
金鼎证券投资基金召开基金份额持有人大会第一次提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于 2007 年 2 月 9 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）及国泰基金管理有限公司网站（<http://www.gtfund.com>）发布了《金鼎证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开金鼎证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鼎证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商，金鼎证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的基金管理人国泰基金管理有限公司决定以现场方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

- 1、会议时间：2007 年 3 月 9 日上午 9 时 30 分。
- 2、会议地点：北京新世纪日航饭店（北京市海淀区首都体育馆南路 6 号）。
- 3、召开方式：现场方式。

二、会议拟审议事项

基金转型有关事项的议案（见附件一）。

三、会议的议事程序和表决方式

- 1、基金管理人授权的大会主持人宣布会议开始；
- 2、大会主持人宣布与会的基金份额持有人和其代理人数量及其所持有的基金份额总数、占权益登记日基金总份额的比例；
- 3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；
- 4、大会主持人公布监票人和见证律师姓名；
- 5、大会主持人宣读议案；
- 6、享有表决权的与会人员对议案进行审议，并进行表决；
- 7、监票人在基金份额持有人或代理人表决后立即进行清点，计票过程将由公证机关予以公证；

8、大会主持人当场公布计票结果；

9、形成大会决议，并由见证律师就本次会议召开的程序以及基金份额持有人大会形成的决议的合法性、合规性出具法律意见。

四、基金份额持有人的权益登记日

有权出席本次大会的基金份额持有人的权益登记日为 2007 年 2 月 14 日，即在 2007 年 2 月 14 日上海证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）上海分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

五、出席会议需要准备的文件

1、个人基金份额持有人出席会议的，需要提交本人身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、上海证券账户卡（包括 A 股账户卡或基金账户卡，下同）。

2、个人基金份额持有人委托他人出席会议并代理投票的，应当提交基金份额持有人的身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、代理人的身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、基金份额持有人签字的授权委托书（内容及格式见本公告附件二）、上海证券账户卡。

3、机构基金份额持有人出席会议的，需要提交加盖单位公章的企业营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）、单位对出席会议代表的授权委托书（内容及格式见本公告附件二）、被授权人或代表单位出席会议的个人的身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、上海证券账户卡或者加盖单位公章的上海证券帐户卡复印件。

六、出席会议的人员

1、权益登记日的上海证券交易所交易结束后，在中登公司上海分公司登记在册的本基金的个人基金份额持有人或其受托人、机构基金份额持有人代表。

2、基金管理人代表。

3、基金托管人代表。

4、基金管理人聘请的见证律师、公证人员等。

5、其他相关人员。

七、基金份额持有人大会预登记

为提前了解基金份额持有人大会到会情况，保证持有人大会顺利召开，并进行相关准备工作，参会基金份额持有人需办理预登记。持有人大会召开时，基金份额持有人仍须办理正式参会登记，请予以积极配合。

（一）现场方式预登记

1、基金份额持有人采用现场方式进行预登记的，应当提供下列文件：

（1）具备出席大会资格的个人基金份额持有人，凭本人身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、上海证券账户卡进行预登记。

（2）个人基金份额持有人委托他人出席会议的，代理人凭授权委托书、委托人身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、本人身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、委托人上海证券账户卡进行预登记。

（3）具备出席大会资格的机构基金份额持有人，凭企业营业执照（事业单位、社会团体或其他单位可使用有权部门的批文、开户证明或登记证书等）复印件、单位的授权委托书、被授权人或代表单位出席会议的个人的身份证（或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及复印件、上海证券账户卡或者加盖单位公章的上海证券帐户卡复印件进行预登记。

2、基金管理人办理现场预登记的地点为：上海市延安东路 700 号港泰广场 23 楼。

（二）传真方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人可凭上述证件的传真件向基金管理人进行预登记，传真号为 021-23060200。

（三）预登记时间：2007 年 2 月 26 日—2007 年 3 月 6 日，每天 9:00—17:00，周六、周日及法定节假日除外，基金管理人将为基金份额持有人办理现场预登记或传真方式预登记。

八、会议召开的条件

经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的全部有效凭证所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上。

