

信诚中证 500 指数分级证券投资基金 办理不定期份额折算业务的公告

根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定，当信诚中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之中证 500B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 9 月 14 日，本基金中证 500B 份额的基金份额净值为 0.240 元，达到基金合同规定的不定期份额折算阈值 0.250 元。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 9 月 15 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 9 月 15 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的信诚 500 份额（场内简称：信诚 500，基础份额，代码：165511）、信诚中证 500 指数分级证券投资基金 A 份额（场内简称：中证 500A，代码：150028）和信诚中证 500 指数分级证券投资基金 B 份额（场内简称：中证 500B，代码：150029）。

三、基金份额折算方式

信诚 500 份额、中证 500A 份额、中证 500B 份额按照《基金合同》“第二十一部分、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将在基金份额折算日分别对信诚 500 份额、中证 500A 份额和中证 500B 份额进行份额折算，份额折算后中证 500A 份额和中证 500B 份额的比例仍保持 4：6 不变。份额折算后信诚 500 份额、中证 500A 份额和中证 500B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元，信诚 500 份额、中证 500A 份额和中证 500B 份额的份额数将得到相应的缩减。具体折算原则及公式如下：

当中证 500B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元时，信诚 500 份额、中证

500A 份额、中证 500B 份额将按照如下公式进行份额折算：

1)信诚 500 份额折算

$$\text{NUM 后 500} = (\text{NUM 前 500} \times \text{NAV 前 500}) / 1.000$$

信诚 500 份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；信诚 500 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2)中证 500A 份额折算

$$\text{折算后中证 500A 份额和中证 500B 份额的份额配比保持 4: 6 不变, 即: NUM 后 A} = \frac{2}{3} \times \text{NUM 后 B}$$

$$\text{中证 500A 份额持有人新增的信诚 500 份额数} = (\text{NUM 前 A} \times \text{NAV 前 A} - \text{NUM 后 A} \times 1.000) / 1.000$$

中证 500A 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。中证 500A 份额折算成信诚 500 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

3)中证 500B 份额折算

$$\text{NUM 后 B} = (\text{NUM 前 B} \times \text{NAV 前 B}) / 1.000$$

中证 500B 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

4)折算后信诚 500 份额的总份额数

$$\text{折算后信诚 500 份额的总份额数} = \text{不定期份额折算后信诚 500 份额的份额数} + \text{中证 500A 份额持有人新增的信诚 500 份额数}$$

(5) 举例

假设：某投资人持有场内信诚 500 份额、中证 500A 份额、中证 500B 份额分别为 10,000 份，10,000 份，15,000 份。在本基金的不定期份额折算基准日，假设三类份额的基金份额净值分别如下表所示（为便于投资者理解，此处采用假设的份额净值进行计算，基准日折算前准确的份额净值以当日日终基金管理人计算并经托管人复核的份额净值为准），份额折算后，信诚 500 份额、中证 500A 份额、中证 500B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值（假设值）	基金份额	基金份额净值	基金份额
信诚 500 份额	0.548 元	10,000 份	1.000 元	5,480 份信诚 500 份额
中证 500A 份额	1.016 元	10,000 份	1.000 元	2,360 份中证 500A 份额 +7,800 份信诚 500 份额
中证 500B 份额	0.236 元	15,000 份	1.000 元	3,540 份中证500B 份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即 2015 年 9 月 15 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务；中证 500A 和中证 500B 将于 2015 年 9 月 15 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 15 日上午 10:30 复牌。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 9 月 16 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务，中证 500A、中证 500B 暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 9 月 17 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务，中证 500A、中证 500B 将于 2015 年 9 月 17 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 17 日上午 10:30 复牌。

（四）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 9 月 17 日中证 500A、中证 500B 即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 16 日的中证 500A、中证 500B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)，2015 年 9 月 17 日当日中证 500A、中证 500B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

五、重要提示

1、本基金中证 500A、中证 500B 将于 2015 年 9 月 15 日上午 9:30 至 10:30 停牌一小时，

并于 2015 年 9 月 15 日上午 10:30 复牌。2015 年 9 月 16 日全天暂停交易。

本基金中证 500A、中证 500B 将于 2015 年 9 月 17 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 17 日上午 10:30 复牌。

2、2015 年 9 月 14 日，中证 500B 份额的基金份额净值已跌至 0.250 元以下，而折算基准日为 2015 年 9 月 15 日，因此中证 500B 份额折算基准日的份额净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

3、特别提示：近日中证 500B 份额二级市场交易价格溢价较大，在不定期份额折算后，中证 500B 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中证 500B 份额高溢价交易所带来的风险。

4、本基金中证 500B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，中证 500B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

5、本基金中证 500A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征。但在不定期份额折算后中证 500A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的中证 500A 份额变为同时持有较低风险收益特征的中证 500A 份额与较高风险收益特征的信诚 500 份额，因此原中证 500A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，信诚 500 份额为跟踪指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原中证 500A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，中证 500A 份额、中证 500B 份额、信诚 500 份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量中证 500A 份额、中证 500B 份额、信诚 500 份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

7、投资者若希望了解基金份额折算业务详情，可致电信诚基金管理有限公司客户服务电话 400-666-0066,或登录本公司网站 www.xcfunds.com 进行查询。

风险提示：

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。投资者投资基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。敬请投

投资者留意投资风险。

特此公告。

信诚基金管理有限公司

2015年9月15日