# 关于以通讯方式召开国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议的基本情况

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）管理的国泰深证TMT50指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于2015年3月26日生效。本基金的基金份额但招国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的基础份额（基金代码“160224”，以下简称“国泰TMT50份额”），国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（基金代码“150215”，以下简称“TMT50A份额”）和国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的积极收益类份额（基金代码“150216”，以下简称“TMT50B份额”）。

根据《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》等法律法规的规定和《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司决定以通讯方式召开本基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2020年9月28日起至2020年10月28日17:00止（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票及授权委托书的寄送地点：

基金管理人：国泰基金管理有限公司

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

持有人大会专线/客服电话：（400-888-8688转0）

邮政编码：200082

请在信封表面注明：“国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4.投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8688，021-31089000咨询。

二、会议审议事项

《关于国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）

上述议案的说明及基金合同的修订内容详见《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年10月27日，即2020年10月27日交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括国泰TMT50份额、TMT50A份额与TMT50B份额的基金份额持有人）均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1.本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（www.gtfund.com）下载并打印或按以上格式自制表决票。

2.基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书（样式见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（6）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（7）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2020年9月28日起至2020年10月28日17:00以前通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

本基金管理人的办公地址及联系方式如下：

基金管理人：国泰基金管理有限公司

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

邮政编码：200082

4.投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8688，021-31089000咨询。

五、计票

1.本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国农业银行股份有限公司）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。如基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2.本基金全部份额持有人的表决权

国泰TMT50份额、TMT50A份额与TMT50B份额基金份额持有人持有的每一基金份额在其份额类别内拥有平等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认申购、场外认/申购、自动分离、分拆、合并或上市交易）而有所差异。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前的送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见选、多选，模糊不清或相互矛盾但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（2）表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（3）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的国泰TMT50份额、TMT50A份额、TMT50B份额分别占权益登记日国泰TMT50份额、TMT50A份额、TMT50B份额各自基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；

2、《关于国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》 须经参加大会的国泰TMT50份额、TMT50A份额和TMT50B份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰TMT50份额、TMT50A份额和TMT50B份额各自类别内的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过；

3.本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

1.召集人：国泰基金管理有限公司

持有人大会专线/客服电话：（400-888-8688转0）

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

传真：021-31081700

电子邮件：service@gtfund.com

网址：www.gtfund.com

2.基金托管人：中国农业银行股份有限公司

3.公证机构：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系方式：021-62154848

4.见证律师事务所：上海市通力律师事务所

八、重要提示

1.如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改，取消分级证券投资基金份额的转换，将TMT50A份额按照基金合同约定的比例转换为国泰TMT50份额。届时，基金管理人将根据变更基金名称、修改基金合同并披露内容分别履行相关法律法规规定的程序。敬请投资者合理安排投资计划。

2.请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3.根据深圳证券交易所业务规则要求，本基金TMT50A份额、TMT50B份额的首次停牌时间为本公告刊登日（2020年9月28日）开市起至当日10:30。本基金TMT50A份额、TMT50B份额第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2020年10月29日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4.上述基金份额持有人大会有关公告可通过国泰基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-8688，021-31089000咨询。

5.关于本次议案的说明见附件四《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

6.本通知的有关内容由国泰基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》

国泰基金管理有限公司
2020年9月28日

**附件一：**

## 关于国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案

**国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额持有人：**

根据市场环境变化，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，国泰TMT50指数分级基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国农业银行股份有限公司）协商一致，提议对国泰深证TMT50指数分级证券投资基金实施转型，内容包括取消基金份额上市交易及分级运作机制、调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费用、收益分配方式、变更基金份额类别设置，更名为“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”，并修订《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

为实施国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案，提议投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《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》等法律文件进行修改和补充，并根据《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》等法律文件进行修改和补充，并根据《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对国泰深证TMT50指数分级证券投资基金实施转型。

以上议案，请予审议。

国泰基金管理有限公司
2020年9月28日

**附件二：**

## 国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票

| 基金份额持有人姓名或名称： | | | |
|---|---|---|---|
| 证件号码（身份证件/营业执照/其他） | | 基金账户号/证券账户卡号 | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 关于国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案 | | | |
| 基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章 | | | 2020年月日 |

说明：

1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所属基金账户号/证券账户卡号的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。

