

---

# 信诚中证 500 指数分级证券投资基金

## 更新招募说明书

### 重要提示

信诚基金管理有限公司经中国证监会批准于2005年9月30日注册成立。因业务发展需要，经国家工商总局核准，公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”（以下简称“我司”），并由上海市工商行政管理局于2017年12月18日核发新的营业执照。

根据《中华人民共和国合同法》第七十六条的规定，合同当事人名称变动不影响合同义务的履行。本次我司名称变更后，以“信诚基金管理有限公司”或“中信保诚基金管理有限公司”签署的法律文件（包括但不限于公司章程、公告等，以下简称“原法律文件”）不受任何影响，我司将按照约定履行权利义务。如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别说明的，以原法律文件的说明为准。

本基金的募集申请经中国证监会2010年12月21日证监许可2010[1877]号文核准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包

括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》及《基金产品资料概要》。

基金产品资料概要的编制、披露及更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书根据本基金管理人于2020年11月18日披露的《关于信诚中证500指数分级证券投资基金修订基金合同的公告》及基金合同修订了相关章节，相关修订内容自2020年11月19日起生效，其余所载内容截止日若无特别说明为2020年2月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日（未经审计）。

**基金管理人：中信保诚基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

## 目 录

第一部分	绪言 .....	1
第二部分	释义 .....	1
第三部分	基金管理人 .....	7
第四部分	基金托管人 .....	14
第五部分	相关服务机构 .....	17
第六部分	基金份额分级 .....	19
第七部分	基金的募集 .....	22
第八部分	基金合同的生效 .....	22
第九部分	信诚中证 500 份额的申购与赎回 .....	23
第十部分	信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的上市交易 .....	34
第十一部分	基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务 .....	36
第十二部分	基金的份额配对转换 .....	37
第十三部分	基金的投资 .....	39
第十四部分	基金的业绩 .....	53
第十五部分	基金的财产 .....	55
第十六部分	基金资产估值 .....	56
第十七部分	基金的收益与分配 .....	62
第十八部分	基金费用与税收 .....	63
第十九部分	基金份额折算 .....	65
第二十部分	信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的终止运作 .....	71
第二十一部分	基金的会计与审计 .....	74
第二十二部分	基金的信息披露 .....	74
第二十三部分	风险揭示 .....	80
第二十四部分	基金合同的变更、终止与基金财产清算 .....	88
第二十五部分	基金合同的内容摘要 .....	91
第二十六部分	基金托管协议的内容摘要 .....	107
第二十七部分	对基金份额持有人的服务 .....	120

<b>第二十八部分</b>	<b>其他应披露事项</b> .....	<b>122</b>
<b>第二十九部分</b>	<b>招募说明书的存放及查阅方式</b> .....	<b>125</b>
<b>第三十部分</b>	<b>备查文件</b> .....	<b>125</b>

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指信诚中证500指数分级证券投资基金
2. 基金管理人：指中信保诚基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《信诚中证500指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6. 招募说明书：指《信诚中证500指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新

7. 基金份额发售公告：指《信诚中证500指数分级证券投资基金份额发售公告》

8. 上市交易公告书：指《信诚中证500指数分级证券投资基金之信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额上市交易公告书》

9. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10. 《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11. 《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12. 《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13. 《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14. 《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日发布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及发布机关对其不时做出的修订

15. 流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

16. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
18. 中证500指数：指由上海和深圳证券交易所中选取500只A股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。中证500指数由中证指数有限公司编制并发布
19. 基金份额分级：指本基金的基金份额包括信诚中证500指数证券投资基金之基础份额、信诚中证500指数证券投资基金之A份额与信诚中证500指数证券投资基金之B份额。其中，信诚中证500指数证券投资基金之A份额与信诚中证500指数证券投资基金之B份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变
20. 信诚中证500份额：指信诚中证500指数证券投资基金之基础份额
21. 信诚中证500 A份额：指本基金份额按《基金合同》约定规则所分离的稳健收益类基金份额
22. 信诚中证500 B份额：指本基金份额按《基金合同》约定规则所分离的积极收益类基金份额
23. 基金合同当事人：指受基金合同约定，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
24. 个人投资者：指年满18周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可投资于证券投资基金的自然人
25. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
26. 合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于中国证券市场并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境外的机构投资者
27. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
28. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
29. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

30. 销售机构：指直销机构和代销机构
31. 直销机构：指中信保诚基金管理有限公司
32. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位
33. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
34. 场外：指以交易所开放式基金交易系统以外的方式、通过销售机构办理基金销售业务的场所
35. 场内：指以交易所开放式基金交易系统的方式、通过销售机构办理基金销售业务的场所
36. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
37. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为中信保诚基金管理有限公司或接受中信保诚基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
38. 注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统
39. 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
40. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
41. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户
42. 深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户
43. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期



44. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

45. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

46. 存续期：指基金合同生效后合法存续的期限。本基金的存续期间为不定期

47. 日/天：指公历日

48. 月：指公历月

49. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

50. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

51. T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

52. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

53. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

54. 发售：指在基金募集期内，销售机构向投资人销售信诚中证500份额的行为

55. 认购：指在基金募集期内，投资人通过场外或场内申请购买信诚中证500份额的行为

56. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定通过场外或场内申请购买信诚中证500份额的行为

57. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求通过场外或场内将信诚中证500份额兑换为现金的行为

58. 份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的信诚中证500份额与信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

59. 分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每十份信诚中证500份额的场内份额申请转换成四份信诚中证500 A份额与六份信诚中证500 B份额的行为

60. 合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每四份信诚中证500 A份额与六份信诚中证500 B份额进行配对申请转换成十份信诚中证500份额的场内份额的行为

61. 会员单位：指具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位

62. 上市交易：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的行为

63. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记

64. 系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

65. 跨系统转登记：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

66. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

67. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

68. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

69. 元：指人民币元

70. 基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额

71. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

72. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

73. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

74. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

75. 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

76. 不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况

77. 基金产品资料概要：指《信诚中证500指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

成立日期：2005年9月30日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142号

注册资本：2亿元人民币

电话：（021）6864 9788

联系人：唐世春

股权结构：

股 东	出资额 ( 万元人民币 )	出资比例 ( % )
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合 计	20000	100

### 二、主要人员情况

#### 1. 董事会成员

张翔燕女士，董事长，工商管理硕士。历任中信银行总行综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限

责任公司副总裁，中国中信集团有限公司业务协同部主任，中信信托有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

王道远先生，董事，工商管理硕士。历任中信信托有限责任公司综合管理部总经理、信托管理部总经理、总经理助理、董事会秘书、副总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理、董事会秘书、固有业务审查委员会主任兼天津信唐货币经纪有限责任公司董事长。

Wai Kwong SECK (石怀光) 先生，董事，新加坡籍，工商管理硕士。历任新加坡星展银行常务董事、美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院资深院士、新加坡交易所执行副总裁兼首席财务官、道富银行和信托公司亚太区首席执行官。现任瀚亚投资首席执行官、瀚亚投资管理(上海)有限公司董事、瀚亚海外投资基金管理(上海)有限公司董事。

魏秀彬女士，董事，新加坡籍，工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司亚太地区风险及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官、瀚亚投资管理(上海)有限公司监事、瀚亚海外投资基金管理(上海)有限公司监事。

唐世春先生，董事，总经理，法学硕士。历任北京天平律师事务所律师，国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管，友邦华泰基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书，中信保诚基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、副总经理兼首席市场官。现任中信保诚基金管理有限公司总经理。

金光辉先生，独立董事，澳大利亚籍，商科硕士。历任汇丰银行资本市场总监，香港机场管理局财务总经理、战略规划与发展总经理、航空物流总经理，南华早报集团首席财务官，信和置业集团集团财务和家庭办公室主任。现任中信保诚基金管理有限公司独立董事。

夏执东先生，独立董事，经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所管委会副主席。

杨思群先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员，现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

注：原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务”自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资，其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

## 2、监事

於乐女士，执行监事，经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行营业管理部主管、通用电气金融财务（中国）有限公司人力资源经理。现任中信保诚基金管理有限公司首席人力资源官。

## 3、经营管理层人员情况

张翔燕女士，董事长，工商管理硕士。历任中信银行总行综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长，中信银行总行营业部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限责任公司副总裁，中国中信集团有限公司业务协同部主任，中信信托有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

唐世春先生，董事，总经理，法学硕士。历任北京天平律师事务所律师，国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管，友邦华泰基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书，中信保诚基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、副总经理兼首席市场官。现任中信保诚基金管理有限公司总经理。

桂思毅先生，副总经理，工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员，中乔智威汤逊广告有限公司财务主管，德国德累斯登银行上海分行财务经理，中信保诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任中信保诚基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、首席财务官，中信信诚资产管理有限公司董事。

潘颖女士，副总经理，理学硕士。历任中信银行零售银行资产管理部负责人，中信集团业务协同部二处处长，中信保诚基金管理有限公司总经理助理。现任中信保诚基金管理有限公司副总经理。

陈逸辛先生，首席信息官，工学硕士。历任上海致达信息产业股份有限公司软件事业部总经理，上海众城聚合信息技术有限公司总经理，中信保诚基金管理有限公司信息技术总监、信息技术总监兼电子商务总监、副首席运营官、首席运营官。现任中信保诚基金管理有限公司首席信息官、首席运营官。

