

关于中小板 300 成长交易型开放式指数 证券投资基金实施转型的提示性公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“我司”）旗下管理的中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”或“中小成长 ETF”)于 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 7 月 28 日以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。本次会议议案于 2015 年 7 月 29 日获表决通过,自该日起持有人大会决议生效。我司已于 2015 年 7 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）和基金管理人网站（www.gtfund.com）发布了《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

根据本次持有人大会决议,现将实施转型的相关事项提示如下:

一、本基金正式实施转型日为 2015 年 8 月 27 日。

二、关于基金合同等法律文件的修订

根据《关于中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,基金管理人已将《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议》分别修订为《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议》,并据此编制《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金招募说明书》。中小成长 ETF 已经中国证监会证监许可[2015]563 号(《关于准予中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》)准予变更注册。《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》、《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金托管协议》将自 2015 年 8 月 27 日起生效,原《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议》将自同一起失效。

三、关于选择期的安排和中小成长 ETF 终止上市交易

本次转型实施前的选择期为自 2015 年 7 月 30 日起,至 2015 年 8 月 26 日止,共 20 个工作日。选择期期间,中小成长 ETF 的申购、赎回业务及交易业务照常办理。基金份额持

有人在中小成长 ETF 正式实施转型前可选择卖出或赎回，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的中小成长 ETF 份额将默认转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的场内国泰新汽车份额。在选择期内，基金管理人根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期结束，基金管理人将按照深圳证券交易所、《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请终止上市。深圳证券交易所核准基金终止上市后，基金管理人将发布《中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金终止上市公告》。

中小成长 ETF 正式实施转型前，基金管理人将按照深圳证券交易所的有关规定向深圳证券交易所申请国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金简称、基金代码。

四、对基金份额持有人的影响和基金份额持有人享有的选择权

中小成长 ETF 转型前属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。中小成长 ETF 为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪中小板 300 成长指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

中小成长 ETF 转型后，转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（以下简称“新能源汽车指数分级基金”），新能源汽车指数分级基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。运作过程中，共有三类基金份额，分别为国泰新汽车份额、新汽车 A 份额、新汽车 B 份额。其中国泰新汽车份额为普通的股票型指数基金份额，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；新汽车 A 份额的预期风险和预期收益较低；新汽车 B 份额采用了杠杆式的结构，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

基金份额持有人在中小成长 ETF 正式实施转型前可选择卖出或赎回，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的中小成长 ETF 份额将默认转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金的场内国泰新汽车份额，并依据转型后生效的基金合同的有关约定，按照 1：1 的基金份额配比自动分离为新汽车 A 份额与新汽车 B 份额。

五、关于特定申购期的安排

自 2015 年 8 月 27 日《国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同》生效之日起，将安排不超过 1 个月的特定申购期。该期间只开放特定申购期申购，不开放赎回业务。

特定申购期申购与日常申购相比，不同点是对特定申购期申购的场内国泰新汽车份额

（如转型折算则以折算后份额计），在特定申购期结束后的第 2 个工作日，由基金管理人委托注册登记结构按照 1：1 的基金份额配比自动分离为新汽车 A 份额与新汽车 B 份额，无需基金份额持有人申请。日常申购的场内国泰新汽车份额，由基金份额持有人提交分拆业务申请并经确认后，方可分拆为新汽车 A 份额与新汽车 B 份额。

特定申购期结束后不超过 30 日，将开放日常申购、赎回业务。

五、重要提示

1、因中小成长 ETF 转型后将变更为股票指数分级基金，提请投资人、证券公司等各相关主体注意以中小成长 ETF 进行股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、融资融券等业务的风险，请在中小成长 ETF 转型的选择期间，及时作出调整及应对。

2、在选择期期间，由于中小成长 ETF 需应对卖出、赎回等情况，基金管理人可根据实际情况暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2015 年 7 月 30 日