

## 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期间的风险提示公告

国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）管理的中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：159917，以下简称“本基金”）目前已处于实施转型的选择期内，因此本基金管理人敬请投资者注意本基金近期基金份额参考净值（IOPV）与实际净值的跟踪偏离情况和产生的跟踪误差，以及可能发生现券赎空等情况，并警惕可能出现的风险。

针对本基金基金份额参考净值偏离和跟踪误差所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于近期 A 股市场波动较大，标的成份股可能出现大量停牌或流动性差等原因，使本基金无法及时调整投资组合，或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

二、目前本基金处于实施转型的选择期内，由于基金仓位调整等原因，IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，本基金的 IOPV 仅供投资人参考，IOPV 计算也可能不尽准确。投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

三、实施转型的选择期内，导致本基金产生跟踪偏离度与跟踪误差的其他原因还可能包括：投资过程中的证券交易成本、申购与赎回带来的现金变动，成份股取整等。

四、因近期标的成份股大量停牌导致流动性受限，本基金现金头寸不足时，可能会发生现券赎空的情况。

五、自 2015 年 8 月 27 日起，本基金将转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金。转型后基金将进入特定申购期，特定申购

期为转型后基金合同生效后不超过 1 个月的时间。该期间只开放特定申购期申购，不开放赎回业务。

六、由于本基金将在 2015 年 8 月 27 日起转型为国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金，将对基金持有的长期停牌股票等估值日没有市价，且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的股票，估值方法由按交易所收盘价调整为指数收益法。估值方法调整可能会导致基金净值波动，请投资者注意投资风险。

七、其他需要提示的事项：

(1) 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，本基金的申购、赎回业务及交易业务照常办理。在选择期内，本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。

(2) 如有疑问，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](http://www.gtfund.com)）获取相关信息。

八、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，并注意投资风险。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

二〇一五年八月十八日