

国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额 折算的提示公告

根据《国泰国证有色金属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，当国泰国证有色金属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，国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：国泰有色，基金代码：160221）、有色A份额（场内简称：有色A，基金代码：150196）、有色B份额（场内简称：有色B，基金代码：150197）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2019年11月11日收盘，有色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有色B份额近期基金份额净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于有色A份额、有色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，有色A份额、有色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、有色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将恢复至初始杠杆水平。

三、有色A份额表现为较低预期风险和较低预期收益的特征，在不定期份额折算后，原有有色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有色A份额变为同时持有较低风险收益特征的有色A份额与较高风险收益特征的国泰有色份额的情况，因此，原有有色A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，国泰有色为跟踪国证有色金属行业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原有有色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。请投资者认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》了解相关内容。

四、由于触发折算阈值当日，有色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，此折算基准日有色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，持有极小数量国泰有色份额、有色A份额、有色B份额的持有人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有色A份额与有色B份额的上市交易和国泰有色份额的申购及赎回等相关业务。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，请参阅本基金的《基金合同》及《招募说明书》或者拨打本基金管理人客服电话：400-888-8688。

三、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资者投资于本基金管理人管理的基金时应认真阅读该基金的《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12日