

关于国泰中国企业高收益债券型证券投资基金投资外汇期货等金融衍生品的风险提示公告

根据有关法律法规及《国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金基金合同》的约定，为更好地进行组合管理，现就国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）投资外汇期货等金融衍生品相关风险提示如下：

本基金参与外汇期货等金融衍生品投资的风险包括但不限于：

（1）市场风险

期货衍生品价格可能因汇率波动、市场流动性不足或政策变化等因素与实际汇率变动方向不一致，导致对冲失效或成本增加。

（2）流动性风险

极端市场环境下，衍生品交易可能面临滑点或无法平仓的风险。

（3）操作风险

系统故障、人为失误或交易执行不当可能导致对冲策略偏离预期，甚至引发额外损失。

（4）对手方信用风险

若交易对手方出现违约或评级下调，可能影响衍生品合约的履行能力。

（5）法律与合规风险

监管政策调整或对衍生品交易的限制可能影响基金投资策略的执行。

（6）汇率政策风险

央行汇率调控措施（如中间价调整、跨境资本流动管制等）可能加剧汇率波动，导致对冲难度上升。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于基金前应认真阅读基金的《基金合同》、《招募说明书》，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

2025 年 6 月 24 日