(上接A21版)

净认购金额=1.00×50,000=50,000.00元

认购费用=1.00×50,000.00×0.8%=400.00元

认购金额=50,000.00+400.00=50,400.00元

利息折算的份额=10.50/1.00=10份

认购份额总额=50,000+10=50,010份

即:投资人场内认购50,000份国泰食品份额,需缴纳认购金额50,400.00元,若募集期产生的利息为10.50元,利息折算的份额截位保留至整数位为10份,其余0.50份对应金额计入基金财产,最后该投资人实际的认购份额为50,010份。

(3)食品A和食品B基金份额的计算

本基金份额发售结束后,投资人场内认购所得的全部份额将按照1:1的基金份额配比自动分离为食品A份额和食品B份额,其份额计算公式如下:

食品A份额=场内认购份额总额×0.5

食品B份额=场内认购份额总额×0.5

其中,食品A份额和食品B份额计算结果采用截位法保留至整数位,余额计入基金财产。自动分离的结果以注册登记机构的记录为准。

六、认购安排

1、认购时间安排

投资人认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和其他销售机构确定,请参见本基金的基金份额发售公告或其他销售机构的相关公告。

2、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或基金代销机构的相关业务办理规则。

3、认购的方式和确认

(1)本基金场外认购采用金额认购的方式,场内认购采用份额认购的方式。

(2)投资人认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款。若资金未全额到账则认购无效,基金管理人将认购无效的款项退回。

(3)投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。当日(T日)在规定时间内提交的申请,投资人通常应在T+2日到原销售机构查询认购申请的受理情况。

4、认购的限额

(1)通过场内认购本基金时,投资人单笔最低认购份额为50,000份,超过50,000份的必须是1,000份的整数倍,且单笔认购最高不超过99,999,000份。

(2)通过场外认购本基金时,投资人单笔最低认购金额为100.00元(含认购费)。场外各销售机构对本基金最低认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。

(3)认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

七、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额的数额以注册登记机构的记录为准。

八、基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集结束前任何人不得动用。

第八部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

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。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资人已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息;

3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

第九部分 食品A份额和食品B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,食品A份额与食品B份额可分别在深圳证券交易所上市交易,交易代码不同。

一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

食品A份额和食品B份额上市交易后,登记在证券登记结算系统中的食品A份额与食品B份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的国泰食品份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并分拆成食品A份额和食品B份额后,方可上市交易。

二、上市交易的时间

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,食品A份额和食品B份额将于基金合同生效后3个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定本基金上市交易的时间后,基金管理人应依据有关规定在指定媒体上刊登基金份额上市交易公告书。

三、上市交易的规则

食品A份额和食品B份额的上市交易按照深圳证券交易所相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金食品A份额与食品B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关业务规则、通知、指南等有关规定执行。

六、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金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。

七、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能,基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

第十部分 国泰食品份额的申购、赎回与转换

本基金的食品A份额、食品B份额不接受投资人的申购与赎回,只上市交易;本基金基金合同生效后,投资人可通过场内或场外两种方式对国泰食品份额进行申购与赎回。

一、申购和赎回场所

国泰食品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食品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食品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。

办理国泰食品份额场内申购、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。办理国泰食品份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和其他场外销售机构。

二、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食品份额的申购和赎回,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体上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理国泰食品份额的申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理国泰食品份额的赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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体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食品份额的申购、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,其国泰食品份额申购、赎回价格为下一开放日国泰食品份额申购、赎回的价格。

三、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食品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,即申购国泰食品份额以金额申请,赎回国泰食品份额以份额申请;

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该销售机构托管的国泰食品份额进行处理时,注册登记确认日期在先的国泰食品份额先赎回,注册登记确认日期在后的国泰食品份额后赎回,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食品份额的场内申购、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体上公告。

四、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食品份额的申购或赎回申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购国泰食品份额时,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。

