

关于国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）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，国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以 2015 年 9 月 16 日为基准日，对国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“国泰 TMT50”，交易代码：160224）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金 A 份额（以下简称“TMTA”，交易代码：150215）及国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金 B 份额（以下简称“TMTB”，交易代码：150216）实施不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2015 年 9 月 16 日，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。份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位，具体结果如下表所示：

基金份额名称	折算前基金份额 (单位：份)	折算前基金份额净值 (单位：元)	份额折算比例	折算后基金份额(单位：份)	折算后基金份额净值 (单位：元)
国泰 TMT50 场外份额	312,328,873.86	0.6640	0.663951268	207,371,151.76	1.0000
国泰 TMT50 场内份额	15,792,245.00	0.6640	0.663951268	114,485,031.00 (注 1)	1.0000
TMTA 份额	143,480,153.00	1.0264	0.301532673	43,263,954.00	1.0000
			0.724837184	103,999,750.00 (注 2)	
TMTB 份额	143,480,153.00	0.3016	0.301532673	43,263,954.00	1.0000

注 1：该“折算后份额”包括 TMTA 份额经折算后产生的新增场内国泰 TMT50 份额。

注 2：该“折算后份额”为 TMTA 份额经折算后产生的新增场内国泰 TMT50 份额。

投资者自本公告发布之日起可查询经本基金注册登记人及本基金管理人确认的折算后份额。

二、恢复交易

自 2015 年 9 月 18 日起，本基金恢复申购、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统

转托管)和配对转换业务, TMTA 份额、TMTB 份额将于 2015 年 9 月 18 日上午 9:30—10:30 停牌一小时后复牌。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 日复牌首日 TMTA、TMTB 即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日的 TMTA、TMTB 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元), 分别为 1.000 元和 0.981 元。2015 年 9 月 18 日当日 TMTA、TMTB 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。

三、重要提示

1、本基金 TMTA 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 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的 TMTA 份额变为同时持有较低风险收益特征的 TMTA 份额与较高风险收益特征的国泰 TMT50 份额, 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 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 TMTA 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。

2、本基金 TMTB 份额采用了杠杆式的结构, 预期风险和预期收益有所放大。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, TMTB 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。

3、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折溢价所带来的风险。

4、原 TMTA 份额、TMTB 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 TMTA 份额、TMTB 份额。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则, TMTA 份额、TMTB 份额、国泰 TMT 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 TMTA 份额、TMTB 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。

6、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 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18日