

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）

关于基金不定期份额折算的相关约定，当国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金（以下

简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额净值小于或等于 0.2500 元时，国泰国证房地

业指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：国泰地产，基金代码：160218）、

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金之 A 份额（场内简称：房地产 A，基金代码：150117）、

国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金之 B 份额（场内简称：房地产 B，基金代

码：150118）将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 8 月 26 日收盘，房地产 B 份额的基金份

额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，在此提请投资者密切关注房地产 B 份

额近

期基金份额净值的波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期份额折算可能带来的风险，基金管理人特别提示如下：

一、由于房地产 A 份额、房地产 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，房地产 A 份额、房地产 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

交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、房地产 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杠杆

将

恢复至初始杠杆水平。

三、房地产 A 份额表现为风险与预期收益较低的特征，在不定期份额折算后原房地产

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房地

产 A

份额变为同时持有较低风险收益特征的房地产 A 份额与较高风险收益特征的国泰地产

份额

的情况，因此，原房地产 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，

国泰地

产为跟踪国证房地产行业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌变化，因此原房地产 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，房地产 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，此折算基准日房地产 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，持有极小数量国泰地产份额、房地产 A 份额、房地产 B 份

额的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房地产 A 份额与房地产 B 份额的上市交易以

及国

泰地产份额的申购、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，请参阅本基金基金合同及《国泰国证

房地产行业指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本基金管理人客服电话

400-888-8688。

三、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前应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。 敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2015 年 8 月 27 日