

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示 公告

根据《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关规定,当国泰国证有色金属行业指数分级基金之B份额的份额净值小于或等于0.2500元时,本基金将以国泰有色份额(场内简称:国泰有色,基础份额)、国泰有色A份额(场内简称:有色A)及国泰有色B份额(场内简称:有色B)为基金份额折算对象进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2015年7月7日,有色B份额的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件,在此提请投资者密切关注有色B份额近期的份额净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于有色A份额、有色B份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,有色A份额、有色B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折溢价所带来的风险。

二、有色B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、有色A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,原有有色A份额持有人的风险收益特征将发生一定变化,由持有单一的较低风险收益特征有色A份额变为同时持有较低风险收益特征有色A份额与较高风险收益特征国泰有色份额的情况,因此,原有有色A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外,国泰有色为跟踪国证有色金属行业指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原有有色A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

四、由于触发折算阈值当日,有色B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,此折算基准日有色B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,持有极小数量国泰有色份额、国泰有色A份额、国泰有色B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有色A份额与有色B份额的上市交易和国泰有

色份额的申购及赎回等相关业务。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《国泰国证有色金属指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)或者拨打本公司客服电话: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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2015年7月8日