

---

## 关于以通讯方式召开中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于 2015 年 6 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）和国泰基金管理有限公司网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）发布了《关于以通讯方式召开中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

### 一、召开会议基本情况

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》等法律法规的规定和《中小板 300 成长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，中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中小成长 ETF”或“本基金”）的基金管理人国泰基金管理有限公司决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

#### 1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2015 年 6 月 29 日起至 2015 年 7 月 28 日 17:00 止（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）

#### 3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机关：北京市方正公证处

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场塔 3 办公楼 11 层 1113 室

公证员：王顺心、刘晓村

电话：（010）58073628

邮政编码：100044

请在信封表面注明：“中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、鉴于本基金和国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“联接基金”）的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金

---

份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。具体内容详见本公告相关规定。

5、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-888-8688，021-31089000 咨询。

## 二、会议审议事项

《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

## 三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2015 年 6 月 29 日，即 2015 年 6 月 29 日交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

在 2015 年 6 月 29 日交易时间结束后，在联接基金注册登记机构登记在册的联接基金基金份额持有人可直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

## 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

---

(4) 个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(5) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(6) 合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

(7) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2015 年 6 月 29 日起，至 2015 年 7 月 28 日 17:00 以前（以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本次持有人大会公证机关的办公地址，并在信封表面注明：“中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本次持有人大会公证机关的办公地址及联系方式如下：

公证机关：北京市方正公证处

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场塔 3 办公楼 11 层 1113 室

公证员：王顺心、刘晓村

电话：（010）58073628

邮政编码：100044

4、本部分内容同时适用于本基金基金份额持有人和联接基金基金份额持有人。基金管理人可接受本基金基金份额持有人和联接基金基金份额持有人的委托，以本基金基金份额持

---

有人或联接基金基金份额持有人代理人的身份参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

5、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-888-8688，021-31089000 咨询。

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

### 2、本基金基金份额持有人的表决权

基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

### 3、联接基金基金份额持有人的表决权

在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

### 4、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（2）表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（3）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

---

1) 送达时间不是同一天的, 以最后送达的填写有效的表决票为准, 先送达的表决票视为被撤回;

2) 送达时间为同一天的, 视为在同一表决票上作出了不同表决意见, 视为弃权表决票, 但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

3) 送达时间按如下原则确定: 专人送达的以实际递交时间为准, 邮寄的以基金管理人委托的公证机关收到的时间为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上;

2、《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》须经参加本次持有人大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过;

3、2015 年 6 月 29 日至 2015 年 7 月 28 日以通讯方式召开的联接基金的基金份额持有人大会决议通过, 是本基金份额持有人大会决议生效的前提。

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项, 本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案, 基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的, 从其规定。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定, 本次持有人大会需要有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开, 根据 2013 年 6 月 1 日生效的新修订的《基金法》, 本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时, 除非授权文件另有载明, 本次基金份额持有人大会授权期间本基金基金份额持有人和联接基金基金份额持有人作出的各类授权依然有效, 但如果授权方式发生变化或者本基金基金份额持有人、联接基金基金份额持有人重新作出授权, 则以最新方式或最新授权为准, 详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

---

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：国泰基金管理有限公司

持有人大会专线/客服电话：（400-888-8688 转 0）

会务常设联系人：辛怡

联系电话：021-31089000

传真：021-31081700

电子邮件：service@gtfund.com

网址：www.gtfund.com

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

3、公证机构：北京市方正公证处

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

## 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、若本次基金份额持有人大会审议的转型事宜获表决通过并生效，则本基金基金份额将转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之场内国泰新汽车份额，并按照 1：1 的基金份额配比自动分离为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金之新汽车 A 份额与新汽车 B 份额。

3、若 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 7 月 28 日以通讯方式召开的联接基金的基金份额持有人大会审议的事项未获表决通过，则无论本基金份额持有人大会决议事项是否通过，本基金份额持有人大会决议不生效。

4、本基金的首次停牌时间为《关于以通讯方式召开中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2015 年 6 月 29 日）开市起至当日 10：30 停牌，10：30 后恢复交易。本基金第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（为表决截止日的下一个工作日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日 10：30 止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

5、本次基金份额持有人大会召开期间，本基金的申购赎回业务基本按照若本基金全天停牌则相应暂停该日申购赎回业务的原则处理，具体将在本基金的申购赎回清单中标志，敬请投资人注意申购赎回清单的变化。若相关业务有其他变化，请详见基金管理人届时发布的

---

相关公告。敬请基金份额持有人关注本基金暂停赎回期间的流动性风险。

6、上述基金份额持有人大会有关公告可通过国泰基金管理有限公司网站查阅，投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-888-8688、021-31089000 咨询。

7、关于本次议案的说明见附件四《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案说明书》。

8、本通知的有关内容由国泰基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案说明书》

国泰基金管理有限公司

2015 年 7 月 8 日

---

附件一：

## 关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有 关事项的议案

中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，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《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中小成长 ETF”）实施转型并修改《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》，具体内容详见附件四《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案说明书》。

为实施中小成长 ETF 转型方案，提议授权基金管理人办理本次中小成长 ETF 转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充，并根据《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案说明书》相关内容对中小成长 ETF 实施转型。