九、形成基金份额持有人大会决议的条件

1、基金份额持有人所持的每份基金份额有一票表决权。

2、基金份额持有人在表决票上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。未填、错填、

字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持基金份额数的表决结果均计为“弃权”。

3、关于基金转型有关事项的议案应当由出席会议的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过。

十、重要提示

本次会议将于 2007 年 3 月 9 日上午 9 时 30 分召开,届时基金管理人、基金托管人和基金管理人聘请的见证律师将对与会的基金份额持有或代理人人员资格的合法性进行审查并予以登记,请出席会议人员务必按照本公告的要求,携带必需的文件提前半小时至会议地点,以便验证入场。

2007 年 2 月 9 日金鼎基金在刊登《金鼎证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》当日停牌,并于下一个交易日(2007 年 2 月 12 日)复牌。此后基金管理人向上海证券交易所申请基金金鼎自 2007 年 2 月 15 日开始再次停牌。基金管理人将于公告基金份额持有人大会决议生效后向上海证券交易所申请复牌。

十一、基金份额持有人大会联系方式

1、 联系人:柳士强

联系电话:021-23060220

传真:021-23060200

2、基金管理人全国客户服务电话:400-888-8688(固话免长途话费)

3、基金管理网址: www.gtfund.com

附件一:《关于金鼎证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二:《授权委托书》

附件三:《金鼎证券投资基金转型方案说明书》

国泰基金管理有限公司

2007 年 2 月 27 日

附件一：

关于金鼎证券投资基金转型有关事项的议案
（审议稿）

金鼎证券投资基金份额持有人：

鉴于金鼎证券投资基金（下称“金鼎基金”）将于 2007 年 5 月 31 日到期，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《金鼎证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对金鼎基金实施转型。《金鼎证券投资基金转型方案说明书》见附件三。

为实施金鼎基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次金鼎基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，并可以在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《金鼎证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

国泰基金管理有限公司

2007 年 2 月 9 日

附件二：

授权委托书

兹委托 先生 / 女士代表本人（或本机构）出席于 2007 年 3 月 9 日召开的金鼎证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。

委托人（签字/盖章）： _____

个人委托人身份证号： _____

委托人持有基金份额数： _____

证券账户卡号： _____

受托人： _____

受托人身份证号： _____

委托日期： 年 月 日

附注：此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件三：

金鼎证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1、鉴于金鼎证券投资基金（简称“金鼎基金”）将于 2007 年 5 月 31 日到期，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《金鼎证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国建设银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议关于金鼎证券投资基金转型有关事项的议案。

2、本次金鼎基金转型方案需经参加相关基金份额持有人大会表决的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过，存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

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

二、金鼎基金转型方案要点

金鼎基金转型方案的主要内容如下：

（一）转换基金运作方式

金鼎基金运作方式由封闭式基金转型为开放式基金，在完成有关转型程序后，开放申购、赎回等业务。在基金份额持有人大会通过基金转型审议事项且公告基金份额持有人大会决议生效之后，基金管理人最迟在 60 个交易日内开放日常申购、赎回。

（二）调整基金存续期限

基金存续期由 2007 年 5 月 31 日到期调整为无限期。

（三）终止基金的上市交易并进行变更登记

基金转型为开放式基金，需要终止上市交易。基金管理人经基金份额持有人大会授权后，将向上海证券交易所申请基金的终止上市交易。

基金终止在上海证券交易所上市交易后，基金管理人将根据终止上市权益登记日的基金份额持有人名册，进行基金份额更名以及必要的信息变更；中登公司将为投资者办理基金份额的初始登记。在基金开放赎回业务后，原基金份额持有人可通过场内上海证券交易所开放式基金销售系统（以下简称“上证基金通”）或在办理相关手续后通过场外机构办理基金份额

的赎回。

（四）调整基金的投资目标、投资范围和投资策略

1、投资目标

金鼎基金投资目标是“以属于朝阳产业的上市公司为投资重点的成长型基金，在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化”。

投资目标拟调整为“本基金以量化指标分析为基础，精选具有内在投资价值的个股，在严格控制风险的前提下，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报”。

2、投资范围

金鼎基金投资范围是“仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。主要投资于沪深两市在产业生命周期中处于成长期和正进入成熟期的上市公司”。

投资范围拟调整为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、现金、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%；债券资产的投资比例占基金资产的 0-60%，其中资产支持证券类资产的投资比例占基金资产净值的 0%-10%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。”

3、投资策略

金鼎基金投资策略是：

“以中长线投资为主，辅以适当的短线操作，并注重投资对象的良好流动性和投资组合的合理分散性以降低投资风险。投资对象重点关注信息产业、媒体、生物制药、环保、新材料等产业中成长性良好，具有一定技术含量的企业。同时，也适当关注传统产业中成长性良好以及向新兴产业转型的企业。”

