

关于国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金修改基金合同、托管协议的公告

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《国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定对国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）根据《指数基金指引》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同、托管协议。本次修改将自2021年9月16日起正式生效。

现将具体事宜公告如下：

一、根据《指数基金指引》修改内容

根据《指数基金指引》，本基金基金合同中“前言”、“释义”、“基金的基本情况”、“基金的投资”等部分将相应进行修改及适应性调整。具体修改内容详见附件修改对照表。

二、根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改内容

根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》，本基金将明确投资范围中的标的指数成份股、备选成份股中包含存托凭证，并相应修改基金合同、托管协议。具体修改内容详见附件修改对照表。

三、本基金基金合同、托管协议的修改内容对基金份额持有人利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会审议，并已报中国证监会备案。本公司将根据修改的基金合同、托管协议对本基金的招募说明书、基金产品资料概要进行相应的更新和修改。

四、重要提示：

1、本公告仅对本基金修改基金合同、托管协议的有关事项予以说明。投资

者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读刊登于本公司网站（www.gtfund.com）的本基金的基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要等法律文件，以及相关业务公告。

2、投资者可访问本公司网站（www.gtfund.com）或拨打全国免长途话费的客户服务电话（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9月16日

附件一：《国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》修改对照表

修改章节	修改前	修改后
<p>第一部分 前言</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》和其他有关法律法规。</p> <p>三、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。</p> <p>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财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》、《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》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。</p> <p>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财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p> <p>本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表</p>

		现, 投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险, 详见本基金招募说明书。
第二部分 释义		15、《指数基金指引》: 指《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订
	57、标的指数: 指中证指数有限公司编制并发布的中证畜牧养殖指数及其未来可能发生的变更	58、标的指数: 指中证指数有限公司编制并发布的中证畜牧养殖指数
第三部分 基金的基本情况	<p>八、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证畜牧养殖指数及其未来可能发生的变更。</p> <p>中证畜牧养殖指数由中证指数有限公司编制和发布。如果指数编制机构变更或者停止标的指数编制及发布, 或者标的指数由其他指数代替, 本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则, 在履行适当程序后变更本基金的标的指数, 并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。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机构变更、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。</p>	<p>八、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证畜牧养殖指数。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具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。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具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。</p>
	三、投资策略	三、投资策略

	<p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 股票组合构建方法</p> <p>本基金可以直接投资本基金标的指数的成份股及备选成份股，该部分股票资产投资原则上主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：1) 标的指数成份股流动性严重不足；2) 标的指数的成份股长期停牌；3) 其他对本基金管理人跟踪标的指数构成严重制约的情形等。</p> <p>(2) 股票组合的调整</p> <p>1) 定期调整</p> <p>本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>基金经理将跟踪标的指数变动、基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p>	<p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 股票组合构建方法</p> <p>本基金可以直接投资本基金标的指数的成份股及备选成份股，该部分股票资产投资原则上主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：1) 标的指数成份股流动性严重不足；2) 标的指数的成份股长期停牌；3) 其他对本基金管理人跟踪标的指数构成严重制约的情形等。</p> <p>(2) 股票组合的调整</p> <p>1) 定期调整</p> <p>本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>基金经理将跟踪标的指数变动、基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>3) 本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额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股进行调整。</p>
	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中证畜牧养殖指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%</p> <p>中证畜牧养殖指数由中证指数有限公司编制，从沪深证券中选取涉及畜禽饲料、畜禽药物以及畜禽养殖等业务的上市公司证券作为样本，以反映畜牧养殖相关上市公司的整体表现。本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数。因此，该指数能够较</p>	<p>五、标的指数与业绩比较基准</p> <p>1、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证畜牧养殖指数。</p> <p>未来若出现标的指数不符合法律法规的要求(因成份股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</p>

	<p>好地反映本基金的投资策略，能够较为客观地反映本基金的风险收益特征。</p> <p>如果指数编制机构变更或停止标的指数的编制、发布、维护或授权，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业绩比较基准组成部分的，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人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</p> <p>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。</p> <p>2、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中证畜牧养殖指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p> <p>本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数。因此，该指数能够较好地反映本基金的投资策略，能够较为客观地反映本基金的风险收益特征。</p> <p>若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准相应调整，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。</p>
	<p>七、目标 ETF 的变更</p> <p>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金在履行适当程序后，将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</p> <p>2、目标 ETF 终止上市；</p> <p>3、目标 ETF 的基金合同终止；</p> <p>4、目标 ETF 与其他基金进行合并；</p>	<p>七、目标 ETF 的变更</p> <p>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金在履行适当程序后，将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</p> <p>2、目标 ETF 终止上市；</p> <p>3、目标 ETF 的基金合同终止；</p> <p>4、目标 ETF 与其他基金进行合并；</p>

	<p>5、目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> <p>如果未来目标 ETF 的标的指数发生变更，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF，不需另行召开基金份额持有人大会。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决，目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。</p>	<p>5、目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> <p>若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数并继续投资于该目标 ETF。</p>
<p>基金合同内容摘要相应调整</p>		

附件二：《国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》修改对照表

修改章节	修改前	修改后
<p>第三条 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>3.1 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>3.1.1 基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。本基金将投资于以下金融工具：</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具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。</p>	<p>3.1 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>3.1.1 基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。本基金将投资于以下金融工具：</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具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。</p>