

国泰国证房地产行业指数证券投资基金  
上市交易公告书

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2021年1月20日

公告日期：2021年1月15日

## 目录

一、重要声明与提示 .....	1
二、基金概览 .....	2
三、基金的历史沿革、日常申赎与上市交易 .....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	5
五、基金主要当事人简介 .....	6
六、基金合同摘要 .....	14
七、基金财务状况 .....	15
八、基金投资组合 .....	17
九、重大事项揭示 .....	22
十、基金管理人承诺 .....	23
十一、基金托管人承诺 .....	24
十二、备查文件目录 .....	25
附件：基金合同内容摘要 .....	26

## 一、重要声明与提示

国泰国证房地产行业指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资人详细查阅刊登在本基金管理人网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）上的《国泰国证房地产行业指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：国泰国证房地产行业指数证券投资基金。
- 2、基金场内简称：国泰地产。
- 3、基金代码：160218。
- 4、2021年1月13日基金份额总额：997,567,752.32份。
- 5、2021年1月13日基金份额净值：0.9977元。
- 6、本次上市交易的基金份额总额：120,544,648份（截至2021年1月13日）。
- 7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
- 8、上市交易日期：2021年1月20日。
- 9、基金管理人：国泰基金管理有限公司。
- 10、基金托管人：中国银行股份有限公司。
- 11、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。
- 12、基金份额的申购与赎回：  
投资人可通过场外或场内两种方式申购或赎回基金份额（基金代码：160218）。

办理本基金场内申购、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。办理本基金场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构（详见基金管理网站或相关文件）。

### 三、基金的历史沿革、日常申赎与上市交易

#### （一）本基金的历史沿革

国泰国证房地产行业指数证券投资基金由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来。

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可【2012】1654 号文核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金自 2013 年 1 月 14 日起向社会公开募集，于 2013 年 1 月 31 日结束募集，并于 2013 年 2 月 6 日获得中国证监会的书面确认，国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金自该日起成立。

根据《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》约定，国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止房地产 A 份额与房地产 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人于 2020 年 12 月 2 日在指定媒介发布《关于国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金之房地产 A 份额和房地产 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的房地产 A 份额和房地产 B 份额终止上市，并进行基金份额折算。《国泰国证房地产行业指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

#### （二）本基金的日常申购、赎回情况

本基金基金份额的日常申购、赎回业务已于 2021 年 1 月 5 日起恢复办理。投资人可详细查阅刊登在 2020 年 12 月 29 日《上海证券报》及国泰基金管理有限公司网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）上公告的《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金暂停申购、赎回暨基金份额转换业务期间相关业务状态的公告》。

#### （三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2021】

58 号

2、上市交易日期：2021年1月20日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资人在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：国泰地产

5、交易代码：160218

6、本次上市交易份额：120,544,648份（截至2021年1月13日）

7、基金资产净值的披露：每个工作日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的次日公布该日的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：

未上市交易的托管在场外的基金份额，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后，即可上市流通。本基金的转托管业务已于2021年1月5日起开始办理，具体详见本基金管理人的相关公告。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）持有人户数

截至 2021 年 1 月 13 日，本基金场内基金份额持有人户数为 8,607 户，平均每户持有的场内基金份额为 14,005.42 份；本基金场外基金份额持有人户数为 92,284 户，平均每户持有的场外基金份额为 9,503.52 份。

### （二）持有人结构

截至 2021 年 1 月 13 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为 28,241,558 份，占本次上市交易基金份额比例为 23.43%；个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为 92,303,090 份，占本次上市交易基金份额比例为 76.57%。

### （三）场内前十名基金份额持有人的情况

截至 2021 年 1 月 13 日，场内前十名基金份额持有人的情况如下表：

序号	基金份额持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内基金份额的比例（%）
1	新华人寿保险股份有限公司	14517499.00	12.04
2	中国银河证券股份有限公司	10962557.00	9.09
3	施鸿宇	6432931.00	5.34
4	王珏	3743441.00	3.11
5	张美芳	3485496.00	2.89
6	宋伟铭	3264816.00	2.71
7	欧静虹	2463611.00	2.04
8	孙奕晖	2430499.00	2.02
9	林鲁东	2000000.00	1.66
10	朱洪宏	1832049.00	1.52