以上议案，请予审议。

国泰基金管理有限公司

2015 年 6 月 29 日

附件二：

## 中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金

### 基金份额持有人大会表决票

（适用于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人）

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |    |        |    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--------|----|
| 基金份额持有人姓名或名称：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |    |        |    |
| 证件号码<br>(身份证件号/营业执照号)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    | 证券账户卡号 |    |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |    |        |    |
| 审议事项                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 同意 | 反对     | 弃权 |
| 关于中小板300成长交易型<br>开放式指数证券投资基金<br>转型有关事项的议案                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |    |        |    |
| 基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |        |    |
| 2015年      月      日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |        |    |
| 说明：<br>1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所填证券账户卡号下的全部基金份额(以权益登记日所登记的基金份额为准)的表决意见。<br>2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决；签字/盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，视为无效表决。<br>3、本表决票中“证件号码”，仅指基金份额持有人认购、申购或在证券交易所买卖中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。<br>4、本表决票中“证券账户卡号”，指持有中小成长 ETF 份额的证券账户卡卡号。同一基金份额持有人拥有多个此类证券账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写证券账户卡号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的中小成长 ETF 所有份额。 |    |        |    |

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

## 中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金

### 基金份额持有人大会表决票

(适用于国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额持有人)

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |         |    |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|---------|----|
| 联接基金份额持有人姓名或名称:                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |         |    |
| 证件号码<br>(身份证件号/营业执照号)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |    | 国泰基金账户号 |    |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |         |    |
| 审议事项                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 同意 | 反对      | 弃权 |
| 关于中小板300成长交易型<br>开放式指数证券投资基金<br>转型有关事项的议案                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |    |         |    |
| 联接基金份额持有人/受托人(代理人) 签字或盖章                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |    |         |    |
| 2015年      月      日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |    |         |    |
| <p>说明:</p> <p>1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。联接基金持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表联接基金份额持有人所填基金账户号的全部联接基金份额(以权益登记日所登记的基金份额为准)的表决意见。</p> <p>2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的,视为弃权表决;签字/盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达指定联系地址的,视为无效表决。</p> <p>3、本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人认购、申购国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。</p> <p>4、本表决票中“国泰基金账户号”,指持有国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的国泰基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类国泰基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写国泰基金账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的联接基金所有份额。</p> |    |         |    |

---

5、在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：

## 授权委托书

兹委托\_\_\_\_\_代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2015 年 7 月 28 日的以通讯方式召开的中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

个人委托人身份证件号码：\_\_\_\_\_

委托人证券账户卡号/基金账户号：\_\_\_\_\_

受托人（代理人）（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

个人受托人（代理人）身份证件号码：\_\_\_\_\_

委托日期：2015 年月日

附注：此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“个人委托人身份证件号码”，对于中小成长 ETF 持有人，指基金份额持有人认购、申购或在证券交易所买卖本基金时的证件号码或该证件号码的更新；对于联接基金持有人，指联接基金份额持有人认购、申购联接基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

2、本授权委托书中“证券账户卡号”，指中小成长 ETF 份额持有人持有中小成长 ETF 份额的证券账户卡卡号。同一基金份额持有人拥有多个此类证券账户且需要按照不同账户持有

---

基金份额分别行使表决权的，应当填写证券账户卡号，其他情况可不填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的中小成长 ETF 所有份额。

3、本授权委托书中“基金账户号”，指联接基金持有人持有联接基金的国泰基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类国泰基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写国泰基金账户号，其他情况可不填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的联接基金所有份额。

---

附件四：

## 《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案 说明书》

### 一、声明

1、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中小成长 ETF”）基金合同于 2012 年 3 月 15 日生效。为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，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《中小板 300 成长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”）等有关规定，本基金管理人（国泰基金管理有限公司）经与基金托管人（中国银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案。

2、本次中小成长 ETF 转型事宜属中小成长 ETF 原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

3、本次中小成长 ETF 转型方案需经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

4、基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。但是，若 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 7 月 28 日以通讯方式召开的国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金份额持有人大会审议的事项未获表决通过，则无论本基金份额持有人大会审议事项是否表决通过，本基金份额持有人大会审议的事项均不生效。

5、中国证监会对本次中小成长 ETF 变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或变更注册后基金的价值或投资人的收益做出实质性判断或保证。

### 二、中小成长 ETF 转型方案要点

中小成长 ETF 转型方案的主要内容如下：

#### （一）更名

---

基金名称由“中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金”更名为“国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金”（以下简称“新能源汽车指数分级基金”或“本基金”）。基金由“交易型开放式指数基金”变更为“指数分级基金”。

## （二）转型后基金的基本情况

### 1、基金名称

国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金

### 2、基金的类别

股票型证券投资基金

### 3、基金的运作方式

契约型开放式

### 4、基金的投资目标

本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 5、基金份额面值

本基金基金份额面值为人民币 1.00 元

### 6、基金存续期限

不定期

### 7、标的指数

本基金的标的指数为国证新能源汽车指数。

如果国证新能源汽车指数被停止编制及发布，或国证新能源汽车指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致国证新能源汽车指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更适合投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数。若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则基金管理人可以在取得基金托管人同意后变更标的指数，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。

