

关于国泰信用互利分级债券型证券投资基金 办理定期份额折算业务的公告

根据《国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金合同》(简称“基金合同”),及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,国泰信用互利分级债券型证券投资基金(简称“本基金”)将以2015年1月5日为基准日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下:

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定,定期份额折算基准日为每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2015年1月5日。

二、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的互利A份额(基金代码:150066,基金场内简称:互利A)、信用互利基金份额(基金代码:160217,基金场内简称:国泰互利)。

三、基金份额折算方式

折算前的信用互利基金份额持有人,以每10份信用互利基金份额,按7份互利A的约定收益,获得新增信用互利基金份额的分配。折算不改变信用互利基金份额持有人的资产净值。

折算前的互利A持有人,以互利A的约定收益,获得新增信用互利基金份额的份额分配。折算不改变互利A持有人的资产净值,其持有的互利A份额净值折算调整为1.000元、份额数量不变,相应折算增加信用互利基金份额场内份额。

折算不改变互利B持有人的资产净值,其持有的互利B的份额净值、及份额数量不变。

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。

有关计算公式如下:

1、信用互利基金份额、互利A、互利B的份额净值折算调整如下:

$$\text{定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值} = \frac{\text{定期折算日折算前信用互利基金份额的资产净值}}{\text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数}} - \frac{\frac{7}{10} \times \text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数} \times (\text{定期折算日折算前互利A的份额净值} - 1.000)}{\text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数}}$$

定期折算日折算后互利 A 的份额净值=1.000 元

定期折算日折算后互利 B 的份额净值=定期折算日折算前互利 B 的份额净值

定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值的计算结果，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

2、信用互利基金份额、互利 A、互利 B 的份额数量折算调整如下：

(1) 信用互利基金份额数量折算调整：

本基金先计算“定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值”(见前述份额净值调整公式)，再计算“信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数”。

信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数=

$$\frac{7}{10} \times \text{定期折算日折算前信用互利基金份额的份额数} \times \frac{(\text{定期折算日折算前互利A的份额净值}-1.000)}{\text{定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值}}$$

场外“信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数”的计算结果，保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

场内“信用互利基金份额持有人新增的信用互利基金份额数”的计算结果中，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。

定期折算日折算前的场外信用互利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场外信用互利基金份额的分配。定期折算日折算前的场内信用互利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场内信用互利基金份额的分配。

(2) 互利 A 的份额数量折算调整：

本基金先计算“定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值”(见前述份额净值调整公式)，再计算“互利 A 的约定收益折算为新增信用互利基金份额的场内份额数”，将定期折算日折算后互利 A 的份额净值调整为 1.000 元、份额数量不变，计算公式如下：

互利A的约定收益折算为新增信用互利基金份额的场内份额数=

$$\frac{\text{定期折算日折算前互利A的份额数} \times (\text{定期折算日折算前互利A的份额净值}-1.000)}{\text{定期折算日折算后信用互利基金份额的份额净值}}$$

定期折算日折算后互利 A 的份额数=定期折算日折算前互利 A 的份额数

“互利 A 的约定收益折算为新增信用互利基金份额的场内份额数”的计算结果中，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。

(3) 互利 B 的份额数量折算调整:

定期折算不改变互利 B 的份额数量和份额净值。

定期折算日折算后互利 B 的份额数=定期折算日折算前互利 B 的份额数

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2015 年 1 月 5 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、配对转换业务；互利 A、互利 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、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 1 月 6 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，互利 A 暂停交易、互利 B 正常交易。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、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 1 月 7 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、赎回、转托管、配对转换业务，同时当日 10:30 互利 A 恢复交易、互利 B 正常交易。

五、重要提示

1、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》第十一条的规定，2015 年 1 月 7 日互利 A 复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2015 年 1 月 6 日的互利 A 的份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于互利 A 折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除 2014 年约定收益后与 2015 年 1 月 7 日的前收盘价可能有较大差异，1 月 7 日当日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。

2、由于互利 A 份额新增份额折算成信用互利基金份额的场内份额数和信用互利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（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。持有较少互利 A 份额数或场内信用互利基金份额数的份额持有人存在无法获得新增场内信用互利基金份额的可能性。

3、投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请拨打本公司客户服务电话 400-888-8688，021-31089000 或登录本公司网站 www.gtfund.com 获取相关信息。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。
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

2014年12月29日