

国泰基金管理有限公司关于变更上证 10 年期国债交易型开放式指数 证券投资基金 IOPV 计算方案并修订基金合同的公告

为更好地满足投资者的需求,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《上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(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”或“基金管理人”)经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,本公司决定自 2021 年 7 月 19 日起,变更上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金份额参考净值(IOPV)计算方案并对《基金合同》相关内容进行修订。具体事项公告如下:

一、本基金 IOPV 计算方案的变更

本基金目前的 IOPV 计算方案为: T 日 IOPV 为 T-1 日基金份额净值。

计算方案变更后, T 日 IOPV 的计算公式为:

$$IOPV = \left\{ \sum_{i=1}^n (P_i * Shares_i) * 10 + AI + ECC \right\} / 10000$$

其中:

P_i : T 日申购赎回清单中第 i 只成分券的实时价格,取净价

$Shares_i$: T 日申购赎回清单中第 i 只成分券的数量(单位:手)

AI: T 日申购赎回清单中所有成分券在 T 日的应计利息总和

ECC: T 日申购赎回清单中的预估现金部分(Estimated Cash Component)

本基金基金份额参考净值(IOPV)由基金管理人或基金管理人委托的机构计算,并在上海证券交易所的交易时间向市场发布,仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

二、《基金合同》的修订

根据变更后的 IOPV 计算方案,本公司将对《基金合同》进行以下修订:

《基金合同》“第七部分 基金份额的上市交易”,其中“四、基金份额参考净值的计算与公告”:

原文为:

“基金管理人可以计算或委托中证指数有限公司计算并发布基金份额参考净值(IOPV),供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。具体的计算方法见招募说明书。

基金管理人可以调整基金份额参考净值计算方法，并予以公告。”

修订为：

“本基金基金份额参考净值（IOPV）的计算及公告方式详见招募说明书。

基金管理人可以调整基金份额参考净值计算方法，并予以公告。”

三、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的机构计算，并在上海证券交易所的交易时间向市场发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

本公司将根据修订后的《基金合同》，相应修订本基金的《招募说明书》等其他法律文件。本次修订对基金份额持有人无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

本公告仅对上述变更 IOPV 计算方案的有关事项予以说明，投资人欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读刊登于基金管理人网站（www.gtfund.com）的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，以及相关业务公告。投资人可访问本公司网站（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。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2021 年 7 月 16 日