2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决。

3、本表决票中“基金账户号/证券账户卡号”，指持有国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额的基金账户号或证券账户卡号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号/证券账户卡号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户卡号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的国泰深证TMT50指数分级证券投资基金所有份额（包括国泰TMT50份额、TMT50A份额和TMT50B份额）。

（本表决票可剪报、复印或登录国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金管理人网站（www.gtfund.com）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效）。

**附件三：**

## 授权委托书

兹委托_____代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年10月28日的以通讯方式召开的国泰深证TMT50指数分级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。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若国泰深证TMT50指数分级证券投资基金重新召开审议相同议案的国泰基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件/营业执照）：

委托人基金账户号/证券账户卡号：_____

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）证件号码（身份证件/营业执照）：_____

委托日期：2020年月日

授权委托书填写注意事项：

1.本授权委托书中“基金账户号/证券账户卡号”，指持有国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金份额的基金账户号或证券账户卡号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号/证券账户卡号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户卡号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的国泰深证TMT50指数分级证券投资基金所有份额（包括国泰TMT50份额、TMT50A份额和TMT50B份额）。

2.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。

**附件四：**

## 国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1.国泰深证TMT50指数分级证券投资基金（以下简称“国泰TMT50指数分级”）基金合同于2015年3月26日生效。根据市场环境变化，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，国泰TMT50指数分级基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国农业银行股份有限公司）协商一致，提议对国泰深证TMT50指数分级证券投资基金实施转型，内容包括取消基金份额上市交易及分级运作机制、调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征、基金费用、收益分配方式、变更基金份额类别设置，更名为“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”，并修订《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

二、国泰TMT50指数分级转型方案要点

转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“国泰深证TMT50指数分级证券投资基金”变更为“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”（以下简称“本基金”）。

（二）取消分级运作机制

转型后本基金将终止分级运作，因而不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制。

（三）终止TMT50A份额和TMT50B份额的上市交易及国泰TMT50份额的场内申购赎回

本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理TMT50A份额和TMT50B份额的终止上市，国泰TMT50份额终止场内申购赎回等相关业务。

（四）转型后基金的基本情况

1.基金的类别

ETF联接基金。

2.基金的运作方式

契约型开放式

3.标的指数

中证计算机主题指数。

中证计算机主题指数由中证指数有限公司编制和发布。如果指数发布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基金业绩比较基准。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。

4.目标ETF

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金。

（五）转型后基金的额类别设置

本基金将基金份额分为不同的类别。其中：

在投资人申购基金份额时收取申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为A类基金份额。

在投资人申购基金份额时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

国泰TMT50份额、TMT50A份额与TMT50B份额最终将转换为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A类基金份额。

本基金开放申购后，投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

（六）转型后基金的投资

1.投资目标

通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

2.投资范围

本基金主要投资于目标ETF、标的指数成分股、备选成分股。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分股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货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。

在法律法规允许的情况下，在履行适当程序后，本基金可以参与融资和转融通证券出借。

基金投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。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，本基金持有的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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

3.投资策略

本基金为目标ETF的联接基金，以目标ETF作为主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标ETF，本基金并不参与目标ETF的管理。

（1）资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF、标的指数成分股、备选成分股，其中，投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金少量投资于非标的指数成分股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货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。

本基金根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（2）目标ETF投资策略

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。

（3）股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，主要采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。

（4）债券投资策略

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，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。

（5）资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（6）股指期货投资策略

本基金将遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

（7）融资与转融通证券出借投资策略

本基金在参与融资与转融通证券出借业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模与转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑融资与转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性等特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。

4.投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；

2）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，本基金持有的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；

3）本基金投资于资产支持证券的投资限制如下：

①本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

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20%；

③本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

④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%；

⑤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。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3个月内予以全部卖出；

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

5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购期限后不得展期；

6）本基金与私募类证券投资基金、货币市场基金、由基金管理人或基金管理人的子公司或分公司管理的资产管理计划或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基金合同约定的投资范围保持一致；

7）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

8）本基金投资于股指期货，遵守以下投资限制：

①本基金在任何交易日日终，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%；在任何交易日日终，持有的买入股指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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

②本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

③本基金开始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；

④本基金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%；

9）本基主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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；

10）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

11）本基金参与转融通证券出借交易的，每个交易日日终，本基金参与转融通证券出借交易的资产净值不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

12）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

因证券/期货市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第1）项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，除上述第1）、2）、6）、9）项和第3）项第③目另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制，目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在相关证券可交易的10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）向其基金管理人、基金托管人出资；

