

# 关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

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”）中关于不定期份额折算的相关规定，当国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金之 B 份额的份额净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 9 月 15 日，本基金 TMT50B 份额的基金份额净值为 0.2172 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 9 月 16 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

## 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 9 月 16 日。

## 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的国泰 TMT50 份额（简称：国泰 TMT50，基金代码：160224）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金 A 份额（基金简称：TMT50A，场内简称：TMTA，基金代码：150215）和国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金 B 份额（基金简称：TMT50B，场内简称：TMTB，基金代码：150216）。

## 三、基金份额折算方式

国泰 TMT50 份额、TMT50A 份额和 TMT50B 份额按照《基金合同》“第十八部分、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

①折算不改变 TMT50B 份额持有人的资产净值，其持有的国泰 TMT50B 份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整；

②TMT50A 份额与 TMT50B 份额的基金份额配比保持 1：1 的比例不变；

③折算不改变 TMT50A 份额持有人的资产净值，其持有的 TMT50A 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量折算调整，相应折算增加国泰 TMT50 份额；

④折算不改变国泰 TMT50 份额持有人的资产净值，其持有的国泰 TMT50 份额净值折算

调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整。

按照上述折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

基金份额折算公式：

①TMT50B 份额

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(B)^{\text{后}} = \frac{NUM(B)^{\text{前}} \times NAV(B)^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前 TMT50B 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后 TMT50B 份额的份额数

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前 TMT50B 份额的基金份额净值

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后 TMT50B 份额的基金份额净值

不定期折算后 TMT50B 份额的份额数取整计算（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。

②TMT50A 份额

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{后}}$$

折算后 TMT50A 份额持有人持有的新增国泰 TMT50 份额的份额数为：

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times NAV(A)^{\text{前}} - NUM(A)^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后 TMT50A 份额的份额数

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后 TMT50B 份额的份额数

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前 TMT50A 份额的基金份额净值

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后 TMT50A 份额的基金份额净值

不定期折算后 TMT50A 份额的份额数及不定期折算后 TMT50A 份额新增的场内国泰 TMT50 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。

③ 国泰 TMT50 份额

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰 TMT50 份额持有人持有的国泰 TMT50 份额的份额数为：

$$\frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后国泰 TMT50 份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰 TMT50 份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前国泰 TMT50 份额的份额数

国泰 TMT50 份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；国泰 TMT50 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。

#### 四、基金份额折算期间的业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即 2015 年 9 月 16 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务；TMT50A 和 TMT50B 将于 2015 年 9 月 16 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 16 日上午 10:30 复牌。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

为了参与二级市场交易的投资者注意 TMT50B 已经触发不定期份额折算，基金管理人将向深圳证券交易所申请临时（2015 年 9 月 16 日）将 TMT50B 场内简称变更为“\*TMTB”，敬请投资者留意参与交易可能带来的风险。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 9 月 17 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务，TMT50A、

TMT50B 暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

(三) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即 2015 年 9 月 18 日)，基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购(含定期定额投资)、赎回、转换、转托管、配对转换业务，TMT50A、TMT50B 将于 2015 年 9 月 18 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 18 日上午 10:30 复牌。

(四) 根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 9 月 18 日 TMT50A、TMT50B 即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日的 TMT50A、TMT50B 的基金份额净值(四舍五入至 0.001 元)，2015 年 9 月 18 日当日 TMT50A、TMT50B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

## 五、重要提示

1、本基金 TMT50A、TMT50B 将于 2015 年 9 月 16 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 16 日上午 10:30 复牌，2015 年 9 月 17 日全天暂停交易，2015 年 9 月 18 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 18 日上午 10:30 复牌。

2、本基金 TMT50A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征，但在不定期份额折算后 TMT50A 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的 TMT50A 份额变为同时持有较低风险收益特征的 TMT50A 份额与较高风险收益特征的国泰 TMT50 份额，因此原 TMT50A 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 份额为跟踪指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原 TMT50A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金 TMT50B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，TMT50B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

4、由于 TMT50A 份额、TMT50B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，TMT50A 份额、TMT50B 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。

5、原 TMT50A 份额、TMT50B 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内国泰 TMT50 份额分拆为 TMT50A 份额、TMT50B 份额。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，TMT50A 份额、TMT50B 份额、国泰 TMT50 份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(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。持有极小数量 TMT50A 份额、TMT50B 份额、国泰 TMT50 份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

7、TMT50B 份额折算基准日的份额净值与折算条件 0.2500 元可能有一定差异。

8、投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请拨打本公司客户服务电话 400-888-8688，021-31089000 或登录本公司网站 [www.gtfund.com](http://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。投资者投资基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2015 年 9 月 16 日