## 4、督察长

周浩先生，督察长，法学硕士。历任中国证券监督管理委员会公职律师、副调研员，上海航运产业基金管理有限公司合规总监，国联安基金管理有限公司督察长。现任中信保诚基金管理有

限公司督察长，中信信诚资产管理有限公司董事。

#### 5. 基金经理

黄稚女士，理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司，担任资产管理部产品经理；于平安证券有限责任公司，担任产品经理。2015年6月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚中证建设工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

吴雅楠先生，自2011年2月11日至2015年3月27日担任本基金基金经理。

杨旭先生，自2015年1月15日至2018年9月28日担任本基金基金经理。

#### 6. 投资决策委员会成员

胡喆女士，总经理助理、首席投资官、特定资产投资总监；

韩海平先生，总经理助理、固定收益负责人、基金经理；

范楷先生，总经理助理、多策略与组合投资部总监；

殷孝东先生，投行部董事总经理、基金经理；

提云涛先生，量化投资总监、基金经理；

王睿先生，权益投资部副总监、基金经理；

吴昊先生，研究部副总监、基金经理；

董越先生，交易总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续；

3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制季度报告、中期报告和年度报告；
7. 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

#### 四、基金管理人的承诺

1. 基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2. 基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内

容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人内部控制制度

### 1. 内部控制的总体目标和原则

公司内部控制制度，是指公司为了保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内控机制和一系列内部运作程序、措施和方法等文本制度的总称。内部控制的总体目标是：建立一个决策科学、营运高效、稳健发展的机制，使公司的决策和运营尽可能免受各种不确定因素或风险的影响。内部控制遵循以下原则：

**全面性原则：**内部控制渗透到公司的决策、执行和监督层次，贯穿了各业务流程的所有环节，覆盖了公司所有的部门、岗位和各级人员。

**有效性原则：**各项内部控制制度必须符合国家和主管机关所制定的法律法规和规章，不得与之相抵触；具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。

**相互制约原则：**在公司的各个部门之间、各业务环节及重要岗位体现相互监督、相互制约，做到公司决策、执行、监督体系的分离以及公司各职能部门中关键部门、岗位的设置分离（如交易执行部门和基金清算部门的分离、直接操作人员和控制人员的分离等），形成权责分明、相互牵制的局面，并通过切实可行的相互制衡措施来降低各种内控风险的发生。

**及时性原则：**内部控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化而不断修正，并随国家法律、法规、政策等外部环境因素的改变及时进行相应的修改和完善；

**成本效益原则：**公司将充分发挥各机构、各部门及广大员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

**防火墙原则：**公司基金投资、基金交易、投资研究、市场开发、绩效评估等相关部门，应当在空间和制度上适当分离，以达到防范风险的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的审批程序和监管措施。

### 2. 风险防范体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构，并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级



风险防范体系：

### (1) 一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风控与审计委员会，对公司经营管理与基金运作的合规性进行全面和重点的分析检查，发现其中存在的和可能出现的风险，并提出改进方案。

公司设督察长。督察长对董事会负责，组织、指导公司监察稽核和风险管理工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况，并定期或不定期地向董事会或者董事会下设的相关专门委员会报告工作。

### (2) 二级风险防范

二级风险防范是指在公司风险管理委员会、投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。

总经理下设风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，制定相应的风险管理制度并监督制度的执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。

总经理下设投资决策委员会，研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。

监察稽核部和风险管理部在督察长指导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。

### (3) 三级风险防范

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

### 3. 基金管理人关于风险管理和内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及

管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于风险管理和内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项

重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中

心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### (二) 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### (三) 内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信

息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### (一) 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### (二) 监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1. 场外发售机构

(1) 直销机构

中信保诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

电话：（021）6864 9788

联系人：蒋焱

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的赎回业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：[www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)

(2) 销售机构

本基金的其他销售机构请详见基金管理人官网公示。

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并在基金管理人网站公示。

2. 场内发售机构：深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位，具体名单见本基金份额发售公告。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：( 021 ) 31358666

传真：( 021 ) 31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层

办公地址：北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层

法定代表人：邹俊

电话：8621 2212 2888

传真：8621 6288 1889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、叶凯韵

## 第六部分 基金份额分级

本基金的基金份额分级及其基本运作如下。

### 一、基金份额结构

本基金的基金份额包括“信诚中证500份额”、“信诚中证500 A份额”与“信诚中证500 B份额”。其中，信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变。

### 二、基金的基本运作概要

1. 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全份额将确认

为信诚中证500份额；场内认购的全部份额将按4:6的比例确认为信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额。（具体认购方法参见发售公告）

