（上接A21版）

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工240余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末，中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管，存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1、每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3、根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风险显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司直销柜台	地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层－19层	
		直销业务专用电话：021－31081759	
		客户服务专线：400－888－8688，021－31089000	
		传真：021－31081861	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金电子交易平台	网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面	
		电话：021－31081841	联系人：沈雨

（2）其他场外销售机构：具体名单详见本基金份额发售公告。

2、场内发售机构

场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金有色A份额和有色B份额上市交易后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金有色A份额和有色B份额的上市交易。

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

二、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

三、出具法律意见书的律师事务所

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

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国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

法定代表人：杨绍信

电话：021－23238888

传真：021－23238800

联系人：魏佳亮

经办注册会计师：汪棣、魏佳亮

第六部分 基金份额分级与净值计算规则

一、基金份额结构

本基金的基金份额包括国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基础份额（简称“国泰有色份额”）、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“有色A份额”）和国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“有色B份额”）。其中，有色A份额和有色B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

二、基金运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资人场外认购所得的份额，将被确认为国泰有色份额。投资人场内认购所得的份额，将按照1：1 的基金份额配比自动分离为有色A份额和有色B份额。基金合同生效后，投资人认购所得的国泰有色份额场内份额的自动分离，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

2、基金合同生效后，国泰有色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，有色A份额与有色B份额可分别在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同。

3、有色A份额、有色B份额与国泰有色份额的资产合并投资运作。

4、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的国泰有色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有色份额，按照1:1的基金份额配比，申请分拆为有色A份额和有色B份额；或基金份额持有人可将其持有的有色A份额和有色B份额，按照1:1的基金份额配比，申请合并为国泰有色份额的场内份额。场外的国泰有色份额不进行份额配对转换。场外的国泰有色份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后，可按照场内的国泰有色份额配对转换原则进行操作。

5、基金合同生效后，本基金将按照基金合同规定，对国泰有色份额、有色A份额和有色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（详见基金合同第二十二部分的约定）外，基金份额折算后，本基金的运作方式不变，有色A份额和有色B份额的份额配比不变。

6、无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见基金合同“第二十一部分 基金份额折算”），其所产生的场内国泰有色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有色份额按照1:1 的比例分拆为有色A份额和有色B份额。

三、有色A份额和有色B份额的基础份额净值计算原则

在有色A份额和有色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有色A份额和有色B份额分别进行基金份额净值计算。有色A份额为低预期风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金扣除掉国泰有色份额对应的净资产部分后剩余的净资产将优先确保所有有色A份额的本金及有色A份额的约定收益；有色B份额为高预期风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金扣除掉国泰有色份额对应的净资产部分后剩余的净资产在优先确保所有有色A份额的本金及约定收益后，将计为有色B份额的净资产。

在有色A份额和有色B份额存续期内，本基金有色A份额和有色B份额的基金份额净值计算原则如下：

1、有色A份额约定年基准收益率为“一年期定期存款利率（税后）+400%”，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。基金合同生效日（含）至第一次基金份额折算基准日（含）期间的一年期定期存款利率以基金合同生效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，并提此约定有色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。

有色A份额的约定收益率以每个基金合同生效日（含）起至第1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（定期折算基准日或不定期折算基准日）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，采用有色A份额约定日单利收益率累计计算。

基金管理人不承诺也不保证有色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，有色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份有色A份额与1份有色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份国泰有色份额的基金份额净值。计算出有色A份额的基金份额净值后，根据上述关系，计算出有色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，有色A份额、有色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有色份额、有色A份额和有色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。

四、基金份额净值的计算

假设：

T日为计算日，T日国泰有色份额、有色A份额和有色B份额的基金份额净值分别为NAV、NAV(A)、NAV(B)；R为T日有色A份额的约定年基准收益率；t为截至T日有色A份额的应计收益天数，则t=min{基金合同生效日（含该日）至T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

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日国泰有色份额、有色A份额和有色B份额的份额数之和。

五、有色A份额和有色B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，有色A份额和有色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有色份额、有色A份额和有色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。

第七部分 基金的募集

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可【2014】360号文《关于核准国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金募集的批复》）准予募集注册，并依据中国证监会机构部函【2015】379号文《关于国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金延期募集备案的回函》）进行募集。

二、基金类型和存续期限

1、基金类型：股票型基金

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金的存续期间：不定期

三、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金份额发售结束后，投资人场外认购所得的全部份额将确认为国泰有色份额；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有色A份额和有色B份额。

场外将通过基金销售机构（包括基金管理人的直销机构及其他销售机构，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告）公开发售。场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金有色A份额和有色B份额上市交易后，通过深圳证券交易所交易系统办理本基金有色A份额和有色B份额的上市交易。

除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

基金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。

3、发售对象

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、机构投资者和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。