五、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)。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的,以各代销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食品份额赎回。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食品份额不足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,但各代销机构对交易账户最低份额余额有其他规定的,以各代销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体上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的费用

1、申购费用

本基金不收取申购费用。

2、赎回费用

赎回费用由赎回国泰食品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0.7%,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0.7%,不按份额持有时间分段设置赎回费率:

	申请份额持有时间(N)	赎回费率
场外赎回费	N<1年	0.70%
	1年≤N<2年	0.25%
	N≥2年	0.00%
场内赎回费	本基金场内赎回费为固定值0.70%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

3、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体上公告。

4、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促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求执行。如果基金管理人认为这些调低基金份额的赎回费率。

5、办理国泰食品份额的场内申购、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。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额,以申请当日国泰食品份额的基金份额净值为基准计算。

本基金国泰食品份额申购份额的计算方式如下:

申购份额=申购金额/T日国泰食品份额基金份额净值

场外申购国泰食品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。场内申购国泰食品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。

例:某投资人投资50,000.00元申购本基金,假设申购当日国泰食品份额净值为1.1280元,则其可得到的申购份额为:

申购份额=50,000.00/1.1280=44,326.24份

若投资人是场外申购,则所得份额为44,326.24份。若投资人是场内申购,则所得份额为44,326份,整数位后小数部分的申购份额(0.24份)对应的资金返还至投资人账户。具体计算公式为:

实际净申购金额=44,326×1.1280=49,999.73元

退款金额=50,000.00-49,999.73=0.27元

即投资人投资50,000.00元从场内申购本基金,则可得到44,326份国泰食品份额,同时应得退款0.27元。

2、赎回金额的计算方式: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。具体计算公式为:

赎回金额=赎回国泰食品份额份数×T日国泰食品份额基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例:某投资人持有本基金50,000.00份场外国泰食品份额,持有0.5年时决定赎回,假设赎回当日国泰食品份额净值1.2500元,则其获得的赎回金额计算如下:

赎回金额=50,000.00×1.2500=62,500.00元

赎回费用=62,500.00×0.7%=437.50元

净赎回金额=62,500.00-437.50=62,062.50元

即投资人赎回本基金50,000.00份场外国泰食品份额,持有0.5年,假设赎回当日国泰食品份额净值1.2500元,则其获得的净赎回金额为62062.50元。

3、国泰食品份额净值的计算,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日的国泰食品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。

八、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作。

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、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会导致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,从而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体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。

九、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、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。

十、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食品份额净赎回申请(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(包括国泰食品份额、食品A份额和食品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(包括国泰食品份额、食品A份额和食品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,可暂停接受国泰食品份额的赎回申请;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,并应当在指定媒体公告。

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、传真或者基金管理人网站在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

十一、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体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个开放日国泰食品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体上刊登重新开放申购或赎回的公告;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。

十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及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。

十三、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。

第十一部分 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻

一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

二、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。场外认购或申购的国泰食品份额,登记在注册登记系统中基金份额持有人的开放式基金账户下;场内认购、申购的国泰食品份额,或上市交易的食品A份额和食品B份额,登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

(2)登记在证券登记结算系统中的国泰食品份额,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的份额配比分拆为食品A份额和食品B份额后,可在深圳证券交易所上市交易。

(3)登记在证券登记结算系统中的食品A份额和食品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食品份额的场内份额后,再申请场内赎回。

(4)登记在注册登记系统中的国泰食品份额,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结算系统后,由基金份额持有人申请,按照1:1的份额配比分拆为食品A份额和食品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注册登记系统内不同销售机构之间或证券登记结算系统内不同会员单位之间进行转托管的行为。

(2)基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理国泰食品份额赎回业务的销售机构时,需办理已持有国泰食品份额的系统内转托管。

(3)基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理国泰食品份额场内赎回的会员单位、或变更办理食品A份额和食品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食品份额在注册登记系统和证券登记结算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。