投资策略拟调整为：

“1、资产配置策略

本基金的资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策

以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足基金风险-回报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率的不同，预测短期性回报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

在定量分析方面，主要采用均衡市盈率预测模型，并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算 A 股市场理论上均衡的市盈率水平，然后将其与 A 股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较，来判定股票市场系统性风险的高低，最后根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外，本基金还参照股息率、收益率差距表（1/PE-银行利率）等指标，来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面，主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析，并对根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面，主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

2、股票投资策略

本基金以量化分析为基础，从上市公司的基本面分析入手，建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和 α 值，运用组合优化模型，积极创建并持续优化基金的股票组合，在有效控制组合总体风险的前提下，谋求超额收益。

基金股票池的建立：本基金采取自下而上的方法，从个股选择入手，根据个股的基本面信息，运用多因子模型，选取各行业中具有内在价值的个股组成基金的一级股票池；在一级股票池的基础上，运用现金流折现模型和个股超额收益分析，筛选个股组建基金的二级股票池。

1）一级股票池个股筛选

本基金在建立一级股票池时，是以行业为单位，按照不同行业各自的特点，选取不同的估值因子构建多因子估值模型，对行业内的个股进行估值。本基金的行业分类以天相行业分类标准为依据。

本基金在运用估值模型对行业内个股内在价值估值的基础上，选取各行业价值排名前 1/3 的个股组成基金的一级股票池。

2）二级股票池个股筛选

本基金二级股票池是以现金流折现模型和个股超额收益分析（个股的 α 值）做为筛选标准对基金一级股票池中的个股进行二次筛选。

本基金在运用现金流折现模型时，通过对上市公司未来业绩的预测和场景模拟等方法，

估算个股的未来现金流；在折现因子的确定上，本基金运用加权平均资本成本模型（WACC），充分考虑到股权成本和债券成本的差异和税务盾牌的作用，精确估算个股的折现值。对于周期性行业等现金流波动较大的行业，本基金在现金流折现的基础上，依据这类个股的市场表现，估算个股的 α 值，以 α 值作为二次选股的优先考虑因素。

本基金在一级股票池中选取折现值靠前的300个左右个股组成基金的二级股票池。

3）股票组合构建和调整

本基金在充分考虑个股内在价值和风险收益水平的基础上，在二级股票池中选取个股构建基金的股票组合，运用组合优化模型不断优化股票组合，以达到单位风险下的收益最大化。

3、债券资产投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

1）收益率曲线配置具体策略

当预测收益率曲线平行上移或是陡峭化时，适当地降低债券组合的平均久期；当预测收益率曲线平行下移或是平坦化时，适当地增加债券组合的平均久期；当预测收益率曲线剧烈平行上移时，同时降低债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线剧烈平行下移时，同时增加债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线（正向或是反向）蝴蝶型变化时，适当地将债券组合进行子弹型或是哑铃型配置。

2）债券置换策略

本基金以利差分析为基础，当债券利差增大时，适当增加企业债和金融债的数量、减少国债的数量，当债券利差减小时，适当增加国债的数量、减少企业债和金融债的数量；债券组合的平均信用等级保持在投资级（A+级）以上。

4、其他投资策略

本基金还可按照有关法律法规和中国证监会的规定，投资于权证、资产支持证券等品种，用于分散组合投资风险，获取稳定收益。”

（五）授权基金管理人修订基金合同

基金管理人要求基金份额持有人大会授权修改基金合同，主要是基于以下理由：

第一，金鼎基金拟转换运作方式、调整存续期限、终止上市交易并调整投资目标、投资范围和投资策略，基金管理人需根据基金份额持有人大会决议修订《金鼎证券投资基金基金合同》的相关内容。

第二，自《金鼎证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管

理办法》等法律法规陆续颁布并实施，需要根据法律法规要求修订《金鼎证券投资基金基金合同》的相关内容。

最后，考虑到金鼎基金变更投资目标、投资范围和投资策略后，基金风险收益特征和产品类型发生相应变更，基金管理人拟将基金名称变更为“国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金”。

若基金份额持有人大会授权基金管理人针对上述事项修订基金合同内容，基金管理人完成合同内容修订并经基金托管人审核同意后，将报中国证监会核准。

（六）基金收益分配

为回报投资者，基金管理人将在基金终止上市前，根据实际情况，对原持有人实施收益分配。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）金鼎基金沿革情况