四、募集规模

本基金的募集份额总额应不少于2亿份，募集金额总额应不少于2亿元人民币。

五、基金的初始面值、认购份格及计算公式、认购费用

1、本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

2、认购费用

募集期内投资人可多次认购本基金，认购费用按每笔认购申请单独计算。

（1）本基金场外认购采用金额认购的方式，认购费率如下：

认购金额（M）	认购费率
M＜50万元	0.80%
50万元≤M＜100万元	0.50%
M≥100万元	每笔1,000元

（2）本基金场内认购采用份额认购方式，认购费率如下：

认购份额（M）	认购费率
M＜50万份	0.80%
50万份≤M＜100万份	0.50%
M≥100万份	每笔1,000元

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

3、基金认购份额的计算

（1）场外认购份额的计算

基金份额发售结束后，投资人场外认购所得的全部份额将确认为国泰有色份额。

1）认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1＋认购费率）

认购费用=认购金额－净认购金额

认购份额=（净认购金额＋认购期间的利息）/基金份额初始面值

2）认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用=固定认购费用

净认购金额=认购金额－固定认购费用

认购份额=（净认购金额＋认购期间的利息）/基金份额初始面值

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位；认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金资产所有。

例：某投资人投资50,000.00元场外认购本基金，认购费率为0.8%，假定募集期产生的利息为10.50元，则可认购国泰有色份额的份额数为：

净认购金额=50,000.00/（1＋0.8%）=49,603.17元

认购费用=50,000.00－49,603.17=396.83元

认购份额=（49,603.17＋10.50）/1.00=49,613.67份

即：该投资人投资50,000.00元认购本基金，募集期产生的利息为10.50元，如果选择场外认购，可得49,613.67份国泰有色份额。

（2）场内认购金额和利息折算份额的计算

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有色A份额和有色B份额。

本基金份额初始面值为人民币1.00元，挂牌价格为人民币1.00元/份。

1）认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额=净认购金额+认购费用

利息折算的份额=认购期间的利息/挂牌价格

认购份额总额=认购份额＋利息折算的份额

2）认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购金额=净认购金额+认购费用

利息折算的份额=认购期间的利息/挂牌价格

认购份额总额=认购份额＋利息折算的份额

场内认购金额计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位。利息折算的份额采用截位法保留至整数位，余额计入基金资产。

例：某投资人场内认购本基金50,000份，认购费率为0.8%，假定募集期产生的利息为10.50元，则认购金额和利息折算份额为：

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份国泰有色份额，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）有色A和有色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有色A份额和有色B份额，其份额计算公式如下：

有色A份额=场内认购份额总额×0.5

有色B份额=场内认购份额总额×0.5

其中，有色A份额和有色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，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第九部分 有色A份额和有色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，有色A份额与有色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。

有色A份额和有色B份额上市交易后，登记在证券登记系统中的有色A份额与有色B份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的国泰有色份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记系统并分拆成有色A份额和有色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，有色A份额和有色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介上刊登基金份额上市交易公告书。

三、上市交易的规则

有色A份额和有色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

本基金有色A份额与有色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 国泰有色份额的申购、赎回与转换

本基金的有色A份额、有色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有色份额进行申购与赎回。

一、申购和赎回场所

国泰有色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有色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有色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。

办理国泰有色份额场内申购、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。办理国泰有色份额场外申购、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有色份额的申购和赎回，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

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理国泰有色份额的申购，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个月开始办理国泰有色份额的赎回，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有色份额的申购，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，其国泰有色份额申购、赎回价格为下一开放日国泰有色份额申购、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有色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，即申购国泰有色份额以金额申请，赎回国泰有色份额以份额申请；

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有色份额进行处理时，注册登记确认日期在先的国泰有色份额先赎回，注册登记确认日期在后的国泰有色份额后赎回，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有色份额的场内申购、赎回业务时，需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，以申请当日国泰有色份额的基金份额净值为基准进行计算。

本基金国泰有色份额申购份额的计算方式如下：

申购份额=申购金额/T日国泰有色份额基金份额净值

场外申购国泰有色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。场内申购国泰有色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，假设申购当日国泰有色份额净值为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元场内申购本基金，则可得到44,326份国泰有色份额，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=赎回国泰有色份额份数×T日国泰有色份额基金份额净值

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份场外国泰有色份额，持有0.5年时决定赎回，假设赎回当日国泰有色份额净值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份场外国泰有色份额，持有0.5年，假设赎回当日国泰有色份额净值1.2500元，则其获得的净赎回金额为62062.50元。

3、国泰有色份额净值的计算，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日的国泰有色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管理人不能正常运作。

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，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。

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有色份额净赎回申请（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（包括国泰有色份额、有色A份额和有色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

当基金出现日巨额赎回时，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（包括国泰有色份额、有色A份额和有色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，可暂停接受国泰有色份额的赎回申请；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，同时在指定媒介上刊登公告。

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个开放日国泰有色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；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有色份额，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；场内认购、申购的国泰有色份额，或上市交易的有色A份额和有色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