三、基金份额的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

第十二部分 场内份额配对转换

基金合同生效后,本基金将根据基金合同约定,办理场内的国泰食品份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务。

一、场内份额配对转换业务

1、场内份额配对转换业务:指根据基金合同约定,场内的国泰食品份额与分级份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并。

2、分拆:指根据基金合同约定,场内的国泰食品份额按照1:1的基金份额配比分拆为食品A份额和食品B份额的行为。

3、合并:指根据基金合同约定,食品A份额和食品B份额按照1:1的基金份额配比合并为场内的国泰食品份额的行为。

4、场外的国泰食品份额不进行份额配对转换。场外的国泰食品份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后,可按照场内份额配对转换规则进行操作。但深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金合同等另有规定的除外。

二、业务办理机构

本基金场内份额配对转换业务的办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人,应当在场内份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式,办理场内份额配对转换。深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构,并予以公告。

三、业务办理时间

场内份额配对转换,自基金合同生效后不超过3个月的时间内开始办理,基金管理人应按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

四、场内份额配对转换的原则

1、场内份额配对转换以份额申请。

2、如果申请场内份额的分拆,国泰食品份额的场内份额数,必须是相关业务公告规定份额的正整数倍。

3、如果申请场内份额的合并,食品A份额和食品B份额必须同时配对申请,且食品A份额和食品B份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍,份额配比为1:1。

4、国泰食品份额的场外份额如需申请进行场内份额的分拆,须跨系统转托管为国泰食品份额的场内份额后方可进行。

5、场内份额配对转换,应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司或基金管理人可视情况对上述规定作出调整,并在正式实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

五、业务办理程序

场内份额配对转换业务的办理程序,遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则,具体见相关业务公告。

六、暂停场内份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形;

2、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形可决定是否暂停办理配对转换业务;

3、基金管理人认为继续接受配对转换可能损害基金份额持有人利益的情形;

4、法律法规、深圳证券交易所规定、中国证券登记结算有限责任公司规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况之一且基金管理人决定暂停场内份额配对转换的,基金管理人应在指定媒体就暂停场内份额配对转换业务予以公告。当恢复场内份额配对转换业务时,基金管理人将在指定媒体就恢复场内份额配对转换业务予以公告。

七、业务办理费用

本基金场内份额配对转换业务的办理机构可对该业务的办理收取一定的费用,具体见相关业务公告。

八、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司调整上述规则的,基金合同将相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会,并在本基金更新的招募说明书中列示。

第十三部分 基金的投资

一、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。

二、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、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90%-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股票资产的90%,且不低于非现金资产的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。

三、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基金净值收益率与业绩比较基准之间的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。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

4、基金管理人运用基金财产的决策程序

(1)投资依据

1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定;

2)经济运行态势和证券市场走势。

(2)投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;确定基金的投资策略和在不同阶段的重大资产配置比例,包括大类资产配置比例(股票、转债及其他债券)以及各类属资产内部行业比例等;审批基金经理提出的投资组合计划和重大单项投资。基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

(3)投资程序

1)金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标,结合公司内外研究报告,对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算与归因分析,依此提出研究分析报告。

2)投资决策委员会依据金融工程部、研究开发部等部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

3)基金经理以基金合同、投资决策委员会决议、金融工程部和研究开发部研究报告等为依据建立基金的投资组合。

4)交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。

5)金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。稽核监察部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

6)基金经理结合个券的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和稽核监察部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整。

7)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在招募说明书中更新。

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)本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为90%-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股票资产的90%,且不低于非现金资产的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)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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;

(11)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;

(12)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;

(13)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%;

(14)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。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。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。

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。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:国证食品饮料行业指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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。

六、风险收益特征

本基金属为股票型指数基金,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,分别为国泰食品份额、食品A份额、食品B份额。其中国泰食品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;食品A份额的预期风险和预期收益较低;食品B份额采用了杠杆式的结构,预