

关于调整中信建投中证北京 50 交易型开放式指数证券投资基金交易 结算模式的公告

根据上海证券交易所于 2020 年 1 月 7 日公告的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》（以下简称“《实施细则》”）、中国证券登记结算有限责任公司发布的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及《中信建投中证北京 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定，自 2020 年 1 月 20 日起，中信建投基金管理有限公司（以下简称“本公司”）将调整中信建投中证北京 50 交易型开放式指数证券投资基金（基金主代码：512850，以下简称“本基金”）的交易结算模式，现将相关事项公告如下：

1、本公司按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的最新业务方案，在交易结算模式上做出的重大调整如下：

（1）对申购当日未卖出的 ETF 份额和深市组合证券的现金替代，由 T+1 日非担保结算调整为净额担保结算；

（2）对赎回涉及的深市组合证券的现金替代，由代收代付调整成净额担保结算；

（3）对本基金交易及纳入净额结算的基金申购赎回的结算模式由 T+0 待交收制度调整为 A 股模式。

2、本次交易结算模式调整后，投资人交易、申购、赎回本基金应遵守下列规定：

（1）当日成功申购的基金份额，同日可以卖出，但不得赎回；

（2）当日买入的基金份额，同日可以赎回，但不得卖出；

（3）当日成功赎回本基金获得的沪市成分股，同日可以卖出，但不得用于申购基金份额；

（4）当日买入的沪市成分股，同日可以用于申购基金份额，但不得卖出。

3、根据本基金基金合同约定，相关登记机构及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金按照新规定执行，且相关修改无须召开基金份额持有人大会。

4、本公告仅对本次交易结算模式调整的有关事项进行说明，本公司将根据相关法律法规，在本基金更新的招募说明书中，对涉及上述修改的内容进行相应调整。

5、本公告解释权归基金管理人。投资者欲了解基金信息，可访问本公司网站（www.cfund108.com）或拨打本公司客服电话（4009-108-108）咨询相关情况。

风险提示：

1、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》（包括其不时修订）、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）及中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所发布的其他相关规则 and 规定本基金最新适用的业务规则，敬请投资人仔细阅读并理解相关规则的变化细节。

2、请投资人特别关注第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

（1）申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资人申购赎回服务的风险。

（2）登记机构调整结算制度，如对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

3、在调整后的业务规则下，投资人应特别注意其申购/买入本基金时资金不足、赎回/卖出本基金时基金份额不足进而导致申购赎回代理券商等结算参与人资金不足、本基金基金份额不足致使结算参与人资金交收违约、证券交收违约的风险，投资人证券账户的转指定或转托管权限及其他权利或受到影响。极端情形下，登记机构不对本基金或投资人所在的结算参与人提供多边净额结算服务，由此会致使申购赎回交收时间、交收方式的改变，可能会影响投资人的经济利益。投资者申购、赎回、交易本基金即表示对此种证券变更登记及交收方式的安排已经认可。

4、投资人应特别注意本次交易结算模式调整的过渡安排。2020年1月17日发生的申购未卖出ETF份额及深市现金替代，纳入2020年1月20日的逐笔全额结算处理；发生的赎回业务涉及的深市现金替代，仍按照代收代付处理。

5、本公司承诺以诚实信用、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。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于本基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

中信建投基金管理有限公司

2020年1月17日