（上接B054版）

一、投资目标
本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
二、投资范围
本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成分股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。
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，以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为：
基金资产的80%以上投资于股票。本基金投资于股票的指数成分股及其备选成分股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日持有在股指期货合约面值上的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。
三、投资策略
本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重和建议指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
当预期成份股及其权重的变化将导致基金与标的指数偏离时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行调整，并确定以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。如因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。
（一）资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法，按照标的指数的成份股权重和建议比例，将资产主要投资于标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
1、股票投资组合的构建
本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本，特殊情况下，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。
2、股票投资组合的调整
（1）定期调整
本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。
（2）不定期调整
1）当成份股发生增发、送配等情况而影响或成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其调整的权重比例，进行相应调整。
2）根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；
3）特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定那少持有现金或买入相关的替代性组合。
上述特殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股长期停牌；③标的指数成份股流动性不足；④成份股上市公司存在重大违规行为，有可能面临重大的处罚或诉讼。
（三）债券投资策略
在选择债券品种时，首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。
（四）股指期货投资策略
本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的价格走势的分析和权证价值的评估模型寻求其合理估值水平，主要考虑如用策略估值：杠杆策略、价格投资策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、变动保护性的认购权证策略、买入保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
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，追求权益的长期收益。
（五）股指期货等投资策略
本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特性等因素，以期股指期货对冲系统性风险，对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
今后，随着证券市场的发展，金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
四、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80%以上的基金资产投资于股票；
（2）本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；
（3）本基金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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
（4）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%；
（5）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%；
（6）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%；
（7）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因基金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；
（8）本基金与私募类证券资产及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购业务，可能受资质和信誉质量等因素影响，基金管理人将充分考虑资产安全性、流动性、收益性等因素，谨慎开展逆回购业务，以期在保证基金资产安全性、流动性的前提下，实现基金资产的稳定增值。
（9）本基金投资于同一原始权益人的各类资产比例合计不得超过该类资产净值的30%；
（10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该类资产净值的10%；
（11）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券期限在1年以内的比例，不得超过该类资产净值的20%；
（12）本基金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；
（13）本基金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；
（14）基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金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；
（15）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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
（16）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产品种；
（17）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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当将全部投资目标和投资策略、遵循诚信原则、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。
如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
五、标的指数和业绩比较基准
本基金的标的指数：中证高铁产业指数及其未来可能发生的变更。
本基金的业绩比较基准：标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
如果指数编制单位变更或终止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数其他指数替代、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原标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数出现时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序以变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称，其中，若变更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标的指数召开基金份额持有人大会，并报证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数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），且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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。
六、风险收益特征
本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益率于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
本基金除分析的两类基金份额来看，高铁A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；高铁B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。
七、基金的融资融券及转融通
本基金可以根据届时有效的有关法律法规、自律规则和政策的规定进行融资融券、转融通。作基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并充分控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则，具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关法律法规、自律规则的要求执行。
八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法
1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2、不谋求对上市公司的控股；
3、有利于基金资产的安全与增值；
4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十六、基金的财产
一、基金资产总值
基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
二、基金资产净值
基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
三、基金财产的账户
基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户，开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。
四、基金财产的保管和处分
本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。
基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十四部分 基金的投资
一、基金资产总值
基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
二、基金资产净值
基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
三、基金财产的账户
基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户，开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。
四、基金财产的保管和处分
本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。
基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

