金业务和公司经营的核算工作，真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司财务状况。

其次，公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开，保证两者相互独立，各基金之间做到独立建账、独立核算，保证基金资产和公司资产之间、以及各基金资产之间的相互独立性。

公司建立了严格的岗位职责分离控制、凭证与记录控制、资产接触控制、独立稽核等制度，确保在基金核算和公司财务管理中做到对资源的有效控制、有关功能的相互分离和各岗位的相互监督等。

另外公司还建立了严格的财务管理制度，执行严格的预算管理和财务费用审批制度，加强成本控制和监督。

## 2) 风险管理控制

公司在经营管理中建立了有效的风险管理控制体系，主要包括：

**岗位分离和空间隔离制度：**为保证各部门的相对独立性，公司建立了明确的岗位分离制度；同时实行空间隔离制度，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密；

**投资管理业务控制：**通过建立完整的研究业务控制、投资决策控制、交易业务控制，完善投资决策委员会的投资决策职能和风险管理委员会的风险控制职能，实行投资总监和基金经理分级授权制度和股票池制度，进行集中交易，以及风险管理部对投资交易实时监控等，加强投资管理控制，做到研究、投资、交易、风险控制的相互独立、相互制约和相互配合，有效控制操作风险；建立了科学先进的投资风险量化评估和管理体系，控制投资业务中面临的市场风险、集中风险、流动性风险等；建立了科学合理的投资业绩绩效评估体系，对投资管理的风险和业绩进行及时评估和反馈；

**信息技术控制：**为保证信息技术系统的安全稳定，公司在硬件设备运行维护、软件采购维护、网络安全、数据库管理、危机处理机制等方面均制定实施了完善的制度和控制流程；

**营销业务控制：**公司制定了完善的市场营销、客户开发和客户服务制度，以保证在营销业务中对有关法律法规的遵守，以及对经营风险的有效控制；

**信息披露控制和资料保全制度：**公司制定了规范的信息披露管理办法，保证信息披露的及时、准确和完整；在资料保全方面，建立了完善的信息资料保全备份系统，以及完整的会计、统计和各种业务资料档案；

**独立的监察稽核制度：**稽核监察部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

## 3) 内部控制制度的实施

公司风险管理委员会首先从总体上制定了公司风险控制制度，对公司面临的主要风险进行辨识和评估，制定了风险控制原则。在风险管理委员会总体方针指导下，各部门根据各自业务特点，对业务活动中存在的风险点进行了揭示和梳理，有针对性地建立了详细的风险控制流程，并在实际业务中加以控制。

### （3）内部控制制度实施情况检查

公司稽核监察部在进行风险评估的基础上，对公司各业务活动中内部控制措施的实施情



况进行定期和不定期的监察稽核，重点是业务活动中风险暴露程度较高的环节，以确保公司经营合法合规、以及内部控制制度的有效遵循。

在确保现有内部控制制度实施情况的基础上，公司会根据新业务开展和市场变化情况，对内部控制制度进行及时的更新和调整，以适应公司经营活动的变化。公司稽核监察部在对内部控制制度的执行情况进行监察稽核的基础上，也会重点对内部控制制度的有效性进行评估，并提出相应改进建议。

#### （4）内部控制制度实施情况的报告

公司建立了有效的内部控制制度实施报告流程，各部门对于内部控制制度实施过程中出现的失效情况须及时向公司高级管理层和稽核监察部报告，使公司高级管理层和稽核监察部及时了解内部控制出现的问题并作出妥善处理。

稽核监察部在对内部控制实施情况的监察中，对发现的问题均立即向公司高级管理层报告，并提出相应的建议，对于重大问题，则通过督察长及时向公司董事长和中国证监会报告。同时稽核监察部定期出具独立的监察稽核报告，直接报公司董事长和中国证监会。

### 3、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺基金管理人将根据市场变化和业务发展不断完善内部控制制度，切实维护基金份额持有人的合法权益。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2016 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务

团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

### 3、基金托管业务经营情况

截止到 2017 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 397 只。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、场外销售机构

##### (1) 直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有 限公司直销柜台	地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层	
		客户服务专线：400-888-8688，021-31089000	
		传真：021-31081861	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金 电子交易平台	电子交易网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面 智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端 “国泰基金”微信交易平台	
		电话：021-31081738	联系人：李静姝

##### (2) 其他销售机构

##### ①销售银行及券商

序号	机构名称	机构信息	
1	中国工商银行股 份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）	
		办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）	
		法定代表人：易会满	电话：95588
		网址：www.icbc.com.cn	
2	中国农业银行股 份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
		办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
		法定代表人：周慕冰	客户服务电话：95599
		联系人：客户服务中心	传真：010-85109219
		网址：www.95599.cn	
3	中国银行股份 有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
		法定代表人：陈四清	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址：www.boc.cn

4	交通银行股份有 限公司	注册地址：上海市银城中路 188 号	
		法定代表人：牛锡明	客服电话：95559
		联系人：张宏革	电话：021-58781234
		网址：www.bankcomm.com	
5	招商银行股份有 限公司	注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
		法定代表人：李建红	联系人：邓炯鹏
		电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
		客户服务热线：95555	网址：www.cmbchina.com
6	上海浦东发展银 行股份有限公司	注册地址：上海市中山东一路 12 号	
		办公地址：上海市中山东一路 12 号	
		法定代表人：高国富	电话：021-61618888
		联系人：高天、虞谷云	客户服务热线：95528
7	上海农村商业银 行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号	
		法定代表人：胡平西	联系人：吴海平
		电话：021-38576977	传真：021-50105124
		客服电话：021-962999	网址：www.srcb.com
8	东莞农村商业银 行股份有限公司	注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号	
		法定代表：何沛良	联系人：林培珊、杨亢
		客服电话：0769-961122	电话：0769-22866254
		网址：www.drcbank.com	
9	国泰君安证券股 份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	
		法定代表人：杨德红	联系人：芮敏祺
		电话：021-38676161	传真：021-38670161
		客服电话：95521	网址：www.gtja.com
10	中信建投证券股 份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	
		法定代表人：王常青	联系人：许梦园
		电话：010-85156398	传真：010-65182261
		客服电话：95587 4008-888-108	网址：www.csc108.com

11	国信证券股份有 限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼	
		法定代表人：何如	联系人：周杨
		电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
		客服电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
12	招商证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层	
		法定代表人：宫少林	联系人：黄婵君
		电话：0755-82960167	传真：0755-83734343
		网址：www.newone.com.cn	
		客服电话：400-888-8111/95565	
13	中国银河证券股 份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
		法定代表人：陈有安	联系人：邓颜
		电话：010-66568292	传真：010-66568990
		客服电话：400-8888-888	
		网址：www.chinastock.com.cn	
14	海通证券股份有 限公司	注册地址：上海市广东路 689 号	
		法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
		电话：021-23219000	传真：021-63602722
		客服电话：95553	
		网址：www.htsec.com	
15	申万宏源证券有 限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
		法定代表人：李梅	联系人：黄莹
		电话：021-33388211	客服电话：95523 4008895523
		网址：www.swhysc.com	
16	万联证券有限责 任公司	注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层	
		法定代表人：张建军	联系人：甘蕾
		电话：020-38286026	传真：020-38286588
		客服电话：400-888-8133	网址：www.wlzq.com.cn
17	东吴证券股份有	注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号	

	限公司	法定代表人：范力	联系人：陆晓
		电话：0512-62938521	传真：0512-65588021
		全国客服电话：95330	网址：www.dwzq.com.cn
18	上海证券有限 责任公司	注册地址：上海市西藏中路 336 号	
		法定代表人：郁忠民	联系人：张瑾
		电话：021-53519888	传真：021-53519888
		客服电话：021-962518	网址：www.962518.com
19	国盛证券有限 责任公司	注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号	
		办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼	
		法定代表人：徐丽峰	联系人：周欣玲
		电话：0791-86281305	传真：0791-86281305
		网址：www.gsstock.com	
20	光大证券股份 有限公司	注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
		法定代表人：薛峰	联系人：刘晨、李芳芳
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：95525、10108998、400-888-8788	
		网址：www.ebscn.com	
21	中信证券股份 有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	
		法定代表人：张佑君	联系人：侯艳红
		电话：010-60838888	传真：010-60836029
		网址：www.cs.ecitic.com	
22	渤海证券股份 有限公司	注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室	
		办公地址：天津市河西区宾水道 8 号	
		法定代表人：杜庆平	联系人：王兆权
		电话：022-28451861	传真：022-28451892
		客服电话：400-651-5988	网址：www.bhzq.com
23	中信证券（山东） 有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 1507-1510 室	