### 8、基金份额转型折算与自动分离

---

《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》生效后，基金管理人可以安排特定申购期，特定申购期最长不超过 1 个月，在特定申购期结束后的第 2 个工作日登记在册的基金份额（包括投资人进行特定申购期申购的基金份额和由“中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金”转型而来的基金份额），在保持基金资产净值总额不变的前提下，将变更登记为基金份额净值为 1.0000 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整。同时，对于场内国泰新汽车份额（包括投资人进行特定申购期场内申购的基金份额和由“中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金”转型而来的基金份额）转型折算后的份额，将按照 1:1 的基金份额配比自动分离为新汽车 A 份额与新汽车 B 份额。

#### 9、基金份额的配对转换

本基金开放日常申购赎回后，投资人可在场内申购国泰新汽车份额，并可选择将场内的国泰新汽车份额按照 1:1 的基金份额配比分拆为新汽车 A 份额和新汽车 B 份额，投资人也可将其持有的新汽车 A 份额和新汽车 B 份额按照 1:1 的基金份额配比合并为场内的国泰新汽车份额。

投资人在场外申购的国泰新汽车份额不进行分拆，场外的国泰新汽车份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的国泰新汽车份额配对转换规则进行操作。

#### 10、基金份额的上市交易

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，场内的新汽车 A 份额和新汽车 B 份额将同时申请在深圳证券交易所上市交易。

### （三）转型后基金份额分级与净值计算规则

#### 1、基金份额结构

本基金的基金份额包括国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的基础份额（简称“国泰新汽车份额”）、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“新汽车 A 份额”）和国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“新汽车 B 份额”）。其中，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

#### 2、基金运作概要

（1）基金合同生效后，国泰新汽车份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，新汽车 A 份额与新汽车 B 份额可分别申请在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同。

---

(2) 新汽车 A 份额、新汽车 B 份额与国泰新汽车份额的资产合并投资运作。

(3) 基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的国泰新汽车份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务，即：基金份额持有人可将其场内的国泰新汽车份额，按照 1: 1 的基金份额配比，申请分拆为新汽车 A 份额和新汽车 B 份额；或基金份额持有人可将其持有的新汽车 A 份额和新汽车 B 份额，按照 1: 1 的基金份额配比，申请合并为国泰新汽车份额的场内份额。场外的国泰新汽车份额不进行份额配对转换。场外的国泰新汽车份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后，可按照场内的国泰新汽车份额配对转换原则进行操作。

(4) 基金合同生效后，本基金将按照基金合同规定，对国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额进行定期份额折算及不定期份额折算。除分级份额终止运作的份额折算外，基金份额折算后，本基金的运作方式不变，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的份额配比不变。

(5) 无论是定期份额折算，还是不定期份额折算，因折算而新增的场内国泰新汽车份额不进行自动分离。投资人可选择将上述折算产生的场内国泰新汽车份额按照 1: 1 的比例分拆为新汽车 A 份额和新汽车 B 份额。

### 3、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额净值计算原则

在新汽车 A 份额和新汽车 B 份额存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算原则对新汽车 A 份额和新汽车 B 份额分别进行基金份额净值计算。新汽车 A 份额为低预期风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金扣除掉国泰新汽车份额对应的净资产部分后剩余的净资产将优先确保所有新汽车 A 份额的本金及新汽车 A 份额的约定收益；新汽车 B 份额为高预期风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金扣除掉国泰新汽车份额对应的净资产部分后剩余的净资产在优先确保所有新汽车 A 份额的本金及约定收益后，将记为新汽车 B 份额的净资产。

在新汽车 A 份额和新汽车 B 份额存续期内，本基金新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额净值计算原则如下：

(1) 新汽车 A 份额约定年基准收益率为“一年期定期存款利率（税后）+3.00%”，其中，一年期定期存款利率以最近一次基金份额折算基准日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。转型折算与自动分离日次日（含）至第一个基金份额折算基准日（含）期间的一年期定期存款利率以转型折算与自动分离日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。若届时无法获得一年期定期存款

---

利率，基金管理人将选择其他具有市场代表性的利率作为计算基准，并据此约定新汽车 A 份额约定年基准收益率的计算方式。基金管理人应在调整实施前依据《信息披露办法》的有关规定进行公告，并报中国证监会备案。

新汽车 A 份额的约定日单利收益率为新汽车 A 份额约定年基准收益率除以 365。

新汽车 A 份额的约定收益，自转型折算与自动分离日次日（含）起至第一个基金份额折算基准日（含）期间、或自上一个基金份额折算基准日次日（含）起至下一个基金份额折算基准日（含）期间，以 1.0000 元为基准，采用新汽车 A 份额约定日单利收益率累计计算。

基金管理人承诺也不保证新汽车 A 份额的基金份额持有人获得约定收益或本金安全，在本基金出现极端损失的情形下，新汽车 A 份额的基金份额持有人的收益可能低于其约定收益，也可能遭受本金损失的风险。

（2）本基金 1 份新汽车 A 份额与 1 份新汽车 B 份额构成一对份额组合，一对份额组合的基金份额净值之和等于 2 份国泰新汽车份额的基金份额净值。计算出新汽车 A 份额的基金份额净值后，根据上述关系，计算出新汽车 B 份额的基金份额净值。

