

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

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5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:

$$IOPV = \frac{\sum_{i=1}^n (P_i \times \text{Times}_i) + T_0 + A + B}{C} \times 1000$$

其中:

- P_i: T日申赎清单中第i类成份证券的参考净值,以中证
- Times_i: T日申赎清单中第i类成份证券的参考数量(申购、赎回)
- A: T日申购清单中所有成份证券T日的估计净买入额
- B: T日赎回清单中所有成份证券T日的估计净卖出额
- C: T日申购赎回清单中所有成份证券的参考数量(Authorized 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》“七、基金份额的交易”,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。具体的计算方法与发布情况届时由基金管理人予以公告。”

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