

# 关于国泰国证食品饮料行业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《国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定，当国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基础份额（以下简称“国泰食品”，交易代码：160222）的份额净值大于或等于 1.5000 时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 7 月 9 日，本基金国泰食品份额的基金份额净值为 1.5131 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 2020 年 7 月 10 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 2020 年 7 月 10 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食品份额、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金 A 份额（以下简称“食品 A”，交易代码：150198）和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金 B 份额（以下简称“食品 B”，交易代码：150199）。

## 三、基金份额折算方式

国泰食品份额、食品 A 份额和食品 B 份额按照《基金合同》“第二十一部分、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

1、折算前的国泰食品份额持有人，获得新增国泰食品份额的份额分配。折算不改变国泰食品份额持有人的资产净值，其持有的国泰食品份额的基金份额净值折算调整为 1.0000 元，份额数量相应折算增加；

2、折算前的食品 A 份额持有人，以食品 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰食品份额的份额分配。折算不改变食品 A 份额持有人的资产净值，其持有的食品 A 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算

增加场内国泰食品份额；

3、折算前的食品 B 份额持有人，以食品 B 份额在基金份额折算基准日的基金份额净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增国泰食品份额的份额分配。折算不改变食品 B 份额持有人的资产净值，其持有的食品 B 份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内国泰食品份额。

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：

1、食品 A 份额持有人

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

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

折算后食品 A 份额持有人持有的新增国泰食品份额的份额数为：

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

其中：

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

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

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

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

2、食品 B 份额持有人

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

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

折算后食品 B 份额持有人持有的新增国泰食品份额的份额数为：

$$(NAV(B)^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM(B)^{\text{前}}$$

其中：

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

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

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

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

### 3、国泰食品份额持有人

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰食品份额持有人持有的新增国泰食品份额的份额数为：

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

其中：

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

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

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

## 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 2020 年 7 月 10 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；食品 A 和食品 B 正常交易。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。

(二) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 7 月 13 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，食品 A、食品 B 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 2020 年 7 月 14 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，食品 A、食品 B 恢复交易。

(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》，2020 年 7 月 14 日食品 A、食品 B 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 7 月 13 日的食品 A、食品 B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)，2020 年 7 月 14 日当日食品 A、食品 B 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、本基金食品 A、食品 B 将于 2020 年 7 月 13 日全天暂停交易。

2、本基金食品 A 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食品 A 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食品 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的食品 A 份额与较高风险收益特征的国泰食品份额，因此原食品 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，国泰食品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，因此原食品 A 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、本基金食品 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。在不定期份额折算后食品 B 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的高风险收益特征的食品 B 份额变为同时持有高风险收益特征的食品 B 份额与较高风险收益特征的国泰食品份额。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅提升，相应地，食品 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅增加。

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

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，食品 A 份额、食品 B 份额、国泰食品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。持有极小数量食品 A 份额、食品 B 份额、国泰食品份额的持有人，存在无法获得新增场内国泰食品基金份额的可能性。

6、国泰食品份额折算基准日的份额净值与折算条件 1.5000 元可能有一定差异。

7、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 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。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读《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

2020年7月10日