5）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；

6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的限制为准。

（3）关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

5.业绩比较基准

中证计算机主题指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

如果中证指数有限公司变更或停止中证计算机主题指数的编制及发布，或者中证计算机主题指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致中证计算机主题指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，在按照监管部门要求履行适当程序后有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准，而无需召开基金份额持有人大会审议。

6.风险收益特征

本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型指数基金，因此本基金属于较高预期风险和预期较高的证券投资基金品种，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

（七）摆动定价机制

摆动定价机制指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

（八）转型后基金的费用

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）C类基金份额的销售服务费；

（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

（6）基金份额持有人大会费用；

（7）基金的证券/期货交易费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）基金的开户费用、账户维护费用；

（10）基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申赎费用等）；

（11）按照国家有关规定可在基金财产中列支的其他费用。

2.管理费

本基金基金财产中投资于目标ETF部分的基金资产净值不收取管理费，本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.50%的年费率计提。

3.托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF部分的基金资产净值不收取托管费，本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.10%的年费率计提。

4.C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。

5.申购费

| A类基金份额 | 申购金额（M） | 申购费率 |
|---|---|---|
| | M＜50万元 | 1.00% |
| | 50万元≤M＜100万元 | 0.60% |
| | M≥100万元 | 按笔收取，1,000.00元/笔 |
| C类基金份额 | 无 | |

6.赎回费

| A类基金份额 | 持有时间（N） | 赎回费率 |
|---|---|---|
| | N（7日 | 1.50% |
| | 7日≤N（30日 | 0.75% |
| | 30日≤N（180日 | 0.50% |
| | N≥180日 | 0.00% |
| C类基金份额 | 持有时间（N） | 赎回费率 |
| | N（7日 | 1.50% |
| | 7日≤N（30日 | 0.10% |
| | N≥30日 | 0.00% |

本基金A类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30日但少于90日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于或等于90日但少于180日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于或等于180日的基金份额持有人不收取赎回费。赎回费中未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金C类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30日的基金份额持有人不收取赎回费。

（九）转型后基金的收益与分配

1.基金收益分配原则

（1）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（2）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数至少为一次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（3）本基金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按除权日的基金份额净值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；

（4）基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（5）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2.收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止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。

3.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日内市规定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

4.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。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。

（十）授权基金管理人修订《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金托管协议》、《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金招募说明书》等法律文件

除上述转型方案要点外，考虑到目国深证TMT50指数分级基金合同生效以来，相关法律法规及监管规则的不断调整以及市场环境的不断变化，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的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的产品特征修订《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金基金合同》，修订后的内容请见附件《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基金合同》，并相应修订《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金托管协议》、《国泰深证TMT50指数分级证券投资基金招募说明书》。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人对上述文件进行修订。

（十一）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，国泰TMT50指数分级将安排不少于20个工作日的选择期（具体以基金管理人公告为准），选择期期间，基金份额持有人可以选择卖出TMT50A份额、TMT50B份额或者赎回国泰TMT50份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的国泰TMT50份额、TMT50A份额与TMT50B份额将按转换为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A类基金份额。具体安排请见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回的，约适用国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

由于国泰TMT50指数分级在选择期期间需应对赎回、转换转出等情况，基金份额持有人同意在选择期期间国泰TMT50指数分级基金合同中约定的投资组合比例限制等条款，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人测此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出、配对转换或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十二）基金份额折算与转换的相关安排

转型选择期届满的次一工作日为分额转换基准日，也是TMT50A份额、TMT50B份额终止运作日。基金管理人在分额转换基准日将国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的各类基金份额总转换成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A类基金份额，注册登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。在份额转换基准日，国泰TMT50份额的场内份额、TMT50A份额、TMT50B份额将最终转换为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A类基金份额的场内份额，国泰TMT50份额的场外份额将最终转换为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A类基金份额的场外份额。

TMT50A份额（或TMT50B份额）的转换比例=份额转换基准日TMT50A份额（或TMT50B份额）的基金份额净值/份额转换基准日国泰TMT50份额的基金份额净值

TMT50A份额（或TMT50B份额）基金份额持有人持有的转换前来的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A类基金份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前TMT50A份额（或TMT50B份额）的份额数×TMT50A份额（或TMT50B份额）的转换比例

TMT50A份额（或TMT50B份额）基金份额持有人持有的转换而来的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A类基金份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），取零头部分余额计入基金财产