

国泰信用互利分级债券型证券投资基金可能发生基金份额到点折算的风险提示公告

根据《国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于基金份额到点折算的相关规定，当国泰信用互利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）之“互利B份额”（代码：150067）的基金份额净值大于或等于1.600元时，本基金信用互利基金份额（基金代码：160217，基金场内简称：国泰互利）、互利A份额（基金代码：150066，基金场内简称：互利A）及互利B份额（基金代码：150067，基金场内简称：互利B）将进行基金份额到点折算。

由于债券市场价格波动，截至2015年3月9日，互利B的基金份额净值接近基金合同规定的基金份额到点折算算阈值1.600元，因此本基金管理人敬请投资者密切关注互利B份额近期的净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对基金份额到点折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、本基金之互利A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。当发生基金合同规定的基金份额到点折算时，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。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的较低风险收益特征变为同时持有低风险收益特征份额与中低风险收益特征份额的情况。

二、本基金互利B份额表现为较高风险、收益相对较高的特征，当发生基金合同规定的基金份额到点折算时，折算前的互利B持有人，以互利B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B持有人的资产净值，其持有的互利B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。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的较高风险收益特征份额变为同时持有较高风险收益特征份额与中低风险收益特征份额的情况。

三、互利A份额、互利B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。基金份额到点折算后，其折溢价率可能发生变化。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。

四、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日互利B份额的净值可能与触发折算的阈值1.600元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、为保证折算期间本基金的平稳运作，本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互利A份额与互利B份额的上市交易和信用互利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份额到点折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《国泰信用互利分级债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）或者拨打本基金管理

人客服电话：400—888—8688。

二、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。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前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。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2015年3月11日