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：国泰基金管理有限公司
- 2、法定代表人：邱军
- 3、总经理：周向勇
- 4、注册资本：壹亿壹仟万元人民币
- 5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基字【1998】5 号
- 7、工商登记注册的营业执照统一社会信用代码：91310000631834917Y
- 8、经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务。
- 9、股权结构

股东名称	持股比例
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%

### 10、内部组织结构及职能

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；

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；

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；

公司稽核监察部门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。

#### 11、人员情况

截至 2020 年 12 月 31 日，公司正式员工 316 人，其中 68.99%（218 人）的员工具有硕士及以上学历。

#### 12、信息披露负责人：刘国华

咨询电话：400-888-8688

#### 13、基金管理业务情况

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 151 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、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、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、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、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、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、国泰大健康股票型证券投资基金、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、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、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、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、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、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、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、国泰可转债债券型证券

投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、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）、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）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、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转型而来）、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、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期

开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、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（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、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、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、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、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、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、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（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）、国泰中证医疗交易型开放式指数

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。

#### 14、本基金基金经理

徐成城，硕士研究生，15 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）的基金经理，2017 年 2 月至 2020 年 12 月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 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和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，2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月至 2020 年 12 月任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和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月起兼任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、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、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 2 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月起兼任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和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的基金经理，2021 年 1 月起兼任国泰国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金

终止分级运作变更而来)的基金经理。

## (二) 基金托管人情况

### 1、基金托管人基本情况

#### (1) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

#### (2) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

#### (3) 证券投资基金托管情况

截至2020年9月30日，中国银行已托管854只证券投资基金，其中境内基金808只，QDII基金46只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 2、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

## 3、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

根据《基金法》、《运作办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### （三）验资机构

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

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。



## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金自基金合同生效至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至 2021 年 1 月 13 日的资产负债表（未经审计）如下：

#### 国泰国证房地产行业指数证券投资基金

#### 2021年1月13日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	本期末 2021 年 1 月 13 日
资产：	
银行存款	69,474,837.03
结算备付金	552,799.62
存出保证金	198,032.65
交易性金融资产	914,543,903.92
其中：股票投资	914,543,903.92
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	663,569.15
应收利息	18,203.12
应收股利	-

应收申购款	31,849,257.41
其他资产	-
资产总计	1,017,300,602.90
负债与持有人权益	
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	20,950,622.11
应付管理人报酬	351,713.13
应付托管费	70,342.62
应付销售服务费	-
应付交易费用	228,900.55
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	187,835.62
其他负债	248,122.00
负债合计	22,037,536.03
所有者权益：	-
实收基金	624,360,395.71
未分配利润	370,902,671.16
所有者权益合计	995,263,066.87
负债和所有者权益总计	1,017,300,602.90

注：报告截止日 2021 年 1 月 13 日，本基金基金份额净值：0.9977 元，本基金份额总额：997,567,752.32 份。

## 八、基金投资组合

截至 2021 年 1 月 13 日，本基金的投资组合情况如下：

### （一）报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	914,543,903.92	89.90
	其中：股票	914,543,903.92	89.90
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	70,027,636.65	6.88
6	其他各项资产	32,729,062.33	3.22
7	合计	1,017,300,602.90	100.00

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末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	3,349,880.27	0.34
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	15,697.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,125.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,178,006.89	0.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,213.63	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,464.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	80,053.17	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,852.40	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,673,293.68	0.47

## 2、报告期末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	23,681,125.68	2.38
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	-	-
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	7,190,749.12	0.72

K	房地产业	858,698,981.20	86.28
L	租赁和商务服务业	20,299,754.24	2.04
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	909,870,610.24	91.42

(三) 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	000002	万科A	5,124,598	153,225,480.20	15.40
2	600048	保利地产	9,083,527	140,340,492.15	14.10
3	001979	招商蛇口	4,343,627	56,249,969.65	5.65
4	601155	新城控股	1,090,858	38,572,738.88	3.88
5	600383	金地集团	2,838,493	35,027,003.62	3.52
6	000656	金科股份	4,326,952	31,543,480.08	3.17
7	600340	华夏幸福	2,262,153	25,290,870.54	2.54
8	600177	雅戈尔	3,182,947	23,681,125.68	2.38
9	600606	绿地控股	4,069,832	23,075,947.44	2.32
10	000961	中南建设	2,578,100	20,753,705.00	2.09