一、估值日
本基金的估值日为本基金相关的证券期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。
二、估值对象
基金所拥有的股票、债券、金融衍生品和其他投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。
三、估值原则
基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。
（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的特外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。
与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中对特定因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中只将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。
（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值，或取得相关资产或负债可观察输入值需不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。
（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使被估值资产或负债的公允价值发生了重大变化的，应根据交易日后经济环境或发生重大变化、或证券发行机构发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。
（四）证券发行机构在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。
（五）证券发行机构在证券交易所挂牌的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；
（六）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。估值时所用估值技术一经采用，除非不再适用，应当保证估值技术的一致性。
（七）交易所上市不存在活跃市场的限售股，按照交易所市场同一流通股票的市价估值，估值日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。
（八）交易所上市的可转换债券按收盘价估值。
（九）交易所上市的可转换债券按收盘价估值。
（十）对存在活跃市场的股指期货合约，以其结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。
（十一）对存在活跃市场的国债期货合约，以其当日的结算价进行估值。
（十二）对存在活跃市场的权证，以其当日的收盘价进行估值。
（十三）对存在活跃市场的资产支持证券，以其当日的收盘价进行估值。
（十四）对存在活跃市场的股票期权合约，以其当日的结算价进行估值。
（十五）对存在活跃市场的基金，以其当日的收盘价进行估值。
（十六）对存在活跃市场的贵金属合约，以其当日的结算价进行估值。
（十七）对存在活跃市场的期货合约，以其当日的结算价进行估值。
（十八）对存在活跃市场的股票、债券、权证、资产支持证券、贵金属合约、期货合约、股指期货合约、基金以外的其他投资品种，如有证券交易所或证券登记机构等机构提供的估值或结算价格，应采用该价格进行估值。
（十九）基金投资的证券发行机构、证券交易所、证券登记机构、证券结算机构、期货交易所、期货结算机构、证券投资基金管理人、证券投资基金托管人、证券投资基金销售机构、证券投资基金登记机构、证券投资基金估值机构、证券投资基金会计机构、证券投资基金审计机构、证券投资基金信息披露机构等机构发生重大事件，影响证券投资基金估值的，基金管理人应当根据具体情况，与相关当事人进行合理估值。
（二十）基金的会计与审计
一、基金会计政策
1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日，基金首次募集的会计年度按照下期期间：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4、会计制度执行国家有关会计制度；
5、本基金独立建账、独立核算；
6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目，凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
二、基金的年度审计
1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

十七、基金的会计与审计
一、基金会计政策
1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下期间：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4、会计制度执行国家有关会计制度；
5、本基金独立建账、独立核算；
6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目，凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
二、基金的年度审计
1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

十八、基金的信息披露
一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定，相关法律法规关于信息披露的规定、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。
二、信息披露义务人
本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。
基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。
本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应于披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。
三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：
1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2、对证券投资业绩进行预测；
3、违规承诺收益或者采纪损失；
4、底线其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6、中国证监会禁止的其他行为。
四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露文本与应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义时，以中文文本为准。
本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。
五、公开披露的基金信息
公开披露的基金信息包括：
（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要
（二）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要更新
（三）基金份额发售公告
（四）基金份额申购、赎回价格
基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明申购、赎回费率、用保证投资者能够在基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额申购、赎回或查询其基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额申购、赎回或查询或者复制前述信息资料。
（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告
基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。
基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。
基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。
《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。
本基金在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告等文件中披露投资组合信息、包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示投资期货交易对基金资产净值的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。
3、基金托管协议基本要求基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。
4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更时，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要的内容及编制等具体要求，按照相关规定执行，基金管理人不再更新基金产品资料概要。
基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》、摘要登载在指定网站；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。
（二）基金份额发售公告
基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。
（三）《基金合同》生效公告
基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。
（四）基金份额上市交易公告书
国泰证券基金份额与国泰证券份额获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载于指定媒介上。
（五）基金净值信息
《基金合同》生效后，在国泰证券A份额与国泰证券B份额开始上市交易前或南方国泰证券B份额开始申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次南方国泰证券B份额的基金份额净值和基金份额累计净值，国泰证券A份额与国泰证券B份额上市交易后次日起，基金管理人应当披露基金份额参考净值。
（六）基金份额申购、赎回价格
基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明申购、赎回的价格计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额申购、赎回或查询其基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更时，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书其他信息发生变更时，基金管理人至少每年更新一次。基金托管协议基本要求基金托管人和基金管理人在基金托