

关于国泰国证医药卫生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《国泰国证医药卫生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，当国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金的基础份额（以下简称“国泰医药”，交易代码：160219）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 31 日，本基金国泰医药份额的基金份额净值为 1.5026 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 8 月 3 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 8 月 3 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医药份额、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金 A 份额（以下简称“医药 A”，交易代码：150130）和国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金 B 份额（以下简称“医药 B”，交易代码：150131）。

三、基金份额折算方式

国泰医药份额、医药 A 份额和医药 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、折算前的国泰医药份额持有人，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变国泰医药份额持有人的资产净值，其持有的国泰医药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、折算前的医药 A 份额持有人，以医药 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，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变医药 A 份额持有人的资产净值，其持有的医药 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医药份额；

3、折算前的医药 B 份额持有人，以医药 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，获得新增国泰医药份额的份额分配。折算不改变医药 B 份额持有人的资产净值，其持有的医药 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医药份额。

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、医药 A 份额持有人

$$NAV(A)^{\text{后}} = 1.0000$$

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

折算后医药 A 份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

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

其中：

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

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

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

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

2、医药 B 份额持有人

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000$$

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

折算后医药 B 份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

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

其中：

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

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

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

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

3、国泰医药份额持有人

$$NAV^{\text{后}} = 1.0000$$

折算后国泰医药份额持有人持有的新增国泰医药份额的份额数为：

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

其中：

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

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

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

四、基金份额折算期间的业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2020 年 8 月 3 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；医药 A 和医药 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。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 8 月 4 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，医药 A、医药 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。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 8 月 5 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（不包括场外转场内的跨系统转托管业务）、配对转换业务，医药 A、医药 B 恢复交易。

4、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 8 月 5 日医药 A、医药 B 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 8 月 4 日的医药 A、医药 B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)，2020 年 8 月 5 日当日医药 A、医药 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、本基金医药 A、医药 B 将于 2020 年 8 月 4 日全天暂停交易。

2、本基金医药 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医

药 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医药 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的医药 A 份额与较高风险收益特征的国泰医药份额，因此原医药 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，国泰医药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，因此原医药 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、本基金医药 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医药 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医药 B 份额变为同时持有高风险收益特征的医药 B 份额与较高风险收益特征的国泰医药份额。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅提升，相应地，医药 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、由于医药 A 份额、医药 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，医药 A 份额、医药 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，医药 A 份额、医药 B 份额、国泰医药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。持有极小数量医药 A 份额、医药 B 份额、国泰医药份额的持有人，存在无法获得新增场内国泰医药基金份额的可能性。

6、国泰医药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，请拨打本基金管理人客户服务电话 400-888-8688，021-31089000 或登录本基金管理人网站 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 8 月 3 日