

上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金 基金份额发售公告

重要提示

1、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”）的募集已获中国证监会证监许可【2016】139 号文准予注册，并依据中国证监会机构部函【2017】1590 号文（《关于上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》）进行募集。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金是交易型开放式债券型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和国泰基金管理有限公司。本基金认购份额的登记结算由中国证券登记结算有限责任公司负责办理；本基金基金份额在上海证券交易所场内上市交易以及申购、赎回等相关业务的登记结算由中国证券登记结算有限责任公司负责办理；本基金的场外申购、赎回等相关业务的登记结算由国泰基金管理有限公司负责办理。

4、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、本基金自 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 7 月 28 日进行发售。本基金的投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购 3 种方式。其中，网下现金认购的日期为 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 7 月 28 日，网上现金认购的日期为 2017 年 7 月 26 日至 2017 年 7 月 28 日，网下债券认购的日期为 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 7 月 28 日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本基金可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。

6、本基金的网上现金认购通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

7、本基金的网下现金认购通过基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构进行，网

下债券认购通过基金管理人指定的发售代理机构进行。发售代理机构请见基金管理人发布的关于调整发售代理机构的相关公告。各销售机构的办理地点、办理日期、办理时间和办理程序等事项参照各销售机构的具体规定。

8、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

9、本基金不收取认购费用。

10、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。

网下现金认购以基金份额申请。投资人单笔认购须为 1000 份或其整数倍。

网下债券认购以单只债券手数申报，用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券（详见本公告“八、本基金网下债券认购清单”）。单只债券最低认购申报数为 1 手（人民币 1000 元面值债券为 1 手），超过 1 手部分须为 1 手的整数倍。

投资人可以多次提交认购申请。对于可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形，基金管理人有权采取控制措施，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

11、投资人在认购本基金时，需按基金管理人或发售代理机构的规定，备足认购资金或债券，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。网下债券认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

12、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，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。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读刊登在 2017 年 7 月 12 日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《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》。本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（www.gtfund.com），投资人亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集相关事宜。

14、募集期内，本基金还有可能新增或者变更发售代理机构，敬请留意近期本公司及各发售代理机构的公告，或拨打本公司及各发售代理机构客户服务电话咨询。

15、投资人可拨打本公司客户服务电话（400-888-8688）、021-31089000 或各发售代理机构咨询电话了解认购事宜。

16、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商，报上海证券交易所等有关部门认可后，予以公告。本基金上市后，指定交易未在申购赎回代理券商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖，如投资人需进行本基金的申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

17、基金管理人可综合各种情况对销售安排及募集期其他相关事项做适当调整。

18、风险提示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型的基金，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

在投资本基金前，投资人应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。特定风险包括：指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、本基金场内场外份额申购赎回对价方式不同的风险、基金场内份额赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、流动性风险、第三方机构服务的风险等。

根据基金合同的相关规定，本基金每日可设定申购份额、赎回份额上限，对于超出设定份额上限的申购、赎回申请，基金管理人有权予以拒绝。

本基金采用优化抽样复制法跟踪标的指数，但由于基金费用、交易成本、组合持仓与标的指数成份券之间存在差异、基金估值方法与指数成份券取价规则之间存在差异等因素，可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。

本基金为债券基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于股票基金和

混合基金，属于较低预期收益风险水平的投资品种。

投资人认购本基金时需具有上海证券账户，证券账户是指上海证券交易所 A 股账户（简称“上海 A 股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（简称“证券投资基金账户”）。证券投资基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立和使用上海 A 股账户。

投资人应当认真阅读本基金“基金合同”、“招募说明书”等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资人按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值出现损失的风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。