		办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）	
		法定代表人：杨宝林	联系人：赵艳青
		电话：0532-85023924	传真：0532-85022605
		客服电话：95548	网址：www.citicssd.com
24	长江证券股份有 限公司	注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
		法定代表人：崔少华	联系人：奚博宇
		电话：027-65799999	传真：027-85481900
		客服电话：95579	网址：www.95579.com
25	国海证券股份有 限公司	注册地址：广西桂林市辅星路 13 号	
		法定代表人：张雅锋	联系人：牛孟宇
		电话：0755-83709350	传真：0755-83704850
		客服电话：95563	网址：www.ghzq.com.cn
26	中泰证券股份有 限公司	注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
		办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
		法定代表人：李玮	联系人：吴阳
		电话：0531-68889155	传真：0531-68889185
		客服电话：95538	网址：www.zts.com.cn
27	东莞证券有限责 任公司	注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼	
		法定代表人：游锦辉	联系人：梁健伟
		电话：0769-22119341	传真：0769-22116999
		客服电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
28	中国中投证券有 限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元	
		法定代表人：高涛	联系人：张鹏
		电话：0755-82023442	传真：0755-82026539
		网址：www.china-invs.cn	
		客服电话：400-600-8008、95532	
29	长城国瑞证券有 限公司	注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼	
		法定代表人：王勇	联系人：赵钦



		电话：0592-5161642	传真：0592-5161140
		客服电话：0592-5163588	网址：www.xmzq.cn
30	华宝证券有限 责任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层	
		法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
		电话：021-68778081	传真：021-68778117
		客服电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
31	中国国际金融股 份有限公司	注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	
		法定代表人：李剑阁	联系人：罗文雯
		电话：010-65051166	传真：010-65051156
		网址：www.cicc.com.cn	
32	天相投资顾问有 限公司	注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
		法定代表人：林义相	联系人：林爽
		电话：010-66045608	传真：010-66045527
		客服电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
33	信达证券股份有 限公司	注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
		法定代表人：高冠江	联系人：唐静
		电话：010-88656100	传真：010-88656290
		客服电话：400-800-8899	网址：www.cindasc.com
34	华龙证券有限责 任公司	注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号	
		法定代表人：李晓安	联系人：李昕田
		电话：0931-8888088	传真：0931-4890515
		客服电话：0931-4890100、4890619、4890618	
		网址：www.hlzqgs.com	
35	国元证券股份有 限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路179号	
		法定代表人：凤良志	联系人：祝丽萍
		电话：0551-2257012	传真：0551-2272100
		客服电话：95578	网址：www.gyzq.com.cn
36	平安证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层	

		法定代表人：谢永林	联系人：周一涵
		电话：021-38637436	传真：021-33830395
		客服电话：95511-8	网址：stock.pingan.com
37	中航证券有限公司	注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼	
		法定代表人：王宜四	联系人：史江蕊
		电话：010-64818301	传真：010-64818443
		客服电话：400-88-95335	网址：www.avicsec.com
38	东海证券股份有限公司	注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层	
		法定代表人：刘化军	联系人：李涛
		电话：0519-88157761	传真：0519-88157761
		客服电话：400-888-8588	网址：www.longone.com.cn
39	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层	
		法定代表人：雷杰	联系人：郭瑞军
		电话：0731-85832503	传真：0731-85832214
		客服电话：95571	网址：www.foundersec.com
40	山西证券股份有限公司	注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	
		法定代表人：侯巍	联系人：郭熠
		电话：0351-8686659	传真：0351-8686619
		客服电话：400-666-1618、95573	
		网址：www.i618.com.cn	
41	华融证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街8号	
		法定代表人：宋德清	联系人：黄恒
		电话：010-58568235	传真：010-58568062
		客服电话：010-58568118	网址：www.hrsec.com.cn
42	江海证券有限公司	注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
		法定代表人：孙名扬	联系人：张宇宏
		电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
		客服电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn

43	广州证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
		法定代表人：刘东	联系人：林洁茹
		电话：020-88836655	传真：020-88836654
		客服电话：020-961303	网址：www.gzs.com.cn
44	西南证券股份有限公司	注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号	
		法定代表人：余维佳	联系人：张煜
		电话：023-63786141	传真：023-63786212
		网址：www.swsc.com.cn	
45	国都证券股份有限公司	注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	
		法定代表人：常喆	联系人：黄静
		电话：010-84183333	传真：010-84183311-3389
		客服电话：4008188118	网址：www.guodu.com
46	华安证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座	
		法定代表人：李工	联系人：汪燕
		电话：0551-65161675	传真：0551-65161600
		客服电话：4008096518	网址：www.huaan.com
47	华鑫证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元	
		法定代表人：俞洋	联系人：王道
		电话：021-64339000	
		客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918	
		网址：www.cfsc.com.cn	
48	国金证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
		办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
		法定代表人：冉云	联系人：贾鹏
		电话：028-86690058	传真：028-86690126
		客户服务电话：4006600109	网址：www.gjq.com.cn
49	中信期货有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层	

		办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层	
		法定代表人：张皓	联系人：洪诚
		电话：0755-23953913	传真：0755-83217421
		网址：www.citicsf.com	
50	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	
		法定代表人：李季	联系人：王怀春
		电话：0991-2307105	传真：0991-2301927
		客服电话：4008000562	网址：www.hysec.com
51	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	
		办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	
		法定代表人：杨炯洋	联系人：谢国梅
		联系电话：010-52723273	传真：028-86150040
		客户服务电话：95584	网址：www.hx168.com.cn
52	江苏江南农村商业银行股份有限公司	注册地址：常州市和平中路413号	
		法定代表：陆向阳	联系人：包静
		电话：0519-89995170	传真：0519-89995170
		客服电话：(0519)96005	
		网址：www.jnbank.com.cn.	

②第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息	
1	诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	
		办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋	
		法定代表人：汪静波	联系人：李娟
		电话：021-38602377	传真：021-38509777
		客服电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
2	上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	
		办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室	

		法定代表人：杨文斌	联系人：薛年
		电话：021-20613999	传真：021-68596916
		客服电话：400-700-9665	网址：www.ehowbuy.com
3	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室	
		办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F	
		法定代表人：陈柏青	联系人：韩爱彬
		电话：0571-28829790	传真：0571-26698533
		客服电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
4	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801	
		办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801	
		法定代表人：薛峰	联系人：童彩平
		电话：0755-33227950	传真：0755-82080798
		客服电话：4006-788-887	
		网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com	
5	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	
		办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层	
		法定代表人：张跃伟	联系人：何昶
		电话：021-58788678-8201	传真：021-58787698
		客服电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
6	北京展恒基金销售有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号	
		法定代表人：闫振杰	联系人：焦琳
		电话：010-62020088-8288	传真：010-62020088-8802
		客服电话：4008886661	
		网址：www.myfund.com	
7	浙江同花顺基金销售公司	注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室	
		办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼	
		法定代表人：凌顺平	联系人：杨翼

		电话：0571-88911818-8653	传真：0571-86800423
		客服电话：4008-773-772 0571-88920897	网址：www.5ifund.com
8	上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层	
		办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座	
		法定代表人：其实	联系人：朱钰
		电话：021-54509977	传真：021-64383798
		客服电话：4001818188	网址：www.1234567.com.cn
9	众升财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室	
		办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	
		法定代表人：李招弟	联系人：李艳
		电话：010-59497361	传真：010-64788016
		客服电话：400-876-9988	网址：www.zscffund.com
10	上海利得基金销售有限公司	注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室	
		法定代表人：李兴春	联系人：叶志杰
		电话：021-50583533	传真：021-50583633
		客服电话：400-921-7755	
		网址：www.leadfund.com.cn	
11	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室	
		办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富	
		法定代表人：徐黎云	联系人：孙成岩
		电话：0571-88337888	传真：0571-56899710
		客服电话：400-068-0058	
		网址：www.jincheng-fund.com	
12	嘉实财富管理有限公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元	
		法定代表人：赵学军	联系人：张倩
		电话：021-20289890	客服电话：400-021-8850
		传真：021-20280110、010-85097308	

		网址：www.harvestwm.cn	
13	宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809	
		法定代表人：沈伟桦	联系人：王巨明
		电话：010-52858244	传真：010-85894285
		客服电话：400-6099-200	网址：www.yixinfund.com
14	一路财富（北京）信息科技有限公司	办公地址：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208	
		办公地址：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
		法定代表人：吴雪秀	联系人：徐越
		客服电话：400-001-1566	联系电话：010-88312877
		网址：www.yilucaifu.com	
15	北京增财基金销售有限公司	办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号	
		客户服务热线：400-001-8811	
		公司网站：www.zcvc.com.cn	
16	上海联泰资产管理有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室	
		办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层	
		法定代表人：燕斌	联系人：兰敏
		电话：021-52822063	传真：021-52975270
		客服电话：400-166-6788	网址：www.66zichan.com
17	上海汇付金融服务有限公司	注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层	
		办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼	
		法定代表人：金佶	联系人：陈云卉
		客服电话：400-821-3999	
		手机客户端：天天盈基金	
18	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	
		办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼	
		法定代表人：鲍东华	
		客户服务电话：400-821-9031	