金鼎证券投资基金是由建业基金、沈阳公众基金和陕建基金等 3 只基金经清理规范后合并而成的契约型封闭式基金。

基金发起人为国泰基金管理有限公司和国泰君安证券有限公司。基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

基金于 2000 年 8 月 4 日在上海证券交易所挂牌上市时总份额为 232,748,084 份。基金于 2000 年 10 月 19 日完成扩募后基金总份额增至 5 亿份，基金存续期延长 5 年至 2007 年 5 月 31 日。

（二）基金合同关于转型的约定

按照《金鼎证券投资基金基金合同》的约定，由基金管理人、基金托管人协商提议，基金份额持有人大会通过，并经中国证监会批准，本基金可以由封闭式转为开放式。

（三）基金份额变更登记

基金终止上市后，将进行基金份额变更登记。上海证券交易所、中登公司及其上海分公司和基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。变更登记完成后，投资者可使用证券账户通过场内“上证基金通”系统或在办理相关手续后通过场外机构办理申购、赎回、转托管等业务。因此，基金终止上市不会导致投资者无法变现基金份额，对持有人利益无不良影响。

（四）调整基金投资目标、投资范围和投资策略

基金转型后，定位为追求较高成长的偏股型混合基金，力争实现基金财产的长期增值，

需要对基金投资目标等内容做相应修改。

（五）基金管理人将严格保证基金合同修订的合法合规

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

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

自本说明书公告之日起，基金管理人面向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果转型方案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人计划在 30 日内，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交转型方案议案。

（二）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在基金开放后大量赎回基金份额对基金平稳运作的影响，基金管理人制定了相关措施。

1、对原金鼎基金基金份额持有人（简称“原持有人”）长期持有给予份额激励

基金管理人计划通过采取份额补偿的措施，鼓励原持有人长期持有，避免转型后基金开放赎回后，出现原持有人大规模集中赎回基金份额，对基金投资运作造成冲击。基金管理人将对持有期限（指转型后基金开放日常申购、赎回日到持有人提交赎回申请日的期间）满半年的原持有人在持有的原金鼎基金（基金拆分前）基金份额的基础上给予 0.75% 基金份额补偿；并在持有期限满 1 年后，按前述方法再给予 0.75% 的份额补偿。

为保证原持有人获得份额激励，投资者期间赎回的基金份额优先冲抵在赎回时间点之前申购的基金份额。

2、实施集中申购

在基金终止上市以及基金份额变更登记完成后，基金管理人将以中登公司作为注册登记机构，通过各销售机构以及“上证基金通”系统进行集中申购。集中申购期不超过 1 个月。

（1）集中申购费率如下：

申购金额（M）	费率
M < 50 万	1.00%
50 万 ≤ M < 200 万	0.80%
200 万 ≤ M < 500 万	0.50%

M ≥ 500 万	500 元/笔
-----------	---------

(2) 对于原持有人以及集中申购期间、开放日常申购之后申购的基金份额，适用同一赎回费率。

持有期限	赎回费率
1 年以内（不含 1 年）	0.5%
1 年到 2 年（不含 2 年）	0.2%
2 年（含 2 年）以上	0

其中，须依法扣除所收取赎回费总额的 25% 归入基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。原金鼎基金份额持有人持有期限自修改后的基金合同生效之日起计算；集中申购和日常申购基金份额的持有期限自注册登记机构确认投资者申购申请之日起计算。

4、基金管理人为开放赎回前持有人的变现需求提供流动性服务

在基金份额变更登记完成之后，基金开放赎回之前，对于部分急需变现基金份额的原持有人，基金管理人可为其与其他持有人之间办理份额转移提供相应的服务。

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

(三) 其他风险

转型过程中出现的其他情况带来的问题，基金管理人负责与登记结算机构、证券交易所、基金持有人等相关方沟通解释，并承担相关责任。

五、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。本基金管理人将根据投资者的反馈意见，进一步完善本方案。本方案若有任何修改，将在基金份额持有人大会正式召开前及时公告。

持有人可通过以下方式联系基金管理人：

联系人：柳士强

电话：021-23060220

传真：021-23060200

电子信箱：gtjd@gtfund.com

客户服务电话：400-888-8688

公司网站：www.gtfund.com