（3）基金份额折算（定期份额折算或不定期份额折算）后，新汽车 A 份额、新汽车 B 份额各自基金份额净值的计算方法保持不变。

（4）在基金份额折算基准日（包括定期份额折算和不定期份额折算的基金份额折算基准日），按照上述原则计算出来的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额净值均为基金份额折算基准日折算前各份额的基金份额净值。

#### 4、基金份额净值的计算

假设：

$T$  日为计算日， $T$  日国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额净值分别为  $NAV$ 、 $NAV(A)$ 、 $NAV(B)$ ； $R_T$  为  $T$  日新汽车 A 份额的约定年基准收益率； $t$  为截至  $T$  日新汽车 A 份额的应计收益天数，则  $t = \min\{\text{转型折算与自动分离日次日（含该日）至 } T \text{ 日（含该日）的实际天数；最近一个基金份额折算基准日次日（含该日）至 } T \text{ 日（含该日）的实际天数}\}$ 。

则：

$NAV = T$  日闭市后本基金的基金资产净值 /  $T$  日本基金基金份额的总数

$$NAV(A) = 1.0000 + 1.0000 \times t \times \frac{R_T}{365}$$

---

$$NAV(B) = 2 \times NAV - NAV(A)$$

其中， $T$  日闭市后本基金的基金资产净值是指本基金总资产减去总负债后的价值， $T$  日本基金基金份额的总数为  $T$  日国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的份额数之和。

#### 5、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额类别以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

### （四）转型后基金的投资目标、投资范围、投资限制和投资策略

#### 1、投资目标

本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 85%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证投资不高于基金资产净值的 3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 3、投资策略

##### （1）股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对

---

投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### （2）债券投资策略

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

#### （3）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### （4）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，坚持价值投资理念，把握市场交易机会。在严格遵守法律法规的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### （5）权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

### 4、投资限制

#### （1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 85%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；

2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

3) 本基金投资于权证的限制如下：

① 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

- 
- ②本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- ③本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
- 4) 本基金投资于资产支持证券的投资限制如下:
- ①本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;
- ②本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- ③本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- ④本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
- ⑤本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
- 5) 本基金参与股票发行申购,所申报的金额不超过本基金的总资产,所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- 6) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%,在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不展期;
- 7) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合:
- ①在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;
- ②在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
- ③在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;
- ④基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
- ⑤在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;
- 8) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;
- 9) 法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。
- 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使

---

基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在相关证券可交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## （2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：国证新能源汽车指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

国证新能源汽车指数由深圳证券信息有限公司发布，以沪深 A 股市场属于整车、电池

---

材料、上游材料、机电电控和充电桩等新能源产业链的上市公司为样本空间，根据市值和成交金额综合排名，选出 50 只股票作为指数样本股。国证新能源汽车指数可以反映新能源汽车产业的整体运行情况。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。若变更业绩比较基准、标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

## 6、风险收益特征

本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。

运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额。其中国泰新汽车份额为普通的股票型指数基金份额，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；新汽车 A 份额的预期风险和预期收益较低；新汽车 B 份额采用了杠杆式的结构，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

## 7、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

### （五）转型后基金的费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）标的指数使用许可费；
- （4）基金上市费及年费；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （6）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

- 
- (7) 基金份额持有人大会费用；
  - (8) 基金的证券/期货交易费用；
  - (9) 基金的银行汇划费用；
  - (10) 基金证券/期货账户的开户费用、银行账户维护费用；
  - (11) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### (3) 标的指数使用许可费

本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提，且收取下限为每季度人民币 5 万元（基金合同生效日所在季度除外）。计算方法如下：

$$H= E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季度前 3 个工作日内从基金

---

财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人可根据指数使用许可协议，对上述计提标准和计提方式进行变更，此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在更新招募说明书或其他公告中披露基金最新适用的计提标准和计提方法。

上述“1、基金费用的种类中第（4）—（11）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

基金管理人和基金托管人可根据基金运作情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### （六）转型后基金的收益分配原则

本基金分级份额存续期间暂不进行收益分配。

在本基金国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额的运作期间内，基金管理人可根据实际情况，在履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，并相应修改新汽车 A 份额、新汽车 B 份额基金份额净值的计算公式等，且此项修改无需召开基金份额持有人大会。

经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案后，如果终止新汽车 A 份额、新汽车 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （七）基金份额折算

除分级份额终止运作的份额折算外，基金份额折算后，本基金的运作方式不变。

##### 1、定期份额折算

---

在新汽车 A 份额和新汽车 B 份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的 12 月 15 日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日），本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

（1）基金份额折算基准日

每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的 12 月 15 日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。但基金合同生效日至第一个定期份额折算基准日不足 6 个月的，则该年度可不进行定期份额折算；定期份额折算基准日前 3 个月内发生过不定期份额折算的，则该年度可不进行定期份额折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期份额折算的，应至少提前 2 个工作日在指定媒介上公告不进行定期份额折算的提示性公告。

基金管理人可对定期份额折算的基金份额折算基准日进行调整，并对本基金《基金合同》予以相应修改，且此项调整无需召开基金份额持有人大会。基金管理人在调整实施前应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新汽车 A 份额和国泰新汽车份额。