		网站: www.lufunds.com	
19	泰诚财富基金销售(大连)有限公司	注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中华园 3 号	
		法定代表人: 林卓	
		电话: 0411-88891212	传真: 0411-84396536
		客服电话: 4006411999	
		网址: www.taichengcaifu.com	
20	北京钱景基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012	
		法定代表人: 赵荣春	
		电话: 010-57418829	传真: 010-57569671
		客服电话: 400-893-6885	
		网址: www.qianjing.com	
21	北京虹点基金销售有限公司	注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙楼 2 层 222 单元	
		办公地址: 北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层	
		法定代表人: 胡伟	
		客户服务电话: 400-618-0707	
		网址: www.hongdianfund.com	
22	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址: 深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704	
		公司地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层	
		客户服务电话: 400-166-1188	
		法定代表人: 张彦	联系人: 文雯
		电话: 010-83363101	
		网址: 8.jrj.com.cn	
23	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室	
		法定代表: 陈继武	联系人: 李晓明
		电话: 021-63333319	传真: 021-63333390



		客服电话：4006-433-389	
		网址：www.lingxianfund.com	
24	深圳富济财富管理 有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位	
		办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位	
		法定代表：刘鹏宇	联系人：杨涛
		电话：0755-83999907-815	传真：0755-83999926
		客服电话：0755-83999907	
		网址：www.jinqianwo.cn	
25	珠海盈米财富管 理有限公司	注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491	
		办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 单元	
		法定代表：肖雯	联系人：李孟军
		电话：18500050725	传真：021-63333390
		客服电话：020-89629099	
		网址：www.yingmi.cn	
26	北京新浪仓石基 金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	
		办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	
		法定代表：李昭琛	联系人：付文红
		电话：010-62676405	传真：010-82607151
		客服电话：010-62675369	
		网址：www.xincai.com	
27	上海万得基金销 售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座	
		法定代表：王廷富	联系人：姜吉灵
		电话：021-51327185	传真：021-50710161
		客服电话：400-821-0203	
		网址：www.520fund.com.cn	
28	南京苏宁基金销	注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号	

	售有限公司	办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号（苏宁总部）
		法定代表人：钱燕飞      联系人：喻明明
		电话：025-66996699-884131      传真：025-66008800-884131
		客服电话：95177
		网址：www.snjijin.com
29	北京汇成基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
		法定代表人：王伟刚      联系人：丁向坤
		电话：010-56282140      传真：010-62680827
		客服电话：400-619-9059
		网址：www.hcjijin.com
30	天津万家财富资产管理有限公司	办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋大厦 A 座 5 层
		法定代表人：李修辞      联系人：邵玉磊
		电话：010-59013795
		网址：www.wanjiawealth.com
31	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
		法定代表人：梁蓉      联系人：李婷婷
		电话：010-66154828      传真：010-63583991
		客服电话：400-6262-818
		网址：www.5irich.com
32	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
		办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
		法定代表人：李悦章      联系人：曹庆展
		电话：010-68983311      传真：010-65983333
		客服电话：400-066-8586
		网址：www.igesafe.com
33	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
		办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院
		法定代表人：江卉      联系人：赵德赛

		电话：010-89188343	客服电话：95118
		网址：fund.jd.com	
34	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507	
		办公地址：北京市朝阳区望京 SOHO T2 B 座 2507	
		法定代表人：钟斐斐	联系人：戚晓强
		电话：010-61840688	传真：010-61840699
		客服电话：4000618518	
		APP 下载网址：danjuanapp.com	
35	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室	
		办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室	
		法定代表人：周斌	联系人：张鼎
		电话：010-59313555	传真：010-59313586
		客服电话：4008980618	
		网址：www.chtwm.com	
36	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室	
		办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层	
		法定代表人：李一梅	联系人：仲秋玥
		电话：010-88066632	传真：010-88066552
		客服电话：400-817-5666	
		网址：www.amcfortune.com	
37	通华财富（上海）基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室	
		办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼	
		法定代表人：兰奇	联系人：庄洁茹
		电话：021-60818110	客服电话：95156 转 5
		网址：www.tonghuafund.com	

## 2、场内销售机构

本基金场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位销售。尚未取得

基金代销业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金医药 A 份额和医药 B 份额上市后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金医药 A 份额和医药 B 份额的上市交易。

## 二、登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：魏佳亮

经办注册会计师：许康玮、魏佳亮

## 第六部分 基金份额分级与净值计算规则

### 一、基金份额结构

本基金的基金份额包括国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的基础份额（简称“国泰医药份额”）、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“医药 A 份额”）和国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“医药 B 份额”）。其中，医药 A 份额和医药 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

### 二、基金运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额，将被确认为国泰医药份额。投资者场内认购所得的份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分拆为医药 A 份额和医药 B 份额。基金合同生效后，投资者认购所得的国泰医药份额场内份额的分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

2、基金合同生效后，国泰医药份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。在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，医药 A 份额和医药 B 份额可在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同。

3、医药 A 份额、医药 B 份额与国泰医药份额的资产合并投资运作。

4、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的国泰医药份额与医药 A 份额、医药 B 份额之间的场内份额配对转换业务，即：基金份额持有人可将其场内的国泰医药份额，按 1:1 的基金份额配比，申请分拆为医药 A 份额和医药 B 份额；或基金份额持有人可将其持有的医药 A 份额和医药 B 份额，按 1:1 的基金份额配比，申请合并为国泰医药份额的场内份额。场外的国泰医药份额不进行份额配对转换。场外的国泰医药份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的国泰医药份额配对转换规则进行操作。

5、基金合同生效后，本基金将按照基金合同规定，对国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额进行基金份额折算。除分级份额终止运作的份额折算（详见基金合同第二十二部分的约定）外，基金份额折算后，本基金的运作方式不变，医药 A 份额和医药 B 份额的份额配比不变。

6、无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见基金合同“第二十一部分 基金份额折算”），其所产生的国泰医药份额不进行自动分拆。投资者可选择将上述折算产生的国泰医药份额按 1:1 的比例分拆为医药 A 份额和医药 B 份额。

### 三、医药 A 份额和医药 B 份额的净值计算原则

在本基金医药 A 份额和医药 B 份额存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对医药 A 份额和医药 B 份额分别进行净值计算，医药 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金扣除掉国泰医药份额对应的净资产部分后剩余的净资产将优先确保医药 A 份额的本金及医药 A 份额的约定收益；医药 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金扣除掉国泰医药份额对应的净资产部分后剩余的净资产在优先确保医药 A 份额的本金及约定收益后，将计为医药 B 份额的净资产。

在本基金医药 A 份额和医药 B 份额存续期内，医药 A 份额和医药 B 份额基金份额净值的计算原则如下：

1、医药 A 份额约定年基准收益率为“一年期定期存款利率（税后）+4.00%”，其中，一年期银行定期存款利率以最近一次基金份额折算的折算基准日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。基金合同生效日至第一次基金份额折算基准日期间的一年期银行定期存款利率以基金合同生效日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。

医药 A 份额的约定日单利收益率为医药 A 份额的约定年基准收益率除以 365。医药 A 份额的基金份额净值，自基金合同生效日起至第 1 个基金份额折算基准日期间、或自上一个基金份额折算基准日（定期折算基准日或不定期折算基准日）后的下一个日历日起至下一个基金份额折算基准日期间，以 1.0000 元为基准，采用医药 A 份额约定日单利收益率累计计算。

基金管理人不承诺也不保证医药 A 份额的基金份额持有人获得约定基准收益或本金安全，在本基金出现极端损失的情形下，医药 A 份额的基金份额持有人的收益可能低于其约定基准收益，也可能遭受本金损失的风险。

2、本基金 1 份医药 A 份额与 1 份医药 B 份额构成一对份额组合，一对医药 A 份额与医药 B 份额的份额组合的净值之和等于 2 份国泰医药份额的净值。计算出医药 A 份额的份额净值后，根据医药 A 份额、医药 B 份额和国泰医药份额各自份额净值之间的关系，计算出医药 B 份额的基金份额净值。

3、基金份额折算（定期折算或不定期折算）后，医药 A 份额、医药 B 份额各自基金份额净值的计算方法保持不变。

4、在基金份额折算基准日（定期折算基准日和不定期折算基准日），按照上述原则计算出来的国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额的基金份额净值均为折算基准日折算前

