

# 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：

$$IOPV = \frac{\sum_{i=1}^n (Q_i \times P_{net,i}) + ECC}{n \times 1.0500}$$

其中：

T日申购赎回清单中第i只成分券的实时价格，取净价

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](http://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](http://www.gtfund.com)）或拨打全国免长途话费的客户服务热线（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