

关于信诚新双盈分级债券型证券投资基金折算方案的公告

根据《信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及《信诚新双盈分级债券型证券投资基金招募说明书》的规定，信诚新双盈分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）自《基金合同》生效之日起每4个月的开放日，基金管理人将对信诚新双盈分级债券型证券投资基金A份额（以下简称“新双盈A”）进行基金份额折算；自《基金合同》生效之日起每一年的运作周期到期日前，基金管理人将对信诚新双盈分级债券型证券投资基金B份额（以下简称“新双盈B”）进行基金份额折算。现将折算的具体事宜公告如下：

一、新双盈A的基金份额折算

1、折算基准日

新双盈A的每个开放日。

本次新双盈A的基金份额折算基准日与其第六个运作周年的第三个开放日为同一个工作日，即2019年5月9日。

2、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的所有新双盈A份额。

3、折算频率

新双盈A的每个开放日折算一次。

新双盈A的开放日为基金合同生效日起每4个月的对日。如该日为非工作日，则开放日为该日之前的最后一个工作日。

4、折算方式

在折算基准日日终，新双盈A的份额（参考）净值将调整为1.000元，折算前新双盈A份额的基金份额净值超出1.000元的部分将按新双盈A折算后的份额（参考）净值（1.000元）折算为新双盈A的基金份额并分配给新双盈A的份额持有人。新双盈A的份额折算公式如下：

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000 \text{ 元}$$

$$\text{新双盈A的折算比例} = NAV_A^{\text{前}} / 1.000$$

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}} \times \text{新双盈A的折算比例}$$

其中：

$NAV_A^{\text{后}}$ ：份额折算后新双盈 A 的份额（参考）净值；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前新双盈 A 的份额（参考）净值；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后新双盈 A 的份额余额；

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前新双盈 A 的份额余额；

新双盈 A 经折算后的份额数按照四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

新双盈 A 在开放日折算比例将保留到小数点后 9 位。

除保留位数因素影响外，基金份额折算对新双盈 A 持有人的权益无实质性影响。

在实施基金份额折算后，新双盈 A 折算比例的具体计算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

二、新双盈 B 的基金份额折算

1、折算基准日

根据基金合同的规定，假设新双盈 B 的开放日为 T 日，则其折算基准日为 T-2 工作日。本次新双盈 B 的开放日为 2019 年 5 月 9 日，其基金份额折算基准日为 2019 年 5 月 7 日。

2、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的所有新双盈 B 份额。

3、折算频率

每个运作周年到期日前第二个工作日折算一次。

4、折算方式

在折算基准日日终，新双盈 B 的份额（参考）净值将调整为 1.000 元，新双盈 B 份额持有人持有的新双盈 B 的份数将相应调整。

新双盈 B 的基金份额折算公式如下：

$$NAV_B^{\text{后}} = 1.000 \text{ 元}$$

$$\text{新双盈 B 的折算比例} = NAV_B^{\text{前}} / 1.000$$

$$\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{后}} = \text{NUM}_{\text{B}}^{\text{前}} \times \text{新双盈 B 的折算比例}$$

其中：

$\text{NAV}_{\text{B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新双盈 B 的份额（参考）净值，下同

$\text{NAV}_{\text{B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新双盈 B 的份额（参考）净值，下同

$\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新双盈 B 的份额余额，下同

$\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新双盈 B 的份额余额，下同

新双盈 B 经折算后的份额数按照四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

新双盈 B 的折算比例将保留到小数点后 9 位，除保留位数因素影响外，基金份额折算对新双盈 B 份额持有人的权益无实质性影响。

在实施基金份额折算后，新双盈 B 折算比例的具体计算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

风险提示：

- 1、若近期市场出现异常波动，导致本折算方案不适用，本公司将另行公告。
- 2、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时应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。敬请投资者留意投资风险。

投资者若希望了解基金份额折算业务详情，可致电中信保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.citicprufunds.com.cn 进行查询。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2019 年 4 月 30 日