

# 国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的 风险提示公告

根据《国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称基金合同)关于基金不定期份额折算的相关约定,当国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金(以下简称本基金)之 B 类份额的基金份额净值小于或等于 0.2500 元时,国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金之基础份额(基金简称:国泰 TMT50,基金代码:160224)、TMTA 份额(场内简称:TMTA,基金代码:150215)、TMTB 份额(场内简称:TMTB,基金代码:150216)将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2018 年 10 月 18 日收盘,TMTB 份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值,在此提请投资者密切关注 TMTB 份额近期基金份额净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期份额折算可能带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于 TMTA 份额、TMTB 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,TMTA 份额、TMTB 份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、TMTB 份额表现为高预期风险、高预期收益的特征,不定期份额折算后其将恢复至初始杠杆水平。

三、TMTA 份额表现为较低预期风险和较低预期收益的特征,在不定期份额折算后,原 TMTA 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征 TMTA 份额变为同时持有较低风险收益特征 TMTA 份额与较高风险收益特征的国泰 TMT50 份额的情况,因此,原 TMTA 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外,国泰 TMT50 为跟踪深证 TMT50 指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌变化,因此原 TMTA 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。请投资者认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》了解相关内容。

四、由于触发折算阈值当日,TMTB 的份额净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,此折算基准日 TMTB 的份额净值可能与折算阈值 0.2500 元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为 1 份),

舍去部分计入基金资产，持有极小数量国泰 TMT50 份额、TMTA 份额、TMTB 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证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 TMTA 份额与 TMTB 份额的上市交易以及国泰 TMT50 份额的申购、赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的《基金合同》及《招募说明书》或者拨打本基金管理人客服电话：400-888-8688。

三、本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读该基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告

国泰基金管理有限公司

2018 年 10 月 19 日