（3）基金份额折算频率

每个会计年度进行 1 次（可不进行定期份额折算的除外）。

（4）基金份额折算方式

1) 每个会计年度的 12 月 15 日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）为基金份额折算基准日，本基金将在该日对新汽车 A 份额进行约定收益的定期份额折算，国泰新汽车份额的基金份额净值也相应的进行调整。在基金份额折算前与折算后，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

2) 折算前的新汽车 A 份额持有人，以新汽车 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰新汽车份额的份额分配。折算不改变新汽车 A 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 A 份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰新汽车份额。

3) 折算前的国泰新汽车份额的基金份额持有人，以每 2 份国泰新汽车份额，按 1 份新汽车 A 份额的份额分配，获得新增国泰新汽车份额。持有场外国泰新汽车份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外国泰新汽车份额；持有场内国泰新汽车份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内国泰新汽车份额。折算不改变国泰新汽车份额持有人的资产净值。

4) 折算不改变新汽车 B 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 B 份额的基金份额净

---

值及份额数量不变。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(5) 基金份额折算公式

1) 新汽车 A 份额

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(A)^{\text{前}}$$

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000}{2}$$

新汽车 A 份额持有人持有的新增场内国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：基金份额折算基准日折算前新汽车 A 份额的份额数

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：基金份额折算基准日折算后新汽车 A 份额的份额数

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：基金份额折算基准日折算前新汽车 A 份额的基金份额净值

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：基金份额折算基准日折算后新汽车 A 份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：基金份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值

$NAV^{\text{后}}$ ：基金份额折算基准日折算后国泰新汽车份额的基金份额净值

2) 新汽车 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变新汽车 B 份额的基金份额净值及其份额数。

3) 国泰新汽车份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000}{2}$$

折算后国泰新汽车份额持有人持有的新增国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{(NAV^{\text{前}} - NAV^{\text{后}}) \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

---

其中：

$NAV^{\text{前}}$ ：基金份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值

$NAV^{\text{后}}$ ：基金份额折算基准日折算后国泰新汽车份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：基金份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的份额数

在实施基金份额折算时，基金份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值、新汽车 A 份额的基金份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的上市交易和国泰新汽车份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （7）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告折算结果，并报中国证监会备案。

### 2、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在国泰新汽车份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时以及新汽车 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.2500 元时进行不定期份额折算。

#### （1）国泰新汽车份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时

##### 1）基金份额折算基准日

如果某个工作日国泰新汽车份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元，基金管理人应确定基金份额折算基准日。基金份额折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

##### 2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新汽车 A 份额、新汽车 B 份额、国泰新汽车份额。

##### 3）基金份额折算频率

不定期。

##### 4）基金份额折算方式

①折算前的新汽车 A 份额持有人，以新汽车 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰新汽车份额的份额分配。折算不改变新汽车 A 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 A 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，

---

相应折算增加场内国泰新汽车份额；

②折算前的新汽车 B 份额持有人，以新汽车 B 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰新汽车份额的份额分配。折算不改变新汽车 B 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 B 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰新汽车份额；

③折算前的国泰新汽车份额持有人，获得新增国泰新汽车份额的份额分配。折算不改变国泰新汽车份额持有人的资产净值，其持有的国泰新汽车份额净值折算调整为 1.0000 元，份额数量相应折算增加。持有场外国泰新汽车份额的持有人将折算增加场外国泰新汽车份额；持有场内国泰新汽车份额的持有人将折算增加场内国泰新汽车份额。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

#### 5) 基金份额折算公式

##### ①新汽车 A 份额

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(A)^{\text{前}}$$

折算后新汽车 A 份额持有人持有的新增国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{(NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM(A)^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 A 份额的份额数

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 A 份额的份额数

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 A 份额的基金份额净值

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 A 份额的基金份额净值

##### ②新汽车 B 份额

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(B)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{前}}$$

折算后新汽车 B 份额持有人持有的新增国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{(NAV(B)^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM(B)^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 B 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 B 份额的份额数

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 B 份额的基金份额净值

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 B 份额的基金份额净值

### ③ 国泰新汽车份额

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰新汽车份额持有人持有的新增国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{(NAV^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后国泰新汽车份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的份额数

在实施基金份额折算时，份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值、新汽车 A 份额的基金份额净值、新汽车 B 份额的基金份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### 6) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的上市交易和国泰新汽车份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### 7) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告折算结果，并报中国证监会备案。

(2) 新汽车 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.2500 元时

#### 1) 基金份额折算基准日

如果某个工作日新汽车 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.2500 元，基金管理人应确定基金份额折算基准日。基金份额折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

#### 2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新汽车 A 份额、新汽车 B 份额、国泰新汽车份额。

#### 3) 基金份额折算频率

不定期。

#### 4) 基金份额折算方式

①折算不改变新汽车 B 份额持有人的资产净值，其持有的国泰新汽车 B 份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整；

②新汽车 A 份额与新汽车 B 份额的基金份额配比保持 1: 1 的比例不变；

③折算不改变新汽车 A 份额持有人的资产净值，其持有的新汽车 A 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量折算调整，相应折算增加国泰新汽车份额；

