（上接B41版）

自2015年6月29日至2015年7月28日中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《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》，内容包括中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金调整投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、修订基金合同、由交易型开放式指数基金变更为指数分级基金、并更名为“国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金”等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2015年8月27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。

第七部分　基金的存续

一、基金份额的变更登记

基金合同生效后，本基金注册登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。

二、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。

第八部分　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。

二、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（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，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（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”），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。

三、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，本基金承除种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，本基金扣除种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。

基金管理人不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，在本基金出现极端风险的情形下，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。

假设：

[illegible]

五、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。

第九部分　新汽车A份额和新汽车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，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。

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。

新汽车A份额和新汽车B份额上市交易后，登记在证券登记系统中的新汽车A份额与新汽车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新汽车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新汽车A份额和新汽车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，新汽车A份额和新汽车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

新汽车A份额和新汽车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

本基金新汽车A份额与新汽车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　国泰新汽车份额的特定申购期申购

（一）特定申购期

本基金的特定申购期自2015年8月27日起至2015年9月25日止。该期间只开放特定申购期申购，不开放赎回业务。

基金管理人可进当延长或缩短特定申购期，但最长不超过1个月。

（二）特定申购期申购

本基金特定申购期申购与日常申购相比，不同点是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机构按照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，有关日常申购业务的相关规则，请参见本招募说明书“第十一部分　国泰新汽车份额的申购、赎回与转换”。

第十一部分　国泰新汽车份额的申购、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。

一、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份额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。

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、赎回开始日前依照《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。

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，即申购基金份额以金额申请，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该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。

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、申购与赎回申请的确认

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认接受该申请。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）。各销售机构对本基金最低申购金额及交易限者有其他规定的，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。

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；

	申请份额持有时间（N）	赎回费率
场外赎回费	N＜1年	0.50%
	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0.50%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

注：1年=365天。

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介上公告。

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销售活动计划，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。

5、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。

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，以申请当日国泰新汽车份额的基金份额净值为基准计算。

本基金国泰新汽车份额申购份额的计算方式如下：

申购份额=申购金额/T日国泰新汽车份额基金份额净值

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。

例：某投资人投资50,000.00元申购本基金，假设申购当日国泰新汽车份额净值为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份国泰新汽车份额，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=赎回国泰新汽车份额份数×T日国泰新汽车份额基金份额净值

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份场外国泰新汽车份额，持有0.5年时决定赎回，假设赎回当日国泰新汽车份额净值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=62,500.00×0.5%=312.50元

净赎回金额=62,500.00−312.50=62,187.50元

即投资人赎回本基金50,000.00份场外国泰新汽车份额，持有0.5年，假设赎回当日国泰新汽车份额净值1.2500元，则其获得的净赎回金额为62,187.50元。

3、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。

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、基金管理人接受某笔或某批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。

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、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，基金管理人应延期予以办理；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对于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，无优先权利。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

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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的情况时，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。

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。

十四、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。

第十二部分　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。

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。

第十三部分　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，办理场内的国泰新汽车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，场内的国泰新汽车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份额的行为。

3、合并：指根据基金合同约定，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的行为。

4、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介上予以公告。

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，国泰新汽车份额的场内份额数，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，新汽车A份额和新汽车B份额必须同时配对申请，且新汽车A份额和新汽车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、国泰新汽车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新汽车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介上予以公告。

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介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介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。

第十四部分　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、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。

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及比例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。但因技术情况（如成分股长期停牌、成分股发生变更、成分股权重由于自由流通量发生变化、成分股公司行为、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获取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证市场的收益性、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。

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投资限制如下：

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持有的全部资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券、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个工作日内予以全部卖出；

（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