19、本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

（一）基金名称和基金代码

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

基金场内简称：十年国债

认购代码：511263

一级市场申赎代码：511261

二级市场交易代码：511260

（二）基金类别

债券型证券投资基金。

（三）基金运作方式

交易型开放式。

（四）存续期限

不定期。

(五) 基金份额发售面值及认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元。

(六) 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

(七) 募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(八) 基金份额发售机构

1、发售协调人

招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客服电话：95565、4008881111

公司网站：www.newone.com.cn

2、网下现金发售直销机构

国泰基金管理有限公司。

3、网下现金和网下债券发售代理机构

发售代理机构请见基金管理人发布的关于调整发售代理机构的相关公告。

4、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

(九) 发售时间安排与基金合同生效

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。本基金自 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 7 月 28 日进行发售。投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购 3 种方式。其中，网下现金认购的日期为 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 7 月 28

日，网上现金认购的日期为 2017 年 7 月 26 日至 2017 年 7 月 28 日，网下债券认购的日期为 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 7 月 28 日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本基金可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的债券由注册登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值）且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。网下债券认购所募集的债券由注册登记机构予以冻结。

若 3 个月的募集期满，本基金仍未达到基金备案条件，基金管理人应当以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券，注册登记机构应予以解冻，注册登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

（十）募集资金利息与募集债券权益的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额；投资人以债券认购的，认购债券由登记机构予以冻结，冻结期间产生的孳息归投资人所有。

（十一）认购费用

本基金不收取认购费用。

（十二）网上现金认购

1、认购金额的计算

通过基金管理人指定的发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请。本基金网上现金认购的认购金额的计算如下：

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额}$$

例：某投资人到某发售代理机构网点认购 1,000 份本基金，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 1,000 = 1,000.00 \text{ 元}$$

即投资人需准备 1,000.00 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

2、认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资人可以多次认购。

3、认购申请

投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

4、认购确认

在募集期结束后 3 个工作日之后，投资人应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（十三）网下现金认购

1、认购金额的计算

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请。通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算如下：

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} + \text{认购金额产生的利息} / \text{认购价格}$$

例：某投资人到基金管理人直销柜台认购 100,000 份基金份额，假定认购金额产生的利息为 10.00 元，则需准备的资金金额及总认购份额计算如下：

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 = 100,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{净认购份额} = 100,000 + 10.00 / 1.00 = 100,010 \text{ 份}$$

即投资人若通过基金管理人认购本基金 100,000 份，需准备 100,000.00 元资金，假定该笔认购金额产生利息 10.00 元，则投资人可得到 100,010 份本基金基金份额。

（2）通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进

行网上现金认购的认购金额的计算。

2、认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资人单笔认购须为 1000 份或其整数倍。投资人在募集期内可多次认购。

3、认购手续

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

4、认购确认

在募集期结束后 3 个工作日之后，投资人应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（十四）网下债券认购

通过基金管理人指定的发售代理机构以债券进行认购。网下债券认购以单只债券手数申报。

1、认购限额：网下债券认购以单只债券手数申报，用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券（详见本公告“八、本基金网下债券认购清单”）。单只债券最低认购申报数为 1 手（人民币 1000 元面值债券为 1 手），超过 1 手部分须为 1 手的整数倍。

2、认购手续

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购债券。网下债券认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

3、特殊情形

（1）已公告的将被调出标的指数的成份券不得用于认购本基金。

（2）限制个券认购规模：基金管理人可根据网下债券认购日前 3 个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。

（3）临时拒绝个券认购：对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

4、认购份额的计算公式

$$\text{认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第}i\text{只债券的价值} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中：

(1) i 代表投资人提交认购申请的第 i 只债券, n 代表投资人提交的债券总只数。如投资人仅提交了 1 只债券的申请, 则 $n=1$ 。

(2) T 日为网下债券认购期最后一日。

(3) D 日为债券过户日。

(4) “第 i 只债券的价值” = 第 i 只债券在 T 日的估值价 (注: 如无特别所指, 则为估值净价) + ($D-1$) 日应计利息。

若某一债券在 T 日至登记机构进行债券过户日 (D 日) 的冻结期间发生利息兑付等权益变动情况, 则由于投资人获得了相应的权益, 基金管理人将相应调整应计利息的计算。

