

国泰基金管理有限公司关于调整上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金现金替代比例、现金替代金额计算公式的公告

根据上海证券交易所《关于调整 ETF 现金替代比例、现金替代金额计算公式的通知》（上证基字〔2012〕123 号），自 2013 年 1 月 28 日起，国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：510230，以下简称“本基金”）的现金替代比例、现金替代金额计算公式作相应调整。现将有关事项公告如下：

一、现金替代比例、现金替代金额计算公式调整

本基金现金替代比例、现金替代金额计算公式分别为：

$$\text{现金替代比例 (\%)} = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第} i \text{只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格} \times 100\%}{\text{申购基金份额} \times \text{基金份额参考净值 (IOPV)}}$$

现金替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 现金替代溢价比例)

其中，公式中涉及的基金份额参考净值（IOPV）及证券参考价格，目前分别定义为基金份额最新参考净值和该证券最新成交价。

为进一步降低 ETF 产品的风险，上海证券交易所自 2013 年 1 月 28 日起调整现金替代比例、现金替代金额公式中基金份额参考净值（IOPV）及该证券参考价格的定义。调整后，本基金现金替代比例公式中“基金份额参考净值（IOPV）”定义为“该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价”，“该证券参考价格”定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”。现金替代金额公式中，“该证券参考价格”定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”。

二、投资者可通过以下途径咨询详情：

- （1）国泰基金管理有限公司网站：<http://www.gtfund.com>；
- （2）国泰基金管理有限公司客户服务热线：400-888-8688，021-38569000。

三、风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于本公司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，并注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
二〇一三年一月二十四日