各份额的基金份额净值。

#### 四、基金份额净值计算规则

假设：

$T$  日为计算日， $T$  日国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额的基金份额净值分别为  $NAV$ 、 $NAV(A)$ 、 $NAV(B)$ ； $R_T$  为  $T$  日医药 A 份额的约定年基准收益率； $t$  为截止  $T$  日医药 A 份额的应计收益天数，则  $t = \min\{\text{基金合同生效日（含该日）至 } T \text{ 日（含该日）的实际天数；最近一个基金份额折算基准日的次日（含该日）至 } T \text{ 日（含该日）的实际天数}\}$ 。

则：

$NAV = T$  日闭市后本基金的基金资产净值 /  $T$  日本基金基金份额的总数

$$NAV(A) = \min\left\{1.0000 + 1.0000 \times t \times \frac{R_T}{365}; 2 \times NAV\right\}$$

其中， $T$  日闭市后本基金的基金资产净值是指本基金总资产减去总负债后的价值， $T$  日本基金基金份额的总数为  $T$  日国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额的份额数之和。

$$NAV(B) = 2 \times NAV - NAV(A)$$

#### 五、医药 A 份额与医药 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，医药 A 份额和医药 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即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 份额各自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）通过方为有效。

## 第七部分 基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可【2013】163 号文（《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》）核准，自 2013 年 8 月 5 日至 2013 年 8 月 23 日通过深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌发售，同时通过基金管理人指定的场外销售机构（包括基金管理人的直销柜台及代销机构的代销网点）公开发售。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为 500,590,629.33 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 69,522.81 元人民币，上述资金已于 2013 年 8 月 29 日全

额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金托管专户。

## 二、基金类型和存续期限

- 1、基金类型：股票型基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金的存续期间：不定期

## 第八部分 基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2013 年 8 月 29 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 第九部分 医药 A 份额与医药 B 份额的上市交易

### 一、医药 A 份额与医药 B 份额的上市交易

医药 A 份额与医药 B 份额于 2013 年 9 月 11 日开始在深圳证券交易所上市交易，医药 A 交易代码：150130；医药 B 交易代码：150131。

#### 1、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

医药 A 份额与医药 B 份额上市后，登记在证券登记结算系统中的医药 A 份额与医药 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的国泰医药份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并分拆成医药 A 份额与医药 B 份额后，方可上市交易。

#### 2、上市交易的时间

医药 A 份额与医药 B 份额于 2013 年 9 月 11 日开始在深圳证券交易所上市交易。

详细内容请参阅刊登于 2013 年 9 月 6 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之医药 A 与医药 B 基金份额上市交易公告书》。

#### 3、上市交易的规则

(1) 上市首日，医药 A 份额与医药 B 份额的开盘参考价为前一交易日医药 A 份额与医药 B 份额的基金份额净值；

(2) 医药 A 份额与医药 B 份额上市交易遵循深圳证券交易所相关业务规则及规定。



#### 4、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

#### 5、上市交易的行情揭示

医药 A 份额和医药 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值。

#### 6、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金医药 A 份额与医药 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

7、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 国泰医药份额的申购、赎回与转换

### 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。投资者可以使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销机构及场外代销机构的营业网点办理国泰医药份额的场外申购和赎回业务。基金投资者也可使用深圳证券账户，通过场内代销机构利用深圳证券交易所交易系统办理国泰医药份额的场内申购和赎回业务。具体的销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告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。基金投资者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。

办理国泰医药份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理国泰医药份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对医药 A 份额或医药 B 份额单独开放场内申购、赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在基金份额发售公告或其他公告中列明。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

国泰医药份额于 2013 年 9 月 11 日开放日常申购业务，于 2013 年 9 月 11 日开放日常赎回业务。详细内容请参阅刊登于 2013 年 9 月 6 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时

报》上的《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告》。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券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体上公告。

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国泰医药份额的申购、赎回或者转换。投资者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，其国泰医药份额申购、赎回价格为下一开放日国泰医药份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的国泰医药份额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，即申购国泰医药份额以金额申请，赎回国泰医药份额以份额申请；

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，即对该基金份额持有人在销售机构托管的国泰医药份额进行处理时，注册登记确认日期在先的国泰医药份额先赎回，注册登记确认日期在后的国泰医药份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

5、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理国泰医药份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

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体上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资者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对国泰医药份额的申购或赎回申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购国泰医药份额时，必须全额交付申购款项，若资金在规定时间内未全额到账

则申购不成功，申购款项将退回投资者账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在受理基金投资者有效赎回申请之日起7个工作日内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，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，投资者应在T+2日后（包括该日）到销售网点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者。基金销售机构对申购、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或基金管理人的确认结果为准。

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申购金额的限制

本基金场内单笔申购的最低金额为50,000.00元（含申购费），场外单笔申购的最低金额为10.00元（含申购费）。其他销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。

### 2、赎回份额的限制

基金份额持有人可将其全部或部分国泰医药份额赎回。场内单笔赎回申请最低份数为1,000.00份，场外单笔赎回申请最低份数为1.00份。若某基金份额持有人在场内销售网点保留的国泰医药份额不足1,000.00份，场外销售网点保留的国泰医药份额不足1.00份，则赎回时必须一起赎回。

3、本基金不对投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制，但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

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、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。

6、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体上公告。

## 六、申购和赎回的费用

### 1、申购费用

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 50 万	1.0%
50 万 ≤ M < 100 万	0.6%
M ≥ 100 万	每笔 1,000 元

### 2、赎回费用

赎回费用由赎回国泰国证医药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，其余用于支付注册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。

本基金的赎回费率随基金份额持有期限的增加而递减：

	申请份额持有时间（N）	赎回费率
	场外赎回费	N < 7 日
	7 日 ≤ N < 1 年	0.5%
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
	N ≥ 2 年	0
场内赎回费	N < 7 日	1.50%
	N ≥ 7 日	0.5%

3、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体上公告。

4、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，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资者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申购费率和基金赎回费率。

5、办理国泰国证医药份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证

券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

#### 七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日国泰医药份额的基金份额净值为基准计算。

##### （1）申购国泰医药份额的计算

①申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日国泰医药份额基金份额净值}$$

②申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日国泰医药份额基金份额净值}$$

场外申购的国泰医药份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金资产承担。场内申购的国泰医药份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某投资者投资 50,000 元申购本基金，对应费率为 1.0%，假设申购当日国泰医药份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.0\%) = 49,504.95 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,504.95 = 495.05 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 49,504.95 / 1.128 = 43,887.37 \text{ 份}$$

若投资者是场外申购，则所得国泰医药份额为 43,887.37 份。若投资者是场内申购，则所得份额为 43,887 份，整数位后小数部分的申购份额（0.37 份）对应的资金返还给投资者。

具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 43,887 \times 1.128 = 49,504.54 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 50,000 - 49,504.54 - 495.05 = 0.41 \text{ 元}$$

即投资者投资 50,000 元从场内申购本基金，则可得到 43,887 份国泰医药份额，同时应得退款 0.41 元。

2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日国泰医药份额基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金资产承担，产生的收益归基金资产所有。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回国泰医药份额份数×T 日国泰医药份额基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例：某投资者持有本基金 50,000 份场外国泰医药份额，持有 0.5 年时决定赎回，假设赎回当日国泰医药份额净值 1.2500 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=50,000×1.2500=62,500.00 元

赎回费用=62,500.00×0.5%=312.50 元

净赎回金额=62,500.00-312.50=62,187.50 元

若该投资者持有的是场内国泰医药份额，则赎回费率为固定值 0.5%，其获得的赎回金额如下：

赎回金额=50,000×1.2500=62,500.00 元

赎回费用=62,500.00×0.5%=312.50 元

净赎回金额=62,500.00-312.50=62,187.50 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。

国泰医药份额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资产承担。T 日的国泰医药份额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。

#### 八、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者的申购申请：

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者的申购申请。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、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形；

6、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；

7、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、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停接受投资者申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。发生上述第 6 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。

#### 九、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投资者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投资者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、证券交易所交易时间非正常停市，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、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停接受投资者的赎回申请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。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、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国泰医药份额净赎回申请（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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 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投资者的全部赎回申请时，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投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额）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，投资者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国泰医药份额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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 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。

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和注册登记机构的有关业务规则办理。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含 2 个开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受国泰医药份额的赎回申请；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，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者基金管理人网站在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

## 十一、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，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

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

3、如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的国泰医药份额的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周（包括两周），暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的国泰医药份额的基金份额净值。

## 十二、基金转换

基金管理人可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。

## 十三、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、符合法律法规的其它非交易过户。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者。