(5) “有效认购数量” 是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的债券数量。其中,

1) 若基金管理人在网下债券认购日前公告了限制认购规模的个券名单, 则对于经公告限制认购规模的个券, 基金管理人可确认的认购数量上限的确认方法在届时公告中列示。

2) 若某一债券在网下债券认购日至注册登记机构进行债券过户日 (D 日) 的冻结期间发生司法执行, 则基金管理人将根据注册登记机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

二、发售方式及相关规定

(一) 投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购 3 种方式。

(二) 本基金直销机构接受以基金份额申请的、单笔认购为 1,000 份或其整数倍的网下现金认购申请。

(三) 发售代理机构接受网上现金认购申请、网下现金认购申请和网下债券认购申请。其中, 网上现金认购以基金份额申请, 单一账户每笔认购份额为 1,000 份或其整数倍且最高不得超过 99,999,000 份;

网下现金认购以基金份额申请, 单笔认购须为 1000 份或其整数倍;

网下债券认购以单只债券手数申报, 单只债券最低认购申报数为 1 手 (人民币 1000 元面值债券为 1 手), 超过 1 手部分须为 1 手的整数倍, 用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券 (详见本公告“八、本基金网下债券认购清单”)。

(四) 募集期内投资人可以多次认购本基金。对于可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过 50%, 或者变相规避 50% 集中度的情形, 基金管理人有权采取控制措施, 法律法规或中国证监会另有规定的除外。

三、投资者开户

投资人认购本基金时需具有证券账户，证券账户是指上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“证券投资基金账户”）。

已有上海 A 股账户或证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无上海 A 股账户或证券投资基金账户的投资人，需在认购前持身份证明文件到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海 A 股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海 A 股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

1、如投资人需新开立证券账户，则应注意：

（1）证券投资基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立和使用上海 A 股账户。

（2）开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

2、如投资人已开立证券账户，则应注意：

（1）如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

（2）投资人办理指定交易或转指定交易的当日无法进行认购，建议投资人在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（3）使用专用席位的机构投资者无需办理指定交易。

四、本基金的认购程序

（一）网上现金认购的程序

1、业务办理时间：

2017 年 7 月 26 日至 2017 年 7 月 28 日的上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、认购手续：

（1）开立上海 A 股账户或证券投资基金账户，办理指定交易在发售代理机构。

（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资人可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以上海证券交易所和发售代理机构的相关规定为准。

(二) 网下现金认购的程序

1、直销机构

(1) 业务办理时间：基金发售日的 9:30 至 16:00 (周六、周日及法定节假日不办理)。

(2) 个人投资者办理基金认购申请时须提交下列材料：

- 1) 本人有效身份证件原件及复印件；
- 2) 上海 A 股账户或证券投资基金账户原件及复印件；
- 3) 加盖银行受理章的银行付款凭证回单原件及复印件；
- 4) 填妥的基金网下现金认购业务申请表；
- 5) 个人投资者风险测评问卷及个人税收居民身份声明文件（未填写者提交）；
- 6) 其它根据监管要求提交的相关材料。

(3) 机构投资者办理基金认购申请时须提交下列材料：

1) 营业执照（或登记注册书）、组织机构代码证、税务登记证三证的副本原件及加盖单位公章的复印件；

- 2) 上海 A 股账户或证券投资基金账户原件及复印件；
- 3) 法定代表人签章并加盖单位公章的《基金业务授权委托书》；
- 4) 机构投资者业务经办人员身份证明文件原件及复印件；
- 5) 加盖银行受理章的银行付款凭证回单原件及复印件；
- 6) 填妥的基金网下现金认购业务申请表；
- 7) 机构投资者风险测评问卷及机构税收身份声明文件（未填写者提交）；
- 8) 其它根据监管要求、银行间交易开户等交易场所要求提交的相关材料。

