

关于国泰信用互利分级债券型证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告

根据《国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，国泰信用互利分级债券型证券投资基金（以下简称本基金）将以 2020 年第一个工作日为基准日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2020 年第一个工作日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日交易结束后登记在册的互利 A 份额、信用互利基金份额。

三、基金份额折算方式

互利 A 份额和互利 B 份额按照《基金合同》规定的净值计算规则进行净值计算。折算前的信用互利基金份额持有人，以每 10 份信用互利基金份额，按 7 份互利 A 的约定收益，获得新增信用互利基金份额的分配。折算不改变信用互利基金份额持有人的资产净值。折算前的互利 A 持有人，以互利 A 的约定收益，获得新增信用互利基金份额的份额分配；折算不改变互利 A 持有人的资产净值，其持有的互利 A 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算调整信用互利基金份额场内份额。折算不改变互利 B 持有人的资产净值，其持有的互利 B 的份额净值及份额数量不变。经过上述份额折算，互利 A 份额和信用互利基金份额的基金份额净值将相应调整。

有关计算公式如下：

1、信用互利基金份额、互利 A、互利 B 的份额净值折算调整如下：

$$\text{定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值} = \frac{\text{定期折算日折算前信用互利基金份额的资产净值}}{\text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数}} - \frac{\frac{7}{10} \times \text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数} \times (\text{定期折算日折算前互利A的份额净值} - 1.000)}{\text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数}}$$

定期折算日折算后互利 A 的份额净值=1.000 元

定期折算日折算后互利 B 的份额净值=定期折算日折算前互利 B 的份额净值

定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值的计算结果，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

2、信用互利基金份额、互利 A、互利 B 的份额数量折算调整如下：

(1) 信用互利基金份额数量折算调整：

本基金先计算“定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值”（见前述份额净值调整公式），再计算“信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数”。

信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数=

$$\frac{7}{10} \times \text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数} \times \frac{(\text{定期折算日折算前互利A的份额净值}-1.000)}{\text{定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值}}$$

场外“信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数”的计算结果，保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

场内“信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

定期折算日折算前的场外信用互利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场外信用互利基金份额的分配。定期折算日折算前的场内信用互利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场内信用互利基金份额的分配。

(2) 互利 A 的份额数量折算调整：

本基金先计算“定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值”（见前述份额净值调整公式），再计算“互利 A 的约定收益折算为新增信用互利基金份额的场内份额数”，将定期折算日折算后互利 A 的份额净值调整为 1.000 元、份额数量不变，计算公式如下：

$$\text{互利A的约定收益折算为新增信用互利基金份额的场内份额数} = \frac{\text{定期折算日折算前互利A的份额数} \times (\text{定期折算日折算前互利A的份额净值}-1.000)}{\text{定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值}}$$

定期折算日折算后互利 A 的份额数=定期折算日折算前互利 A 的份额数

“互利 A 的约定收益折算为新增信用互利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

(3) 互利 B 的份额数量折算调整：

定期折算不改变互利 B 的份额数量和份额净值。

定期折算日折算后互利 B 的份额数=定期折算日折算前互利 B 的份额数

四、重要提示

1、由于互利 A 份额新增份额折算成信用互利基金份额的场内份额数和信用互利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。持有较少互利 A 份额数或场内信用互利基金份额数的份额持有人存在无法获得新增场内信用互利基金份额的可能性。

2、本公告中具体的定期份额折算基准日将依据国务院办公厅正式公布 2019 年节假日安排确定，届时请查阅相关公告。

3、投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请拨打本基金管理人客户服务电话 400-888-8688，021-31089000 或登录本基金管理人网站 www.gtfund.com 获取相关信息。

风险提示：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相关基金的《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

2019 年 11 月 20 日