

国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告

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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及各基金基金合同的约定，国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与各基金基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，对旗下47只公开募集证券投资基金的基金合同等法律文件进行修订。本次修订将自2021年3月31日起正式生效。

现将基金合同主要修订内容公告如下。

一、根据《指数基金指引》修订内容：

1、“前言”章节增加：

“本基金可能出现跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股（券）停牌（或违约）等风险，详见本基金招募说明书。”，并根据原基金合同相应内容做适应性调整。

2、“基金的基本情况”或“基金的投资”章节标的指数和业绩比较基准部分相应内容调整为：

“……未来若出现标的指数不符合法律法规的要求（因成份股（券）价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”，并根据原基金合同相应内容做适应性调整。

3、《国泰中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同》“基金的投资”章节“投资策略”部分增加：

“指数基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。”

4、“基金的投资”章节业绩比较基准部分相应内容调整为：

“若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行适当程序并进行公告。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”，并根据原基金合同相应内容做适应性调整。

根据《指数基金指引》修订基金合同的基金名单详见附件 1。

二、参与存托凭证投资修订内容：

1、“前言”章节增加存托凭证的风险揭示：

“本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。具体风险烦请查阅本基金招募说明书“风险揭示”章节内容。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。”

2、“基金的投资”章节“投资范围”部分明确“股票”包含存托凭证，相应修订如下：

“.....本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括.....及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、.....以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。”，根据原基金合同投资范围不同做适应性调整，但均修改在投资范围中的股票位置。

3、“基金的投资”章节“投资策略”部分增加存托凭证投资策略：

“存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。”

4、“基金的投资”章节“投资限制”部分中增加存托凭证投资限制：

“本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；”

5、“基金资产估值”章节“估值方法”部分增加存托凭证估值方法：

“本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行，国家有最新规定的，按其规定进行估值。”

6、基金合同内容摘要涉及上述内容的一并调整。

涉及参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件的基金名单详见附件 2。

三、托管协议、招募说明书、产品资料概要涉及到上述相关内容也进行相应修订，并在基金招募说明书（更新）、产品资料概要（更新）中增加相关的风险揭示内容。此外，基金合同、托管协议等文件中对基金管理人的基本信息做了必要的更新。

四、重要提示

1、修订后的基金合同自 2021 年 3 月 31 日起生效，本次修订符合有关法律法规规定和基金合同的约定，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并且履行了适当的程序。修改后的各基金基金合同、托管协议将登载于基金管理人网站（www.gtfund.com）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。投资人办理基金交易等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同等文件。

2、投资人可以通过本基金管理人的网站（www.gtfund.com）或客户服务电话（400-888-8688）咨询相关情况。

风险提示：本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，也不保证最低收益。投资者投资于基金管理人管理的基金时应认真阅读基金相关法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日

附件 1：根据《指数基金指引》修订基金合同的基金名单

序号	基金名称
1	国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金
2	国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金
3	国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金
4	国泰中证食品饮料行业指数证券投资基金
5	国泰中证医药卫生行业指数证券投资基金
6	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金
7	国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金
8	国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
9	国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金
10	国泰中证有色金属行业指数证券投资基金
11	国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)
12	纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金
13	上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金
14	上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金
15	国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金
16	国泰中证航天军工指数证券投资基金(LOF)
17	国泰创业板指数证券投资基金(LOF)
18	国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金
19	国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金
20	国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
21	国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
22	国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金
23	国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
24	国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金
25	国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
26	国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
27	国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金
28	国泰中证 500 指数增强型证券投资基金
29	国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金
30	国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金
31	上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金
32	国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金
33	国泰中证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)
34	国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
35	国泰沪深 300 指数证券投资基金
36	国泰中证房地产行业指数证券投资基金
37	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
38	国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金
39	国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金
40	国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

序号	基金名称
41	国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)
42	国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金
43	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金
44	国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金
45	国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金
46	国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金
47	国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金

附件 2：涉及参与存托凭证投资修订基金合同等法律文件的基金名单

序号	基金名称
1	国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金
2	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金
3	国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金
4	国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金
5	国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金
6	国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金