

国泰基金管理有限公司关于变更上证 5 年期国债交易型开放式指数 证券投资基金 IOPV 计算方案的提示性公告

国泰基金管理有限公司已于 2021 年 7 月 16 日发布了《国泰基金管理有限公司关于变更上证 5 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》，具体关于上证 5 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）计算方案的变更事项详见上述公告，现提示如下：

一、本基金 IOPV 计算方案的变更

2021 年 7 月 19 日前，本基金的 IOPV 计算方案为：T 日 IOPV 为 T-1 日基金份额净值。

2021 年 7 月 19 日起，本基金的 IOPV 计算方案变更，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、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。

本公告仅对上述变更 IOPV 计算方案的有关事项予以提示说明，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19日