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	688256	寒武纪	7,583	1,118,416.67	0.11
2	688819	天能股份	13,552	566,338.08	0.06
3	688017	绿的谐波	4,138	507,691.22	0.05
4	300999	金龙鱼	4,876	477,165.36	0.05
5	300896	爱美客	350	249,004.00	0.03

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

(五) 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

(六) 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资股指期货交易情况说明

注：截至本报告期末，本基金未进行股指期货交易。

(九) 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。

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	198,032.65
2	应收证券清算款	663,569.15
3	应收股利	-
4	应收利息	18,203.12

5	应收申购款	31,849,257.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,729,062.33

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### (1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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。

##### (2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688256	寒武纪	1,118,416.67	0.11	新股锁定
2	688819	天能股份	566,338.08	0.06	网下新股
3	688017	绿的谐波	507,691.22	0.05	新股锁定
4	300999	金龙鱼	477,165.36	0.05	新股锁定
5	300896	爱美客	249,004.00	0.03	新股锁定

## 九、重大事项揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。



## 十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；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，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、备查文件目录

- (一) 中国证监会关于核准国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金募集的批复文件；
- (二) 《国泰国证房地产行业指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《国泰国证房地产行业指数证券投资基金托管协议》；
- (四) 《国泰国证房地产行业指数证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件和营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人和基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

风险提示：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，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读基金的《基金合同》、《招募说明书》，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。

国泰基金管理有限公司

二〇二一年一月十五日

## 附件：基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利

(1) 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；

(2) 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；

(3) 销售基金份额；

(4) 召集基金份额持有人大会；

(5) 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；

(6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(7) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、

转换和非交易过户的业务规则；

(16) 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

(1) 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净值信息，确定申购、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) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(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条件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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册；

(26) 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

(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

(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、基金份额净值及申购、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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,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

本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

(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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(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

- (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。

7、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金资产账户名称而有所改变。

#### 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 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）；

- (7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (8) 本基金与其他基金合并；
- (9) 终止基金份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- (13) 法律法规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、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费率、基金托管费率和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (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；
- (6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

(1) 除法律法规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，应当自行召集。

(3) 单独或合计持有10%以上的基金份额持有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。

(4) 单独或合计持有10%以上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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上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。

(5) 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) 基金份额持有人大会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，召集人应当于会议召开前30天在指定媒介上公告。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将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名、电话；
- (5) 权益登记日；

(6) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

(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，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上。（含50%，下同）；

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；

(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代表的基金份额占权益登记日基金总份额50%以上（含50%）；

(4) 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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

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

1) 议事内容限为本条前述第2款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合计持有10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合计持有10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

5) 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

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 8、表决

(1) 基金份额持有人持有的每一份基金份额拥有同等的投票权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会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。

### 2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同应当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，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决；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) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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中推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(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，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中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下,如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的,则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式可采取如下方式:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票,并由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

## 10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项,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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。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定。

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内,由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。

(4) 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### 1、收益的构成

基金利润是指基金利息收入、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。

期末可供分配利润，指截至收益分配基准日采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

## 2、收益分配原则

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

(2) 本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配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相关规定执行；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 3、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## 4、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。

## 5、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。对于场外份额，当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内基金份额，则遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

## 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

### 1、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) 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- (6) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (7) 基金份额持有人大会费用；
- (8) 基金合同生效以后的会计师费、律师费和诉讼费；
- (9) 基金资产的资金汇划费用；
- (10) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

## 2、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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### (2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管

人。

### （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许可使用合同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。

（4）本条第1款第（4）至第（10）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

本条第1款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用根据《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》的相关约定执行。

### 4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### 5、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### 1、投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 2、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。

## 3、投资禁止行为与限制

### （1）禁止用本基金资产从事以下行为

- 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) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

### （2）基金投资组合比例限制

- 1) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净

值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

2) 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5%；本基金持有的同一资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；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%；

3) 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。本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三个月内全部卖出；

4) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

5) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

6) 本基金持有的现金和到期日不超过1年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；

7) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于股票资产的90%；

8) 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。

9) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；

10) 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；

11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

(3) 若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### 2、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 3、基金净值信息

在本基金基金份额上市交易或开始办理申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

## 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。

(2) 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

## 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止；

(2) 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

(3) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

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) 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

(2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 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；
- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8) 对基金财产进行分配。

### (4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款1)、2)、3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

### (6) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算

报告提示性公告登载在指定报刊上。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

#### 八、争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的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中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外,本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所,投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件,基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。