(4) 认购资金的划拨：

投资人办理认购前应将足额资金通过银行汇入下列任一银行账户：

a、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：31001520313056005017

开户银行：中国建设银行上海市浦东分行

人行实时支付系统号：105290028005

全国联行号：52364

b、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：436459213754

开户银行：中国银行上海市中银大厦支行

人行实时支付系统号：104290003791

全国联行号：40379

c、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：03492300040004223

开户银行：中国农业银行上海市卢湾支行

人行实时支付系统号：103290028025

全国联行号：092802

d、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：1001202919025802010

开户银行：中国工商银行上海市分行营业部

人行实时支付系统号：102290020294

全国联行号：20304005

e、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：096819216089155910001

开户银行：招商银行上海市分行营业部

人行实时支付系统号：308290003020

全国联行号：82051

f、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：0763922329500177

开户银行：上海浦东发展银行上海市分行营业部

人行实时支付系统号：310290000152

g、账户名称：国泰基金管理有限公司直销专户

账号：310069260018800003927

开户银行：交通银行上海车墩支行

人行实时支付系统号：301290051435

(5) 汇款时，投资人须注意以下事项：

1) 投资人应在“汇款人”栏中填写其上海 A 股账户或证券投资基金账户登记的名称；

2) 汇款时应提示银行柜台人员准确完整地传递汇款信息, 包括汇款人和用途栏内容;

3) 为确保投资人资金及时准确入账, 建议投资人将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至本公司直销柜台。

4) 投资人应在认购申请当日 16: 00 之前将资金足额汇入本公司直销账户。

2、发售代理机构

(1) 业务办理时间:

基金发售日的具体业务办理时间以各发售代理机构的规定为准。

(2) 认购手续:

1) 开立上海 A 股账户或证券投资基金账户, 办理指定交易在发售代理机构。

2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3) 投资人可通过填写认购委托单, 同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认, 认购资金即被冻结。

具体认购手续以各发售代理机构的规定为准。

(三) 网下债券认购的程序

1、业务办理时间:

基金发售日的具体业务办理时间以各发售代理机构的规定为准。

2、认购手续:

(1) 开立上海 A 股账户。

(2) 在上海 A 股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份券或已公告的备选成份券。

(3) 投资人填写认购委托单。申报一经确认, 认购债券即被冻结。

具体认购手续以各发售代理机构的规定为准。

五、清算与交割

(一) 基金募集期间募集的资金存入专门账户, 在基金募集行为结束前, 任何人不得动用; 募集的债券由注册登记机构予以冻结, 于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息, 将折算为基金份额归投资人所有, 其中利息转份额以基金管理人的记录为准; 网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息, 计入基金财产, 不折算为投资人基金份额; 投资人以债券认购的, 认购债券由登记机构予以冻结, 冻结期间产生的孳息归投资人所有。

(二) 本基金权益登记由注册登记机构在基金发售结束后完成过户登记。

六、基金的验资与基金合同生效

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值）且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

本基金募集失败时，基金管理人应当以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券，注册登记机构应予以解冻，注册登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

七、本次发售当事人或中介机构

(一) 基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

成立时间：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：021-31089000，400-888-8688

(二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(三) 销售机构

1、发售协调人

招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：霍达

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客服电话：95565、4008888111

公司网站：www.newone.com.cn

2、网下现金发售直销机构

机构名称	机构信息	
国泰基金 管理有限公司直 销柜台	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号 上海环球金融中心39楼	
	办公地址：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

3、网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构

发售代理机构请见基金管理人发布的关于调整发售代理机构的相关公告。

4、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

5、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

(四) 注册登记机构

1、场内份额注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

2、场外份额注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

法定代表人：陈勇胜

电话：400-888-8688，021-31089000

传真：021-31081800

联系人：辛怡

（五）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

（六）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：李一

经办注册会计师：许康玮、李一

八、本基金网下债券认购清单

本基金募集期间，网下债券认购名单如下表所示。基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

网下债券认购名单

债券代码	债券简称	债券代码	债券简称
010504	05 国债(4)	019523	15 国债 23
010609	06 国债(09)	019532	16 国债 04
010713	07 国债(13)	019538	16 国债 10
019911	09 国债 11	019545	16 国债 17
019412	14 国债 12	019551	16 国债 23
019429	14 国债 29	019558	17 国债 04
019505	15 国债 05	019560	17 国债 06
019516	15 国债 16	019564	17 国债 10

国泰基金管理有限公司

2017年7月12日