④折算不改变国泰新汽车份额持有人的资产净值，其持有的国泰新汽车份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

#### 5) 基金份额折算公式

##### ①新汽车 B 份额

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(B)^{\text{后}} = \frac{NUM(B)^{\text{前}} \times NAV(B)^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 B 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 B 份额的份额数

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 B 份额的基金份额净值

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 B 份额的基金份额净值

##### ②新汽车 A 份额

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{后}}$$

折算后新汽车 A 份额持有人持有的新增国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times NAV(A)^{\text{前}} - NUM(A)^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 A 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 B 份额的份额数

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前新汽车 A 份额的基金份额净值

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后新汽车 A 份额的基金份额净值

### ③国泰新汽车份额

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰新汽车份额持有人持有的国泰新汽车份额的份额数为：

$$\frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后国泰新汽车份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的份额数

在实施基金份额折算时，份额折算基准日折算前国泰新汽车份额的基金份额净值、新汽车 A 份额的基金份额净值、新汽车 B 份额的基金份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### 6) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的上市交易和国泰新汽车份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 7) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告折算结果，并报中国证监会备案。

#### 3、特殊情况的处理

若在某一个会计年度的定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据实际情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行基金份额折算。

#### 4、其他事项

基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司有权调整上述规则，对本基金《基金合同》予以相应修改，并在本基金更新的招募说明书中列示。且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

### (八) 新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的终止运作

1、经基金份额持有人大会决议通过，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额类别以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

#### 2、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额终止运作后的份额折算

新汽车 A 份额和新汽车 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额将全部折算成场内国泰新汽车份额。

##### (1) 分级份额终止运作折算基准日

分级份额终止运作折算基准日为分级份额终止运作日，即新汽车 A 份额和新汽车 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

##### (2) 份额折算方式

分级份额终止运作日，新汽车 A 份额和新汽车 B 份额按届时各自基金份额净值与国泰新汽车份额基金份额净值之比折算为国泰新汽车份额。

##### (3) 份额折算计算公式：

$$\text{新汽车 A 份额折算的国泰新汽车份额份额数} = \frac{NUM(A) \times NAV(A)}{NAV}$$

$$\text{新汽车 B 份额折算的国泰新汽车份额份额数} = \frac{NUM(B) \times NAV(B)}{NAV}$$

---

其中：

$NUM(A)$ 、 $NUM(B)$  分别指折算前新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的份额数，即分级份额终止运作日闭市后新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的份额数；

$NAV(A)$ 、 $NAV(B)$ 、 $NAV$  分别指折算前新汽车 A 份额、新汽车 B 份额和国泰新汽车份额的基金份额净值，即分级份额终止运作日闭市后新汽车 A 份额、新汽车 B 份额和国泰新汽车份额的基金份额净值。

#### （4）份额折算后的基金运作

新汽车 A 份额和新汽车 B 份额全部折算为场内国泰新汽车份额后，本基金转型为国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）。

#### （5）份额折算的公告

新汽车 A 份额和新汽车 B 份额进行份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告折算结果，并报中国证监会备案。

### （九）转型后基金的特定申购期申购

#### 1、特定申购期

本基金的特定申购期为本基金合同生效后不超过 1 个月的时间。该期间只开放特定申购期申购，不开放赎回业务。

#### 2、特定申购期申购

本基金特定申购期申购与日常申购相比，不同点对于特定申购期申购的场内国泰新汽车份额（如转型折算则以折算后份额计），在特定申购期结束后的第 2 个工作日，由基金管理人委托注册登记结构按照 1：1 的基金份额配比自动分离为新汽车 A 份额与新汽车 B 份额，无需基金份额持有人申请。日常申购的场内国泰新汽车份额，由基金份额持有人提交分拆业务申请并经确认后，方可分拆为新汽车 A 份额与新汽车 B 份额。

本基金特定申购期申购的场所、申购的原则、申购的程序、申购的数量限制、申购的费用、申购份额的计算方式、拒绝或暂停申购的情形等业务规则与日常申购业务相同。

### （十）转型后基金的申购、赎回与转换

本基金的新汽车 A 份额、新汽车 B 份额不接受投资人的申购与赎回，只上市交易。投资人可通过场内或场外两种方式对国泰新汽车份额进行申购与赎回。

#### 1、申购和赎回场所

国泰新汽车份额的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人可以使用开放式基金账户，

---

通过基金管理人的直销机构及其他场外销售机构办理国泰新汽车份额的场外申购和赎回业务。基金投资人也可使用深圳证券账户，通过场内销售机构利用深圳证券交易所交易系统办理国泰新汽车份额的场内申购和赎回业务。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

办理国泰新汽车份额场内申购、赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理国泰新汽车份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和其他场外销售机构。

## 2、申购和赎回的开放日及时间

### （1）开放日及开放时间

投资人在开放日办理国泰新汽车份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将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。

### （2）申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自特定申购期结束之日起不超过 30 日开始办理国泰新汽车份额的申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。

基金管理人自特定申购期结束之日起不超过 30 日开始办理国泰新汽车份额的赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理国泰新汽车份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，其国泰新汽车份额申购、赎回价格为下一开放日国泰新汽车份额申购、赎回的价格。