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。

#### 十四、基金的注册登记、系统内转托管和跨系统转托管

##### 1、基金份额的注册登记

（1）本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的国泰医药份额，登记在注册登记系统中基金份额持有人的开放式基金账户下；场内认购、申购的国泰医药份额，或上市交易的医药 A 份额和医药 B 份额，登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的国泰医药份额，可以直接申请场内赎回，不在深圳证券交易所上市交易，但经基金份额持有人申请，按 1：1 的份额配比分拆为医药 A 份额和医药 B 份额后，在深圳证券交易所上市。

（3）登记在证券登记结算系统中的医药 A 份额和医药 B 份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 1：1 的份额配比申请合并为国泰医药份额的场内份额后，再申请场内赎回。

（4）登记在注册登记系统中的国泰医药份额，既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后，转至证券登记结算系统，由基金份额持有人申请，按 1：1 的份额配比分拆为医药 A 份额和医药 B 份额，在深圳证券交易所上市。

##### 2、系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的国泰医药份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理国泰医药份额赎回业务的销售机构（网点）时，需办理已持有国泰医药份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理国泰医药份额场内赎回的会员单位（交易单元）、或变更办理医药 A 份额和医药 B 份额上市交易的会员单位（交易单元）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

### 3、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的国泰医药份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

（2）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者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。

### 十六、基金的冻结和解冻

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。

## 第十一部分 场内份额配对转换

根据基金合同约定，本基金自 2013 年 9 月 11 日起，开通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”）的场内份额配对转换业务。

### 一、场内份额配对转换

指根据基金合同约定，场内的国泰医药份额（场内简称：国泰医药，基金代码：160219）与医药 A 份额（场内简称：医药 A，基金代码：150130）及医药 B 份额（场内简称：医药 B，基金代码：150131）之间进行转换的行为，包括分拆与合并。

1、分拆：指根据基金合同约定，场内的国泰医药份额按照 1：1 的基金份额配比分拆成医药 A 份额和医药 B 份额的行为。

2、合并：指根据基金合同约定，医药 A 份额和医药 B 份额按照 1：1 的基金份额配比合并成国泰医药份额场内份额的行为。

3、场外的国泰医药份额不进行份额配对转换。场外的国泰医药份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

## 二、业务办理机构

投资人可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务。中国证券登记结算有限责任公司将对具备基金分拆转换及合并转换业务资格的证券公司名单进行更新，投资者可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站（[www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn)）查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

## 三、业务办理时间

深圳证券交易所交易日上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00（基金管理人公告暂停份额配对转换业务时除外）。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告。

## 四、场内份额配对转换的原则

1、投资人以中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司普通股票账户或证券投资基金账户（以下简称“深圳证券账户”）申报份额配对转换业务中的“分拆”或“合并”指令，申报前需备足对价，即投资人提出“分拆”申请时，其所申报的深圳证券账户上须有足够的、可交易的国泰医药份额；投资人提出“合并”申请时，其所申报的深圳证券账户上须有足够的、可交易的医药 A 份额与医药 B 份额。

2、投资人通过业务办理机构提出份额配对转换申请的，统一以国泰医药份额（场内简称“国泰医药”）的交易代码“160219”作为申请指令的证券代码，以份额为单位进行“分拆”或“合并”申报。

3、“分拆”或“合并”每笔申请的份额数不得低于 2 份，且必须是 2 份的整数倍。基金管理人可根据市场情况调整“分拆”或“合并”每笔申报的最低份额数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照有关规定进行公告。

4、如果申请场内份额的合并，医药 A 份额与医药 B 份额必须同时配对申请，且医药 A 份额与医药 B 份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍、份额数配比为 1:1。

5、办理份额配对转换业务的深圳证券交易所会员单位应对投资人每笔“分拆”或“合并”申请的可用份额数量进行检查并对相应基金份额进行预冻结。

6、在交易时间内，份额配对转换业务办理机构通过深证通 FDEP 消息传输系统将份额

配对转换申报指令发送给中国证券登记结算有限责任公司的基金业务系统。正常情况下，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司在 T 日收市后对投资人 T 日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认，并进行份额变更处理，办理转出基金份额的扣除以及转入基金份额的登记。自 T+1 日起（包括该日）投资人可查询基金份额配对转换的成交情况。

7、投资人 T 日提出的 M 份份额“分拆”申请被确认成功后，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司将在投资人所申报的深圳证券账户上扣减 M 份国泰医药份额，同时增加 M/2 份医药 A 份额与 M/2 份医药 B 份额。正常情况下，自 T+1 日（含该日）起新增的医药 A 与医药 B 份额可进行交易。

8、投资人 T 日提出的 N 份份额“合并”申请被确认成功后，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司将在投资人所申报的深圳证券账户上扣减 N/2 份医药 A 份额和 N/2 份医药 B 份额，同时增加 N 份国泰医药份额。正常情况下，自 T+1 日（含该日）起新增的国泰医药份额可进行赎回等交易。

9、国泰医药份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为国泰医药份额的场内份额后方可进行。

10、投资人提出的份额配对转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

11、份额配对转换应遵循届时发布的相关业务规则。

## 五、业务办理程序

场内份额配对转换程序，遵循深圳证券交易所、注册登记机构的最新业务规则，具体见相关业务公告。

## 六、暂停场内份额配对转换的情形

- 1、深圳证券交易所、注册登记机构、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形；
- 2、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形可决定是否暂停接受配对转换；
- 3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况之一的，基金管理人应在指定媒体就暂停场内份额配对转换业务予以公告。

当恢复场内份额配对转换业务时，基金管理人也将在指定媒体予以公告。

## 七、业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。

## 八、重要提示

基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述“场内份额配对转换的原则”作出调整，并在正式实施前在至少一家指定媒体公告。

# 第十二部分 基金的投资

## 一、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。

## 二、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，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、债券回购、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%，其中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），权证投资不高于基金资产净值的 3%。

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。

## 三、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，基金管理人将在拟替代成份股内选取替代成份股进行替代投资，并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，基金管理人应结合对股指期货的投资等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

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

## 3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、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。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%；

（2）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）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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；

（11）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；

（12）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%；

（13）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

1) 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）、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) 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%；

4) 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) 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%；

6) 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或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。

（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）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

除上述第（2）、（10）、（14）、（15）项和第（13）项第6）目另有约定外，因证券市场波动、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。

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。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。

## 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）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，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；
- （7）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；
- （8）依照法律法规有关规定，由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。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：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%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，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跟踪标的，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者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基

金名称。若变更标的指数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单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

#### 六、风险收益特征

本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。

运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额。其中国泰医药份额为普通的股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；医药 A 份额的风险与预期收益较低；医药 B 份额采用了杠杆式的结构，风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

#### 七、基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

#### 八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2017 年 12 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,073,115,076.66	92.21
	其中：股票	3,073,115,076.66	92.21
2	固定收益投资	2,181.80	0.00
	其中：债券	2,181.80	0.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	254,008,438.13	7.62
7	其他各项资产	5,760,911.77	0.17
8	合计	3,332,886,608.36	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,122,792.20	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,545,261.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,768,574.91	0.33

(2) 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,596,633,628.25	78.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	297,178,851.37	8.98
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	168,534,022.13	5.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,062,346,501.75	92.49

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	4,937,418	340,583,093.64	10.29
2	600518	康美药业	9,088,736	203,224,136.96	6.14
3	600196	复星医药	2,995,977	133,320,976.50	4.03
4	000538	云南白药	1,237,095	125,923,900.05	3.80
5	002252	上海莱士	4,338,759	86,124,366.15	2.60
6	000423	东阿阿胶	1,414,154	85,231,061.58	2.57
7	600867	通化东宝	3,286,761	75,233,959.29	2.27
8	000963	华东医药	1,386,500	74,704,620.00	2.26
9	002044	美年健康	3,413,639	74,656,284.93	2.25
10	000661	长春高新	406,977	74,476,791.00	2.25

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300357	我武生物	38,700	1,904,427.00	0.06
2	300482	万孚生物	25,900	1,902,096.00	0.06
3	002675	东诚药业	141,600	1,669,464.00	0.05
4	002332	仙琚制药	194,100	1,585,797.00	0.05
5	000597	东北制药	115,400	1,357,104.00	0.04

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,181.80	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,181.80	0.00

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113014	林洋转债	10	1,181.80	0.00
2	123004	铁汉转债	10	1,000.00	0.00

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“美年健康”公告子公司违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据2017年4月28日美年健康发布的相关公告，子公司“美年大健康”及其关联方收购慈铭体检股份，未在实施前向商务部申报，违反了《反垄断法》相关规定，受到商务部罚款30万元。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

（2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,055,862.05
2	应收证券清算款	4,008,180.81
3	应收股利	-
4	应收利息	38,995.70
5	应收申购款	657,873.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,760,911.77

