

国泰深证TMT50指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告

近期，国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下国泰深证TMT50指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称：TMTB，基金代码：150216）二级市场交易价格较基金份额净值的溢价幅度较高，2020年8月7日，TMTB份额在二级市场的收盘价为1.099元，相对于当日0.9097元的基金份额净值，溢价幅度达到20.81%。截止2020年8月10日，TMTB份额二级市场的收盘价为1.075元，明显高于基金份额净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

1、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，本基金将在2020年底前完成规范整改，投资者如果高溢价买入TMTB，可能遭受重大损失，请理性投资。

2、TMTB份额表现为高预期风险、高预期收益的特征，由于TMTB份额内含杠杆机制的设计，TMTB份额净值的变动幅度将大于国泰深证TMT50指数分级证券投资基金之基础份额（基金简称：国泰TMT50，基金代码：160224）净值和TMTA份额（场内简称：TMTA，基金代码：150215）的份额净值的变动幅度，即TMTB份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。TMTB份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

3、TMTB份额的交易价格，除了有份额净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

4、截至本公告披露日，国泰深证TMT50指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，国泰深证TMT50指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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

2020年8月11日