

# 国泰国证有色金属行业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”）旗下国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称：有色B；交易代码：150197）二级市场交易价格较基金份额净值的溢价幅度较高，2020年3月19日，有色B份额在二级市场的收盘价为0.431元，相对于2020年3月19日0.3530元的基金份额净值，溢价幅度达到22.10%。截止2020年3月20日，有色B份额二级市场的收盘价为0.457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、有色B份额表现为高预期风险、高预期收益的特征。由于有色B份额内含杠杆机制的设计，有色B份额参考净值的变动幅度将大于国泰有色份额（场内简称：国泰有色，场内代码：160221）净值和有色A份额（场内简称：有色A，场内代码：150196）的份额净值的变动幅度，即有色B份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。有色B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。

2、有色B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。

3、截至2020年3月20日收盘，有色B份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值。不定期份额折算后，有色B份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日，国泰国证有色金属行业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，国泰国证有色金属行业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3月23日