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

（5）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 第十三部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2017年12月31日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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
2013年8月29日至 2013年12月31日	2.62%	1.11%	1.16%	1.16%	1.46%	-0.05%
2014年度	3.84%	1.03%	5.29%	1.05%	-1.45%	-0.02%
2015年度	43.93%	2.75%	50.85%	2.55%	-6.92%	0.20%
2016年度	-13.55%	1.57%	-12.09%	1.55%	-1.46%	0.02%
2017年度	12.50%	0.73%	14.83%	0.75%	-2.33%	-0.02%
2013年8月29日至 2017年12月31日	49.17%	1.66%	62.20%	1.59%	-13.03%	0.07%

注：2013年8月29日为基金合同生效日

### 第十四部分 基金的财产

#### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

## 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

## 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

## 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

# 第十五部分 基金资产估值

## 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

## 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、其它投资等资产及负债。

## 三、估值方法

### 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、权证等），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，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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最



近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（4）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。交易所上市的资产支持证券，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。

## 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、债券和权证，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）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、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。

## 5、股票指数期货合约估值方法：

（1）股票指数期货合约以结算价格进行估值；

（2）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

（3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

6、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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额的基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、

系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正；

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方；

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益决定延迟估值时；

4、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一致的，基金管理人应当暂停估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### 八、特殊情形的处理

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十六部分 基金费用与税收

### 一、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、标的指数使用许可费；

4、基金上市费及年费；

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、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、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。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、标的指数使用许可费

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使用费。通常情况下，指数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。计算方法如下：

$$H= E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

基金管理人可根据指数使用许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十七部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

本基金（包括国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额）不进行收益分配。

在本基金国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额的运作期间内，如果法律法规或监管部门取消上述限制，则基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，在履行适当程序后，可以对上述收益分配原则进行修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止医药 A 份额、医

药 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 第十八部分 基金份额折算

除分级份额终止运作的份额折算（详见基金合同第二十二部分的约定）外，基金份额折算后，本基金的运作方式不变，医药 A 份额和医药 B 份额的份额配比不变。

### 一、定期份额折算

在医药 A 份额和医药 B 份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日。但基金合同生效日至第 1 个定期份额折算基准日不足 6 个月的，则该年度可不进行定期折算；定期份额折算基准日前 3 个月内发生过不定期折算的，则该年度可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算的，基金管理人应至少提前 2 个工作日在指定媒体上公告不进行定期折算的提示性公告。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的医药 A 份额和国泰医药份额。

#### 3、基金份额折算频率

每个会计年度进行 1 次（可不进行定期折算的除外）。

#### 4、基金份额折算方式

（1）每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将在该日对医药 A 份额进行应得收益的定期份额折算，国泰医药份额的基金份额净值也相应的进行调整。在基金份额折算前与折算后，医药 A 份额和医药 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。

（2）折算前的医药 A 份额持有人，以医药 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变医药 A 份额持有人的资产净值，其持有的医药 A 份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰医药份额。

（3）折算前的国泰医药份额的基金份额持有人，以每 2 份国泰医药份额，按 1 份医药 A 份额的份额分配，获得新增国泰医药份额。持有场外国泰医药份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国泰医药份额的分配；持有场内国泰医药份额的基金份额持有人

将按前述折算方式获得新增场内国泰医药份额的分配。折算不改变国泰医药份额持有人的资产净值。

（4）折算不改变医药 B 份额持有人的资产净值，其持有的医药 B 份额的基金份额净值及份额数量不变。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

#### 5、基金份额折算公式

（1）医药 A 份额持有人

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(A)^{\text{前}}$$

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000}{2}$$

医药 A 份额持有人持有的新增场内国泰医药份额的份额数为：

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 A 份额的份额数；

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 A 份额的份额数；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 A 份额的基金份额净值；

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 A 份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后国泰医药份额的基金份额净值。

医药 A 份额新增份额折算成国泰医药份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

（2）医药 B 份额持有人



每个会计年度的定期份额折算不改变医药 B 份额的基金份额净值及其份额数。

(3) 国泰医药份额持有人

$$NAV_{后} = NAV_{前} - \frac{NAV(A)_{前} - 1.0000}{2}$$

折算后国泰医药份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

$$\frac{(NAV_{前} - NAV_{后}) \times NUM_{前}}{NAV_{后}}$$

其中：

$NAV_{前}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值；

$NAV_{后}$ ：份额折算基准日折算后国泰医药份额的基金份额净值；

$NUM_{前}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的份额数；

国泰医药份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；国泰医药份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值、医药 A 份额的基金份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 6、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额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 份额和医药 B 份额的上市交易和国泰医药份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 7、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告折算结果，并报中国证监会备案。

## 二、不定期折算

除以上基金份额定期折算外，本基金还将在国泰医药份额的份额净值大于或等于 1.5000 时以及医药 B 份额的份额净值小于或等于 0.2500 时进行不定期折算。

### 1、国泰医药份额的份额净值大于或等于 1.5000 元时

（1）基金份额折算基准日

如果某个工作日国泰医药份额的份额净值大于或等于 1.5000 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

（2）基金份额不定期折算对象

基金份额折算基准日登记在册的医药 A 份额、医药 B 份额、国泰医药份额。

（3）基金份额不定期折算频率

不定期。

（4）基金份额不定期折算方式

①折算前的国泰医药份额持有人，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变国泰医药份额持有人的资产净值，其持有的国泰医药份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元，份额数量相应折算增加；

②折算前的医药 A 份额持有人，以医药 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变医药 A 份额持有人的资产净值，其持有的医药 A 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰医药份额；

③折算前的医药 B 份额持有人，以医药 B 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变医药 B 份额持有人的资产净值，其持有的医药 B 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰医药份额。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

（5）基金份额折算公式

①医药 A 份额持有人

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(A)^{\text{前}}$$

折算后医药 A 份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

$$\left( NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000 \right) \times NUM(A)^{\text{前}}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 A 份额的份额数

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 A 份额的份额数

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 A 份额的基金份额净值

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 A 份额的基金份额净值

医药 A 份额新增份额折算成国泰医药份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

②医药 B 份额持有人

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(B)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{前}}$$

折算后医药 B 份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

$$\left( NAV(B)^{\text{前}} - 1.0000 \right) \times NUM(B)^{\text{前}}$$

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 B 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 B 份额的份额数

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 B 份额的基金份额净值

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 B 份额的基金份额净值

医药 B 份额新增份额折算成国泰医药份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

③国泰医药份额持有人

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰医药份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

$$\left( NAV^{\text{前}} - 1.0000 \right) \times NUM^{\text{前}}$$

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后国泰医药份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的份额数

国泰医药份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；国泰医药份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值、医药 A 份额的基金份额净值、医药 B 份额的基金份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额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 份额和医药 B 份额的上市交易和国泰医药份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （7）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告折算结果，并报中国证监会备案。

### 2、医药 B 份额的份额净值小于或等于 0.2500 元时

#### （1）基金份额折算基准日

如果某个工作日医药 B 份额的份额净值小于或等于 0.2500 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

#### （2）基金份额不定期折算对象

基金份额折算基准日登记在册的医药 A 份额、医药 B 份额、国泰医药份额。

#### （3）基金份额不定期折算频率

不定期。

#### （4）基金份额不定期折算方式

①折算不改变国泰医药份额持有人的资产净值，其持有的国泰医药份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整；

②折算不改变医药 A 份额持有人的资产净值，其持有的医药 A 份额净值折算调整为

1.0000 元、份额数量折算调整，相应折算增加国泰医药份额；

③折算不改变医药 B 份额持有人的资产净值，其持有的国泰医药 B 份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整；

④医药 A 份额与医药 B 份额的基金份额配比保持 1：1 的比例不变。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

（5）基金份额折算公式

①医药 B 份额持有人

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(B)^{\text{后}} = \frac{NUM(B)^{\text{前}} \times NAV(B)^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 B 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 B 份额的份额数

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 B 份额的基金份额净值

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 B 份额的基金份额净值

不定期折算后医药 B 份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

②医药 A 份额持有人

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{后}}$$

折算后医药 A 份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times NAV(A)^{\text{前}} - NUM(A)^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 A 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 B 份额的份额数

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前医药 A 份额的基金份额净值

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后医药 A 份额的基金份额净值

不定期折算后医药 A 份额的份额数及不定期折算后医药 A 份额新增的国泰医药份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

③国泰医药份额持有人

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰医药份额持有人持有的国泰医药份额的份额数为：

$$\frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后国泰医药份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰医药份额的份额数

国泰医药份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；国泰医药份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前国泰医药份额的基金份额净值、医药 A 份额的基金份额净值、医药 B 份额的基金份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额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 份额和医药 B 份额的上市交易和国泰医药份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（7）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告折算结果，并报中国证监会备案。