## 3、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的国泰新汽车份额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，即申购国泰新汽车份额以金额申请，赎回国泰新汽车份额以份额申请；

(3) 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

(4) 场外赎回遵循“先进先出”原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的国泰新汽车份额进行处理时，注册登记确认日期在先的国泰新汽车份额先赎回，注册登记确认日期在后的国泰新汽车份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

(5) 投资人通过深圳证券交易所交易系统办理国泰新汽车份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 4、申购与赎回的程序

##### (1) 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出对国泰新汽车份额的申购或赎回申请。

##### (2) 申购和赎回的款项支付

投资人申购国泰新汽车份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；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赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### (3) 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束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。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。基金销售机构对申购、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或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况，投

---

资人应及时查询。

#### 5、申购和赎回的数量限制

##### （1）申购金额的限制

本基金场内单笔申购的最低金额为 50,000.00 元（含申购费），场外单笔申购的最低金额为 100.00 元（含申购费）。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

##### （2）赎回份额的限制

基金份额持有人可将其全部或部分国泰新汽车份额赎回。单笔赎回申请最低份数为 100.00 份，若某基金份额持有人在销售机构保留的国泰新汽车份额不足 100.00 份，则赎回时必须一起赎回。

（3）本基金不对投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制，但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（4）本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

（5）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并报中国证监会备案。

#### 6、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）国泰新汽车份额净值的计算，保留至小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的国泰新汽车份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（2）申购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国泰新汽车份额净值，有效份额单位为份。场外申购国泰新汽车份额的份额计算结果按四舍五入方法，保留至小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购国泰新汽车份额的份额计算结果采用截位法保留至整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

（3）赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留至小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

##### （4）申购费用

本基金不收取申购费用。

#### （5）赎回费用

赎回费用由赎回国泰新汽车份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的场外赎回费率不高于 0.50%，随基金份额持有期限的增加而递减；本基金的场内赎回费率为固定赎回费率 0.50%，不按份额持有时间分段设置赎回费率：

| 场外赎回费 | 申请份额持有时间（N）                         | 赎回费率  |
|-------|-------------------------------------|-------|
|       | $N < 1$ 年                           | 0.50% |
|       | $1 \text{ 年} \leq N < 2 \text{ 年}$  | 0.25% |
|       | $N \geq 2$ 年                        | 0.00% |
| 场内赎回费 | 本基金场内赎回费为固定值0.50%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。 |       |

注：1 年=365 天。

（6）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（7）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金持续营销计划，对投资人定期或不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低国泰新汽车份额的申购费率和赎回费率。

（8）办理国泰新汽车份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

#### 7、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金无法正常运转。
- （2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- （3）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

---

(4) 基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

(5) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)、(2)、(3)、(5)、(6)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 8、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

(3) 证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(5) 出现继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 9、巨额赎回的情形及处理方式

(1) 巨额赎回的认定

---

若本基金单个开放日内的国泰新汽车份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额(包括国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额)的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

## (2) 巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的(包括国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额) 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日国泰新汽车份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含 2 个开放日)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受国泰新汽车份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

## (3) 巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。

## (4) 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## 10、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

---

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

(2) 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日国泰新汽车份额的基金份额净值。

(3) 如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近 1 个工作日国泰新汽车份额的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### 11、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 12、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 13、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由注册登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### (十一) 转型后基金的注册登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### 1、基金份额的注册登记

(1) 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的国泰新汽车份额，登记在登记结算系统中基金份额持有人的开放式基金账户下；场内申购的国泰新汽车份额，或上市交易的新汽车 A 份额和新汽车 B 份额，登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。

(2) 登记在证券登记系统中的国泰新汽车份额，可以直接申请场内赎回，不在深圳证券交易所上市交易，但经基金份额持有人申请，按照 1:1 的份额配比分拆为新汽车 A 份额和新汽车 B 份额后，可在深圳证券交易所上市交易。

---

(3) 登记在证券登记系统中的新汽车 A 份额和新汽车 B 份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按照 1: 1 的份额配比申请合并为国泰新汽车份额的场内份额后，再申请场内赎回。

(4) 登记在登记结算系统中的国泰新汽车份额，既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管业务转至证券登记系统后，由基金份额持有人申请，按照 1: 1 的份额配比分拆为新汽车 A 份额和新汽车 B 份额，在深圳证券交易所上市交易。

## 2、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构之间或证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理国泰新汽车份额赎回业务的销售机构时，需办理已持有国泰新汽车份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理国泰新汽车份额场内赎回的会员单位、或变更办理新汽车 A 份额和新汽车 B 份额上市交易的会员单位时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

## 3、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的国泰新汽车份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

## (十二) 转型后基金的基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由国泰新汽车份额、新汽车 A 份额与新汽车 B 份额基金份额持有人独立进行表决。国泰新汽车份额、新汽车 A 份额与新汽车 B 份额基金份额持有人持有的每一基金份额在其份额类别内拥有平等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式(基金转型、场内申购、场外申购、自动分离、分拆、合并或上市交易)而有所差异。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### 1、召开事由

