

# 国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年第 1 季度报告

### 2019 年 3 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年四月二十二日

## §1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 4 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2019 年 3 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日 17:00 止。本次大会审议了《关于国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，本次会议议案于 2019 年 4 月 1 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》有关规定，同意修改国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金类别、基金合同终止条款、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费用、收益分配原则、更名为“国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金”并修订《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等。为实施国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案，授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行修改和补充，并根据《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金实施转型。”自本次基金份额持有人大会决议生效公告之日即 2019 年 4 月 2 日起，修改后的《国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。具体可查阅本基金管理人于 2019 年 4 月 2 日披露的《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国泰结构转型灵活配置混合
基金主代码	000512
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 19 日
报告期末基金份额总额	28,911,566.80 份
投资目标	通过深入研究，积极投资于我国长期经济结构转型过程中符合经济发展方向、增长前景确定且估值水平合理的优质企业，分享经济转型发展带来的高成长和高收益，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过深入分析国家产业政策并综合判断经济结构转型趋势，积极挖掘我国长期经济结构转型过程中符合经济结构调整、产业转型升级方向，且具有较高成长性和合理估值水平的上市公司股票，构建并动态优化投资组合。</p> <p>具体而言，本基金的投资策略分为两个层次：首先是大类资产配置，即采用基金管理人的资产配置评估模型（Melva），依据对宏观经济、企业盈利、流动性、估值水平等相关因素的分析，确定不同资产类别的配置比例；在大类资产配置的基础上，本基金将在受益于我国经济结构转型的产业领域内，采取自下而上的选股方法，通过系统分析上市公司基本面和估值水平，深入挖掘具有较高成长性且估值水平合理的上市公司股票，在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下，完成本基金投资组合的构建，并依据我国经济转型的推进和市场环境的演变对投资组合进行动态调整。</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰结构转型灵活配置混合 A	国泰结构转型灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000512	002063
报告期末下属分级基金的份额总额	15,679,591.32 份	13,231,975.48 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日)	
	国泰结构转型灵活配置 混合 A	国泰结构转型灵活配置 混合 C
	1.本期已实现收益	1,127,992.19
2.本期利润	3,567,056.43	2,954,770.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.2075	0.2130
4.期末基金资产净值	28,496,974.96	23,819,659.79
5.期末基金份额净值	1.817	1.800

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1、国泰结构转型灵活配置混合 A：

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
过去三个月	12.93%	0.82%	13.89%	0.77%	-0.96%	0.05%

#### 2、国泰结构转型灵活配置混合 C：

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
过去三个月	13.21%	0.82%	13.89%	0.77%	-0.68%	0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2014 年 5 月 19 日至 2019 年 3 月 31 日)

#### 1. 国泰结构转型灵活配置混合 A：



注：本基金的合同生效日为 2014 年 5 月 19 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰结构转型灵活配置混合 C:



注：本基金的合同生效日为 2014 年 5 月 19 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
艾小军	本基金的基金经理	2018-08-09	-	18 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰

				<p>黄金交易型开放式证券投资基金、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的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任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，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月起兼任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）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 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，2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金和国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基</p>
--	--	--	--	--

					金经理，2019 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金(由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度在中美贸易纠纷走向缓和、市场流动性整体宽松的背景下，受大规模减税降费的利好以及科创板加速推进，资本市场地位得到了空前的提高，A 股自年初以来一扫去年的阴霾，大幅拉升，呈现普涨格局，表现位居全球主要资本市场首位。沪深两市成交大幅提升，由前期 3000 亿左右提高到接近万亿。受科创板加速推进的刺激，包括直接受益的资本市场主力券商板块以及与科创直接相关的计算机、半导体、通信等行业受到资金的青睐，板块主题行情轮番演绎；前期受非洲猪瘟影响的养猪板块在猪价大幅上涨的预期下更是迭创新高；在华为、中兴 5G 屡屡被西方国家排除在外又屡屡突围以及国内 5G 建设加速推进的消息刺激下，5G 板块也轮番上涨，风格上前期超跌股、破净股以及题材股领涨。

受益科创板加速推进影响，相关行业和主题的个股表现活跃。在行业表现上，申万一级行业中表现较好的计算机、农林牧渔和食品饮料，涨幅分别为 48.46%、48.42%和 43.58%，表现落后的为银行、公用事业、建筑，分别上涨了 16.85%、17.8%、18.28%。

组合主要在蓝筹股内进行基本面选股，在价值、成长之间保持平衡的同时，坚持采取量化策略进行投资和风险管理，力争获取超额收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰结构转型灵活配置混合 A 在 2019 年第一季度的净值增长率为 12.93%，同期业绩比较基准收益率为 13.89%。