三、特殊情况的处理

若在某一个会计年度的定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

## 第十九部分 医药 A 份额和医药 B 份额的终止运作

一、经基金份额持有人大会决议通过，医药 A 份额和医药 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即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 份额各自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）通过方为有效。

二、医药 A 份额和医药 B 份额终止运作后的份额折算

医药 A 份额和医药 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，医药 A 份额和医药 B 份额将全部折算成场内国泰医药份额。

1、份额折算基准日

份额折算基准日为分级份额终止运作日，即医药 A 份额和医药 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

2、份额折算方式

分级份额终止运作日，医药 A 份额和医药 B 份额按届时各自份额净值与国泰医药份额净值之比折算为国泰医药份额。

3、份额折算计算公式：

$$\text{医药 A 份额折算的国泰医药份额份额数} = \frac{NUM(A) \times NAV(A)}{NAV}$$

$$\text{医药 B 份额折算的国泰医药份额份额数} = \frac{NUM(B) \times NAV(B)}{NAV}$$

其中：

$NUM(A)$ 、 $NUM(B)$  分别指折算前医药 A 份额和医药 B 份额的份额数，即分级份额

终止运作日闭市后医药 A 份额和医药 B 份额的份额数；

$NAV(A)$ 、 $NAV(B)$ 、 $NAV$ ：分别指折算前医药 A 份额、医药 B 份额和国泰医药份额的基金份额净值，即分级份额终止运作日闭市后医药 A 份额、医药 B 份额和国泰医药份额的基金份额净值。

#### 4、份额折算后的基金运作

医药 A 份额和医药 B 份额全部折算为场内国泰医药份额后，本基金转型为国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（LOF），接受场外与场内申购和赎回。

#### 5、份额折算的公告

基金管理人应不迟于医药 A 份额和医药 B 份额终止运作日前 2 日，就分级份额终止运作及份额折算事宜，在指定媒体公告。医药 A 份额和医药 B 份额进行份额折算结束后，基金管理人应在 2 个工作日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

## 第二十部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计；

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事



务所需在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 第二十一部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### （五）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理国泰医药份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额各自的基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额各自的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日

的次日，将基金资产净值、国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

（六）国泰医药份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明国泰医药份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额）20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

（八）基金份额定期折算和不定期折算的公告

在定期折算基准日前 10 个工作日（基金合同生效后不满 10 个工作日的情形除外），遵循深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将就暂停国泰医药份额申购赎回、暂停医药 A 份额和医药 B 份额上市交易等相关业务，暂停基金份额配对转换申请及基金份额定期折算等有关事项，进行提示性公告。

（九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金注册登记机构；

- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、国泰医药份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、国泰医药份额发生巨额赎回并延期支付；
- 24、国泰医药份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、国泰医药份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金接受或暂停接受场内份额配对转换；
- 27、本基金暂停接受场内份额配对转换后恢复办理场内份额配对转换；
- 28、本基金实施基金份额折算；
- 29、医药 A 份额和医药 B 份额终止运作；
- 30、医药 A 份额和医药 B 份额终止运作后医药 A 份额和医药 B 份额的份额折算；
- 31、医药 A 份额和医药 B 份额上市交易；
- 32、发生涉及国泰医药份额申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 33、中国证监会规定的其他事项。

#### （十）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （十一）基金份额持有人大会决议

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核准或者备案，并予以公告。

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文

件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 第二十二部分 风险揭示

### 一、系统性风险：

市场风险是指由于经济、政治、环境等因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括利率风险、政策风险、经济周期风险、通货膨胀风险。

1、利率风险：对于股票投资而言，利率的变化将导致证券市场资金供求状况、上市公司的融资成本和利润水平等发生变化，同时改变市场参与者对于后市利率变化方向及幅度的预期，这将直接影响证券价格发生变化，进而影响本基金的收益水平。对于债券投资而言，利率的变化不仅会影响债券的价格及投资者对于后市的预期，而且会带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

2、政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策，进出口贸易政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

3、经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况。证券市场对于宏观经济运行状况的直接反应将影响本基金的收益水平。

4、购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资者实际收益水平下降的风险。

### 二、非系统性风险：

非系统性风险是指个别行业或个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险

等。

1、经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

2、信用风险：指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券的发行人出现违约、无法支付到期本息，或者由于债券发行人信用等级下降等原因造成的基金资产损失的风险。

### 三、流动性风险

#### （一）本基金基金份额的上市交易、申购、赎回安排

本基金为股票型指数基金，运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额。

医药 A 份额与医药 B 份额上市后，登记在证券登记结算系统中的医药 A 份额与医药 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的国泰医药份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并分拆成医药 A 份额与医药 B 份额后，方可上市交易。投资人可在本基金的开放日办理国泰医药份额的场外申购和赎回业务。

为切实保护存量基金份额持有人的合法权益，遵循基金份额持有人利益优先原则，本基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

1、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。

2、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、赎回申请或延缓支付赎回款项。

提示投资人注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险，合理安排投资计划。

#### （二）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险

1、本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，其余资产投资于债券等具有良好流动性的金融工具。因此，股票市场/债券市场的流动性风险是本基金主要面临的流动性风险。本基金所投资的股票市场/债券市场具有发展成熟、容量较大、交易活跃、流动性充裕的特征，能够满足本基金开放式运作的流动性要求。同时，本基金采用分散投资，针对个股/个券设

置投资比例上限，保障了资产组合的流动性。在极端市场行情下，存在基金管理人可能无法以合理价格及时变现或调整基金投资组合的风险。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制流动性风险。

2、股指期货合约存在无法及时变现带来的流动性风险。

3、资产支持证券只能通过特定的渠道进行转让交易，存在市场交易不活跃导致的流动性风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

### （三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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投资者的全部赎回申请时，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投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额）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，投资者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国泰医药份额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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 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（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 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。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含 2 个开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受国泰医药份额的赎回申请；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，并应当在指定媒体上进行公告。

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和注册登记机构的有关业务规则办理。

#### （四）备用的流动性风险管理工具的实施情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。备用的流动性风险管理工具的实施情形包括：

- 1、发生基金合同规定的暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；
- 2、基金发生巨额赎回；
- 3、基金份额持续持有期限小于 7 日；
- 4、发生基金合同规定的暂停估值的情形；
- 5、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，切实保护持有人的合法权益。

采取备用流动性风险管理工具，可能对投资者造成无法赎回、赎回延期办理、赎回款项延期支付、赎回时承担冲击成本产生资金损失等影响。

#### 四、运作风险

1、管理风险：指在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险，或者由于公司内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

2、交易风险：指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

3、运作风险：由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等突发情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

4、道德风险：指业务人员道德行为违规产生的风险，包括由内幕交易、违规操作、欺诈行为等原因造成的风险。

#### 五、特定风险

##### 1、医药 A 份额的本金与约定年基准收益风险

基金管理人不承诺也不保证医药 A 份额的基金份额持有人获得约定基准收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，医药 A 份额的基金份额持有人的收益可能低于其约定基准收益，也可能遭受本金损失的风险。

##### 2、指数化投资风险

###### （1）标的指数的系统性风险

标的指数成份股的价格可能由于政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动。当国证医药卫生行业指数下跌时，本基金面临基金净值与国证医药卫生行业指数同步下跌的风险。

###### （2）投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

###### （3）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数为行业指数，并不代表整个股票市场，标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率存在偏离。

###### （4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中存在流动性风险、交易成本和国证医药卫生行业指数成份股调整等情况导致基金投资组合回报与标的指数回报存在跟踪偏离风险，主要影响因素可能包括：

①基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场冲击成本、管理费和托管费等；

②当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

③投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

④在指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力，如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度；本基金将进行被动型的股票投资并通过多项风险控制方式降低跟踪风险。

#### （5）标的指数变更风险

根据《基金合同》的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的风险收益特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

### 3、特有的运作风险

#### （1）上市交易风险

本基金在基金合同生效后，医药 A 份额和医药 B 份额在深圳证券交易所上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖医药 A 份额和医药 B 份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致医药 A 份额与医药 B 份额产生流动性风险。

#### （2）杠杆机制风险

本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，医药 A 份额具有风险较低、收益相对稳定的特征；医药 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于医药 B 份额内含杠杆机制的设计，其份额净值的变动幅度将大于国泰医药份额和医药 A 份额净值的变动幅度，即医药 B 份额净值变动的波动性要高于其他两类基金份额。并且，随着国泰医药份额的基金份额净值的变化，医药 B 份额的实际杠杆大小也在发生变化，从而影响着医药 B 份额净值变动的波动性。

#### （3）折/溢价交易风险

医药 A 份额与医药 B 份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将医药 A 份额和医药 B 份额的折/溢价风险降至较低水平，但医药 A 份额和医药 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。

