

国泰基金管理有限公司关于开放上证 10 年期国债交易型开放式指数 证券投资基金场外份额日常申购、赎回业务的公告

公告送出日期：2018 年 11 月 15 日

1 公告基本信息

基金名称	上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证 10 年期国债 ETF（场内简称：十年国债）
基金主代码	511260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日
基金管理人名称	国泰基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	国泰基金管理有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《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》、《上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2018 年 11 月 16 日
赎回起始日	2018 年 11 月 16 日

注：本基金已于 2017 年 8 月 24 日开放场内份额的申购与赎回业务。

2 日常申购、赎回业务的办理时间

投资人在开放日办理场外份额的申购和赎回，办理时间为上海证券交易所的正常交易日的全部或部分交易时间，投资人办理场外份额的截止时间为开放日的 15:00，基金管理人可根据实际情况加以调整，具体办理时间以基金管理人届时发布的相关公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停场内份额申购、赎回时除外。

投资人在开放时间以外提交的场外份额申购、赎回等交易申请，且注册登记机构确认接受的，场外份额申购、赎回价格为下一开放日场外份额申购、赎回的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况或根据业务需要，基金管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在

实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

本基金场外份额申购、赎回的开放时间与场内份额申购、赎回的开放时间存在差异，投资人应关注基金管理人发布的有关公告并注意其提交申购赎回申请的时间。

3 申购和赎回的数量限制

投资人申购本基金场外份额的，每次申购的单笔最低金额为人民币 500 万元，每次赎回的单笔最低份额为 5 万份。

投资人可将全部或部分场外份额赎回。单笔赎回不得少于 5 万份，如该账户在该场外销售机构保留的场外份额余额不足 5 万份时，则赎回时必须一次性赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

4 申购与赎回的原则

①“未知价”原则，即场外份额的申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

②“金额申购、份额赎回”原则，即场外份额申购以金额申请，赎回以份额申请；

③场外份额的申购对价、赎回对价为现金；

④场外份额赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；

⑤条件许可情况下，场外份额既可在不同场外的销售机构之间办理系统内转托管，也可跨系统转托管为场内份额；

⑥当日的场外份额申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

⑦场外份额申购、赎回应遵守国泰基金管理有限公司的相关业务规则。

基金管理人可根据基金运作的实际情况，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下调整上述原则，或依据注册登记机构相关规则及其变更调整上述规则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒介上予以公告。

5 申购与赎回的程序

5.1 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据基金管理人规定的程序，在开放日的开放时间提出场外份额申购或赎回的申请。

投资人在提交场外份额申购申请时须全额交付申购款项,并在规定的截止时间前划至场外份额销售机构指定的账户上,否则所提交的申购申请无效;投资人在提交场外份额赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的赎回申请无效。

5.2 申购和赎回申请的确认

基金管理人在场外份额申购、赎回开放日截止时间前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整,并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5.3 申购和赎回的款项支付

投资人申购场外份额时,必须在规定的截止时间内全额交付申购款项。投资人在规定的截止时间内交付申购款项时,申购成立;注册登记机构确认基金份额时,申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立,申购款项将退回投资人账户,基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

基金份额持有人递交场外份额赎回申请时,赎回成立;注册登记机构确认赎回时,赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生场外份额巨额赎回或其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

5.4 申购和赎回的注册登记

正常情况下,投资人T日申购基金成功后,注册登记机构在T+1日为投资人增加权益并办理注册登记手续,投资人自T+1日起有权申请赎回该部分基金份额,或在条件许可情况下申请办理跨系统转托管。

基金份额持有人T日赎回基金成功后,正常情况下,注册登记机构在T+1日为基金份额持有人办理扣除权益的注册登记手续。

在法律法规允许的范围内,注册登记机构可以对上述注册登记办理时间进行调整,基金管理人最迟于开始实施前2个工作日在指定媒介上公告。

6 申购和赎回的价格、费用及其用途

6.1 投资人在申购或赎回场外份额时，基金管理人可参考当时市场的交易佣金等相关交易成本水平，收取一定的申购冲击成本和/或赎回冲击成本并归入基金资产，确保覆盖场外现金申购、赎回引起的证券交易费用。申购冲击成本和/或赎回冲击成本仅对场外份额收取。申购冲击成本/赎回冲击成本费率最高不超过百万分之一。当前场外份额的申购、赎回冲击成本费率如下：

申购冲击成本费率：百万分之一

赎回冲击成本费率：百万分之一

本基金场外份额的申购冲击成本由申购人承担，赎回冲击成本由赎回人承担，申购冲击成本与赎回冲击成本均全部归入基金财产。

基金管理人可根据市场情况调整申购冲击成本/赎回冲击成本费率，经公告后实施。

6.2 申购场外份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，份额计算结果按四舍五入方法保留至小数点后两位，申购冲击成本以人民币元为单位，四舍五入保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

6.3 赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回冲击成本（如有），赎回金额、赎回冲击成本的单位为人民币元，四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

6.4 申购份额、赎回金额的计算方式

6.4.1 申购份额的计算

本基金的申购金额中包括申购冲击成本和净申购金额，其通用的计算方式为：

净申购金额=申购金额÷（1+申购冲击成本费率）

申购冲击成本=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额÷T日基金份额净值

6.4.2 基金赎回金额的计算

赎回冲击成本=赎回份额×T日基金份额净值×赎回冲击成本费率

赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回冲击成本

6.5 由于场内份额与场外份额申购、赎回方式上的差异，本基金投资人依据基金份额净值所支付、取得的场外份额申购、赎回现金对价，与场内份额申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资人可自行判断并选择适合自身的申购、赎回场所、方式。

7 基金销售机构

国泰基金管理有限公司直销柜台

地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

传真：021-31081861 网址：www.gtfund.com

8 其他重要提示

①本基金场外现金申购所得的基金份额暂不办理跨系统转托管业务，开放时间另行公告。

②本公告仅对本基金开放场外日常申购、赎回业务有关的事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读《基金合同》和《招募说明书》。

③投资者可通过以下途径咨询有关详情：

国泰基金管理有限公司

网址：www.gtfund.com

客服电话：400-888-8688（免长途通话费用）、021-31089000

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018 年 11 月 15 日