

国泰海通中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 07 月 15 日

送出日期：2026 年 07 月 16 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

|         |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                             |
|---------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 基金简称    | 国泰海通中证红利低波动 ETF  | 基金代码                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 560730                      |
| 基金管理人   | 上海国泰海通证券资产管理有限公司 | 基金托管人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 兴业银行股份有限公司                  |
| 基金合同生效日 | 2026 年 06 月 30 日 | 上市交易所及上市日期                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 上海证券交易所<br>2026 年 07 月 16 日 |
| 基金类型    | 股票型              | 交易币种                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 人民币                         |
| 运作方式    | 普通开放式            | 开放频率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 每个开放日                       |
| 其他      | 丁仲元              | 开始担任本基金基金经理的日期                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 2026 年 06 月 30 日            |
|         |                  | 证券从业日期                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 2021 年 07 月 14 日            |
|         |                  | 1、本基金场内投资采用证券公司交易和结算模式。<br>2、未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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，基金合同终止。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。<br>3、场内简称：红利 GTHT |                             |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

（敬请投资者仔细阅读《国泰海通中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。）

|      |                                 |
|------|---------------------------------|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。      |
| 投资范围 | 本基金的标的指数为：中证红利低波动指数及其未来可能发生的变更。 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金的投资范围包括标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（包括创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）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>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，本基金可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。</p> <p>本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，法律法规另有规定的除外。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可参与股指期货、国债期货、股票期权交易。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。</p>                                                                 |
| 业绩比较基准 | <p>中证红利低波动指数收益率</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

暂不适用

## （三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

暂不适用

## 三、投资本基金涉及的费用

### （一）基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

- 1、投资者在申购或赎回时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.30% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。
- 2、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

### （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别  | 收费方式/年费率或金额                                                                                                                                              | 收取方        |
|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 管理费   | 0.50%                                                                                                                                                    | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%                                                                                                                                                    | 基金托管人      |
| 审计费用  | 38,000.00                                                                                                                                                | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 70,000.00                                                                                                                                                | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金相关账户的开户及维护费用；基金上市初费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；收益分配中发生的费用；按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 | 相关服务机构     |

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险、税收风险及其他风险等。本基金特有风险包括：（1）指数化投资的风险，包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数成份股主要集中于中证红利低波动指数成份公司的集中风险、标的指数波动的风险、标的指数发布时间较短的风险、标的指数编制方案带来的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数值计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险等；（2）ETF运作的风险，包括可接受股票认购导致的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、组合证券停牌的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、深市成份证券申赎处理规则带来的风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置不合理的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险、退市风险等；（3）投资特定品种（包括股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品、资产支持证券、存托凭证等）的特有风险；（4）参与转融通证券出借业务的风险等。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。投资本基金可能面临的一般风险及特有风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金场内投资采用证券公司交易和结算模式，即本基金参与证券交易所场内投资部分将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行场内交易，并由选定的证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易和结算模式可能增加本基金投资运作过程中的信息系统风险、操作风险、交易指令传输和资金使用效率降低的风险、无法完成当日估值的风险、交易结算风险、基金投资非公开信息泄露的风险等。

根据本基金现行适用的清算交收和申赎处理规则，当日竞价买入的基金份额，当日可以赎回；当日申购的基金份额，当日可以竞价卖出，次一交易日可以赎回。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所和登记机构关于ETF的相关业务规则及其不时的更新，确保具备相关专业知识、清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额等相关的交收方式及业务规则已经认可。

### （二）重要提示

中国证监会对国泰海通中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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本基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站，网址：[www.gthtzg.com](http://www.gthtzg.com)，客服电话：95521

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

## 六、其他情况说明

关于争议的处理：各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商、调解未能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际仲裁中心，按照上海国际仲裁中心届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。