#### （4）基金份额风险收益特征变化风险

根据本基金的份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算，在实施基金份额折算后，医药 A 份额持有人或医药 B 份额持有人将会获得一定比例的场内国泰医药份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

在每个会计年度的定期折算日，本基金将对医药 A 份额和国泰医药份额进行定期份额折算，将医药 A 份额的基金份额净值大于 1.0000 元的部分折算成场内国泰医药份额分配给医药 A 份额持有人，因此，原医药 A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

在国泰医药份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元、及医药 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算。原医药 A 份额和医药 B 份额持有人将会获得一定比例的国泰医药份额，因此原医药 A 份额、医药 B 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

当医药 A 份额和医药 B 份额终止运作后，医药 A 份额和医药 B 份额将全部转换成国泰医药份额的场内份额，因此基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

#### （5）份额折算风险

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

场内购买的医药 A 份额或医药 B 份额的投资者由于份额折算而新增持有的国泰医药份额可能面临无法赎回的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金代销资格的证券公司购买医药 A 份额或医药 B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的国泰医药份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意，投资者可以选择在份额折算前将医药 A 份额或医药 B 份额卖出，或者将新增的国泰医药份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

#### （6）份额配对转换业务中存在的风险

《基金合同》生效后，在国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额的存续期内，基金

管理人将根据《基金合同》的约定办理国泰医药份额与医药 A 份额、医药 B 份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变医药 A 份额和医药 B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### （7）基金的收益分配

在存续期内，本基金（包括国泰医药份额、医药 A 份额和医药 B 份额）将不进行收益分配。

在每个运作周期的定期折算日，基金管理人将根据《基金合同》的约定对本基金的 A 份额和基础份额实施定期份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

#### 六、其他风险

主要是由某些不可抗力因素，如战争、自然灾害等造成的基金财产损失的风险。

## 第二十三部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

如果本基金合同终止，医药 A 份额和医药 B 份额将全部折算为场内国泰医药份额，份

额折算基准日为本基金合同终止日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日），份额折算方式和份额折算计算方式，适用基金合同第二十二部分的约定。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

## 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

# 第二十四部分 基金合同内容摘要

## 一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

### 1、基金管理人的权利

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）依法募集基金；
- （2）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；
- （3）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；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规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；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）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；
- （9）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；
- （10）依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）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；
- （12）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；
- （13）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；

（14）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；

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

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）依法募集基金，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发售、申购、赎回和登记事宜；

（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认购、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，确定国泰医药份额申购、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）按规定受理国泰医药份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（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；

（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前提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）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）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。

### 3、基金托管人的权利

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，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(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) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### 4、基金托管人的义务

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和证券账户，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、国泰医药份额的申购、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；

(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监管机构，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定；

(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。

## 5、基金份额持有人的权利

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) 依法转让其持有的医药 A 份额和医药 B 份额，依法申请赎回其持有的国泰医药份额；

(4) 按照规定要求召开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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### 6、基金份额持有人的义务

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》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《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定；
- (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。

#### 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由国泰医药份额、医药 A 份额与医药 B 份额基金份额持有人独立进行表决。国泰医药份额、医药 A 份额与医药 B 份额基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认/申购、场外认/申购、分拆、合并或上市交易）而有所差异。

2、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：

- (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) 提高基金管理人、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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止医药 A 份额与医药 B 份额的运作；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②指单独或合计持有国泰医药份额、医药 A 份额与医药 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 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。

3、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整国泰医药份额的申购费率或收费方式、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 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；
- (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。

#### 4、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。
- (2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。
- (3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不

召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

（4）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

（5）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## 5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、投票表决

意见寄交的截止时间和收取方式。

如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上。（①含 50%，下同；②指全部有效凭证所对应的国泰医药份额、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，下同）。

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以通讯的方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效

力；

3) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额分别占权益登记日国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额 50%以上（含 50%）；

4) 上述第 3) 项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

(3) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (2) 议事程序

#### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第 9 条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额的基金份额持有人和代理人所持各自类别内的表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不



影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 8、表决

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持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加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 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第（2）项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会国泰医药份额、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）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止医药 A 份额和医药 B 份额的运作、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 9、计票

### （1）现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，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基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 10、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

## 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

## 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

如果本基金合同终止，医药 A 份额和医药 B 份额将全部折算为场内国泰医药份额，份额折算基准日为本基金合同终止日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日），份额折算方式和份额折算计算方式，适用本基金合同第二十二部分的约定。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

## 3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（4）基金财产清算程序：

1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- 3) 对基金财产进行估值和变现;
- 4) 制作清算报告;
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- 7) 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

(6) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(7) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(8) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(9) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议的处理

各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 可通过友好协商解决, 但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的, 则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册, 供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十五部分 托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### 1、基金管理人

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

邮政编码：200082

法定代表人：陈勇胜

成立日期：1998 年 3 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[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

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、

咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、债券回购、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%，其中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），权证投资不高于基金资产净值的 3%。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%；

（2）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）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 本基金管理人管理的且由本托管人托管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%；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 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%；

(13) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

1) 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）、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) 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%；

4) 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) 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%；

6) 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或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。

（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）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，如基金托管人事前已严格遵循了监督流程仍无法阻止该关联交易的发生，而只能按相关法律法规和交易所规则进行事后结算，则基金托管人不承担由此造成的损失，并应向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临



时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、国泰医药份额、医药 A 份额与医药 B 份额各自的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

（2）基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

（3）基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基

金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在10个工作日内纠正或拒绝结算。

7、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

（1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

（3）在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

（4）在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

（5）基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

（6）基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

(7) 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

8、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

9、基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和国泰国证医药份额、医药 A 份额与医药 B 份额各自的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收

到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。
- （7）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 2、基金募集期间及募集资金的验资

- （1）基金募集期间的资金应存于基金管理人在具备基金销售业务资格的商业银行或者从事客户交易结算资金存管的商业银行等开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- （2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证

券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

（3）若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### 3、基金资金账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

（2）基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

（3）基金托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

（5）在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4、基金证券账户的开立和管理

（1）基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

（2）基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

（4）基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（5）在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相

关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

（1）因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### 五、基金资产净值的计算和复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额的基金份额净

值，并按规定公告。

## 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将国泰医药份额、医药 A 份额、医药 B 份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### 2、基金托管协议终止的情形

- （1）基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### 3、基金财产的清算

自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

### 八、争议的解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 第二十六部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### 一、客户服务专线

- 1、理财咨询:人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。
- 2、全天候的 7×24 小时电话自助查询（基金净值、账户信息等）。

### 二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过电话信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

### 三、短信提示发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费手机短信资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送短信资讯。

### 四、电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送电子资讯。

### 五、联系基金管理人

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



2、电子邮箱：service@gtfund.com

3、客户服务热线：400-888-8688（全国免长途话费），021-31089000

4、客户服务传真：021-31081700

5、基金管理人办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

邮编：200082

六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十七部分 其他应披露事项

公告名称	报纸	日期
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券（山东）有限责任公司开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/9/6
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏江南农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/9/20
国泰基金管理有限公司关于调整旗下深圳证券交易所上市开放式基金业务规则的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/9/30
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加长江证券股份有限公司申购（含定投）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/10/9
国泰基金管理有限公司关于上海万得基金销售有限公司新增销售旗下部分基金并开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/10/31
国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/11/4
国泰基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/11/15
国泰基金管理有限公司关于通华财富（上海）基金销售有限公司新增销售旗下部分基金并开通定期定额投资计划的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/11/20
国泰基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/12/4
关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金办理定期定额折算业务的公	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/12/27

告		
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/12/28
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行股份有限公司申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/12/29
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司“2018 倾心回馈”基金定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/12/29
国泰基金管理有限公司关于天津万家财富资产管理有限公司新增销售旗下部分基金并开通定期定额投资计划、转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/12/29
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/12/30
国泰基金管理有限公司关于旗下产品缴纳增值税的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/12/30
关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间医药 A 份额停复牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018/1/3
关于中国中投证券有限责任公司对国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018/1/3
关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金之医药 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018/1/4
关于国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018/1/4
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018/1/10
国泰基金管理有限公司关于国泰元鑫资产管理有限公司股权结构等事项变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2018/1/11
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司费率	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018/1/12

优惠活动的公告		
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、 《证券时报》、《证券日报》	2018/1/17
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、 《证券时报》、《证券日报》	2018/1/31
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京展恒基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、 《证券时报》、《证券日报》	2018/2/1
国泰基金管理有限公司关于上海利得基金销售有限公司对旗下部分基金开通定期定额投资计划、转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、 《证券时报》、《证券日报》	2018/2/6

## 第二十八部分 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构的住所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十九部分 备查文件

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- 一、中国证监会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文件
- 二、《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金基金合同》
- 三、《国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照

国泰国证基金管理有限公司

2018年4月13日