A: 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 
- (1) 终止《基金合同》;
  - (2) 更换基金管理人;
  - (3) 更换基金托管人;
  - (4) 转换基金运作方式;
  - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
  - (6) 变更基金类别;
  - (7) 本基金与其他基金的合并;
  - (8) 变更基金投资目标、范围或策略;
  - (9) 变更基金份额持有人大会程序;
  - (10) 终止新汽车 A 份额与新汽车 B 份额的运作;
  - (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - (12) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②“单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额”指单独或合计持有国泰新汽车份额、新汽车 A 份额与新汽车 B 份额各自的基金总额 10%以上基金份额的基金份额持有人，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
  - (13) 终止新汽车 A 份额、新汽车 B 份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
  - (14) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
  - (15) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- B、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
  - (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
  - (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整国泰新汽车份额的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式;
  - (4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
  - (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
  - (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情

---

形。

## 2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(4) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

A、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

---

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

B、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

C、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式以及法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

A、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（①含二分之一，下同；②指全部有效凭证所对应的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额分别占权益登记日国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自基金总份额二分之一以上，下同）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事

---

项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额应不少于本基金在权益登记日国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额各自基金总份额的三分之一（含三分之一）。

B、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额分别占权益登记日国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额小于在权益登记日国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额各自基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额各自基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符。

C、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。

D、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

---

基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

## 五、议事内容与程序

### A、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、终止新汽车 A 份额与新汽车 B 份额的运作、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### B、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

#### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

---

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自类别内的表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自类别内的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止新汽车 A 份额和新汽车 B 份额的运作、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### A、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不

---

影响计票的效力。

#### B、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### **（十三）转型后基金的基金合同变更、终止与基金财产的清算**

#### 1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

#### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管

---

人承接的；

(3)《基金合同》约定的其他情形；

(4)相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### (4)基金财产清算程序

1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3)对基金财产进行估值和变现；

4)制作清算报告；

5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

6)将清算报告报中国证监会备案并公告；

7)对基金剩余财产进行分配。

(5)基金财产清算的期限为 6 个月。

### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自的应计分配比例，并据此由国泰新汽车份额、新汽车 A 份额和新汽车 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

### 6、基金财产清算的公告

---

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### **（十四）授权基金管理人修订基金合同**

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的产品特征修订《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同。

### **（十五）授权基金管理人向深圳证券交易所申请中小成长 ETF 终止上市**

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持有人大会决议生效后，按照深圳证券交易所的业务规则申请中小成长 ETF 终止上市等业务。

### **（十六）转型选择期的相关安排**

本次持有人大会决议生效后，中小成长 ETF 将安排不少于 20 个工作日的选择期。选择期间，中小成长 ETF 的申购、赎回业务及交易业务照常办理，不受影响。基金份额持有人在中小成长 ETF 正式实施转型前可选择卖出或赎回，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的中小成长 ETF 份额将默认转型为新能源汽车指数分级基金的场内国泰新汽车份额。在选择期期间，由于中小成长 ETF 需应对卖出、赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免中小成长 ETF 基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

### **（十七）《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》的生效**

自中小成长 ETF 终止上市之日起，由《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订而成的《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》生效，原《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

---

综上所述,基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型方案说明书》以上转型方案要点修订基金合同并实施转型方案。

### 三、基金管理人就方案相关事项的说明

#### (一) 中小成长 ETF 的历史沿革

中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会《关于核准中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可[2011]1206 号)核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金于 2012 年 1 月 30 日至 2012 年 3 月 9 日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 15 日生效。

#### (二) 基金转型有利于保护份额持有人利益

中小成长 ETF 自基金合同生效以来,因市场环境变化等因素的影响,一直未能形成持续的有效需求,产品维护成本越来越高。转型后的新能源汽车指数分级基金变更了标的指数,共有三类基金份额,分别为国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额,不同的基金份额具有不同的风险收益特征,可以更好地满足投资人需求,维护基金份额持有人利益。

#### (三) 基金转型的可行性

##### 1、基金转型不存在法律障碍

《基金法》第四十八条规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:……(二) 决定修改基金合同的重要内容……”。

《基金法》第八十七条规定,“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过;但是,转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构备案,并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定,“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

因此,中小成长 ETF 转型为新能源汽车指数分级基金目前不存在法律方面的障碍。

---

## 2、基金转型不存在技术障碍

中小成长 ETF 转型后，将进行基金份额变更登记。深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及其深圳分公司和基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。变更登记完成后，基金份额持有人可使用深圳证券账户通过深圳证券交易所交易系统或在办理相关手续后通过场外销售机构办理申购、赎回、转托管等业务，不会导致基金份额持有人无法变现基金份额。基金转型不存在技术障碍。

## 3、调整投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、由交易型开放式指数基金变更为指数分级基金的可行性

中小成长 ETF 转型后，基金管理人可根据法律法规及转型后基金的相关特性调整其投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、由交易型开放式指数基金变更为指数分级基金，并对基金合同中的有关内容进行修订。

## 4、授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议、法律法规的规定及转型后的国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的产品特征修订基金合同。

# 四、基金转型的主要风险及预备措施

### （一）转型方案被持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要时，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

### （二）基金转型后运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

# 五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

国泰基金管理有限公司

联系电话：021-31089000

---

传真：021-31081700

电子邮件： [service@gtfund.com](mailto:service@gtfund.com)

网址： [www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)