国泰结构转型灵活配置混合 C 在 2019 年第一季度的净值增长率为 13.21%，同期业绩比较基准收益率为 13.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，在科创板即将推出的背景下，叠加减税降费将逐步反映到上市公司利润，上市公司整体业绩有望向好。在美国经济以及全球经济面临下滑的情况下，预计中美贸易纠纷有望得到较好的解决。预计国内外宏观政策友好以及流动性相对宽松有利于市场风险偏好的持续回升。此外从 5 月份开始 A 股纳入 MSCI 以及其他国际主流指数的权重因子提升，预计外资或将保持持续的净流入。总体上我们对二季度的 A 股市场保持积极的观点，风格上绩优价值类股票有望重新获得资金的青睐。行业上我们继续看好长期受益于中国经济结构转型以及关键领域有待突破的计算机、半导体、通信以及军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工等行业。

我们的投资组合仍然会维持价值、成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 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	32,741,006.12	62.07
	其中：股票	32,741,006.12	62.07
2	固定收益投资	49,000.00	0.09
	其中：债券	49,000.00	0.09
	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	19,941,424.11	37.80
7	其他各项资产	17,889.75	0.03
8	合计	52,749,319.98	100.00

#### 5.2 报告期末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	170,040.00	0.33
B	采矿业	2,548,216.00	4.87
C	制造业	12,816,083.12	24.50

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,313,010.00	2.51
E	建筑业	36,350.00	0.07
F	批发和零售业	104,790.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,891,230.00	3.61
H	住宿和餐饮业	166,620.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,042,670.00	1.99
J	金融业	9,879,263.00	18.88
K	房地产业	1,956,414.00	3.74
L	租赁和商务服务业	630,720.00	1.21
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	185,600.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	32,741,006.12	62.58

### 5.3 报告期末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	601318	中国平安	23,200	1,788,720.00	3.42
2	000651	格力电器	20,000	944,200.00	1.80
3	600276	恒瑞医药	13,200	863,544.00	1.65
4	002415	海康威视	20,000	701,400.00	1.34
5	600000	浦发银行	62,000	699,360.00	1.34
6	600900	长江电力	39,000	657,930.00	1.26
7	600887	伊利股份	22,600	657,886.00	1.26
8	000661	长春高新	2,000	633,980.00	1.21
9	601888	中国国旅	9,000	630,720.00	1.21
10	600048	保利地产	44,000	626,560.00	1.20

### 5.4 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）	49,000.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,000.00	0.09

#### 5.5 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	110053	苏银转债	490	49,000.00	0.09

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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。

### 5.10 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“浦发银行”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 2018 年 5 月 4 日中国银保监会发布的处罚公告银监罚决字〔2018〕4 号，浦发银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求、提供不实说明材料、不配合调查取证、以贷转存，虚增存贷款、票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严、国内信用证业务贸易背景审查不严、贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款、违规通过同业投资转存款方式，虚增存款、票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理、对代理收付资金的信托计划提供保本承诺、以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产、投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大、修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符、为非保本理财产品出具保本承诺函、向关系人发放信用贷款、向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符、收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。等共计十九项违规事实。中国银监会决定对其罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。

根据浦发银行 2018 年 4 月到 2019 年 3 月期间发布的公告，公司信用卡中心、郑州、杭州、上海、乌鲁木齐等下属分行、支行由于信用卡业务授信不审慎、违规开展存贷业务、员工管理不到位、违规开展票据业务等行为分别受到当地银保监局罚款、警告等监管处罚。

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。

5.11.2 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。

**5.11.3其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,819.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,085.58
5	应收申购款	4,984.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,889.75

**5.11.4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处于转股期的可转换债券。

**5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	国泰结构转型灵活配置 混合A	国泰结构转型灵活配置 混合C
本报告期初基金份额总额	18,211,896.32	12,940,508.65
报告期基金总申购份额	515,227.16	7,977,595.31
减：报告期基金总赎回份额	3,047,532.16	7,686,128.48

报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	15,679,591.32	13,231,975.48

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年1月1日至2019年3月31日	12,641,195.85	-	-	12,641,195.85	43.72%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2019年3月1日起至2019年3月31日17:00止。本次大会审议了《关于国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，本次会议议案于2019年4月1日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。决议内容如下：“根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》有关规定，同意修改国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金类别、基金合同终止条款、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比

较基准、基金费用、收益分配原则、更名为“国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金”并修订《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等。为实施国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案，授权基金管理人办理本次转型的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行修改和补充，并根据《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金实施转型。”自本次基金份额持有人大会决议生效公告之日即 2019 年 4 月 2 日起，修改后的《国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。具体可查阅本基金管理人于 2019 年 4 月 2 日披露的《国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于核准国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金募集的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一九年四月二十二日