2. 本基金合同生效后，信诚中证500份额接受场外与场内申购和赎回；信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额只上市交易，不接受申购和赎回。

3. 本基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理信诚中证500份额与信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额之间的份额配对转换业务。

4. 本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额配比不变。

### 三、信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额概要

#### 1. 存续期限

自基金合同生效之日起存续。

#### 2. 基金份额配比

信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变。

#### 3. 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算

信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额具有不同的净值计算规则，即信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的风险和收益特征不同。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额分别进行基金份额净值计算。

本基金净资产优先分配信诚中证500 A份额的本金及信诚中证500 A份额的约定收益，本基金在优先分配信诚中证500 A份额的本金及信诚中证500 A份额的约定收益后的剩余净资产分配予信诚中证500 B份额。

信诚中证500 A份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率（税后）加上3.2%。其中计算信诚中证500 A份额约定收益率的一年期银行定期存款年利率是指基金合同生效日或生效后每个运作周年的最后一个工作日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。



例如：若本基金合同生效日为2011年1月21日，则以2011年1月21日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率（税后）加计3.2%作为第一个运作周年（2011年1月21日至2012年1月20日）的约定年收益率。若第一个运作周年的最后一个工作日为2012年1月20日，则以2012年1月20日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率（税后）加计3.2%作为下一个运作周年的约定年收益率，依此类推。

信诚中证500 A份额的约定年收益率除以运作周年实际天数得到信诚中证500 A份额的约定日收益率。信诚中证500 A份额的基金份额净值以1.000元为基础，采用信诚中证500 A份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算。其中，运作周年指自基金合同生效日或最近一个定期份额折算日次日起每满一周年的运作期间，运作周年实际天数为该期间的实际天数。信诚中证500 A份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数。

基金管理人并不承诺或保证信诚中证500 A份额的约定收益，如在本基金存续期内基金资产出现极端损失的情况下，信诚中证500 A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

#### (1) 信诚中证500份额的基金份额净值计算公式

T日信诚中证500份额的基金份额净值 = T日闭市后的基金资产净值 / T日本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额）的基金份额余额总数

#### (2) 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算公式

假设T日为基金份额净值计算日， $t = \min(\text{自基金合同生效日至T日}, \text{自最近一个份额折算日次日至T日})$ ， $NAV_{500 t}$ 为T日信诚中证500份额的基金份额净值， $NAV_{A t}$ 为T日信诚中证500 A份额的基金份额净值， $NAV_{B t}$ 为T日信诚中证500 B份额的基金份额净值， $R_{\text{年}}$ 为信诚中证500 A份额的约定年收益率。

$$NAV_{A t} = 1 + R_{\text{年}} \times \frac{t}{\text{运作周年实际天数}}$$

$$NAV_{B t} = (NAV_{500 t} - 0.4 \times NAV_{A t}) / 0.6$$

信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

### (3) 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值公告

信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在下一日内与信诚中证500份额的基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 4. 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

## 第七部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同，经中国证监会证监许可[2010]1877号文件核准募集。

本基金的实际募集期为2011年1月6日至2011年1月28日。本次募集的净认购金额为374,118,554.71元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计135,745.39元人民币。

本次募集有效认购总户数为3,763户。按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集发售期募集的有效份额为374,118,554.71份基金份额，利息结转的基金份额为135,745.39份基金份额。两项合计共374,254,300.10份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 第八部分 基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同已于2011年2月11日正式生效。

基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者

终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律另有规定的，从其规定。

## 第九部分 信诚中证 500 份额的申购与赎回

本基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对信诚中证500份额进行申购与赎回。信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额只上市交易，不接受申购与赎回。

### 一、信诚中证 500 份额申购和赎回场所

投资人办理信诚中证500份额场外申购与赎回业务的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构。

投资人办理信诚中证500份额场内申购与赎回业务的场所为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理场外申购、赎回业务；需使用深圳证券账户办理场内申购、赎回业务，其中，深圳证券账户是指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

本基金场外、场内代销机构名单将由基金管理人在发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。

投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理信诚中证500份额的申购与赎回。若基金管理人或其委托的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行信诚中证500份额的申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

申购与赎回的开放日是指为投资人或信诚中证500份额持有人办理信诚中证500份额申购、赎回等业务的上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日（基金管理人根据相关法律法规及基金合

同的规定公告暂停信诚中证500份额申购、赎回时除外)。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 2. 信诚中证500份额申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金于2011年3月14日开始办理基金日常申购赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理信诚中证500份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请并被受理的,其信诚中证500份额申购、赎回价格为下一开放日信诚中证500份额申购、赎回的价格。

## 三、信诚中证 500 份额申购与赎回的原则

1. “未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的信诚中证500份额的基金份额净值为基准进行计算;

2. “金额申购、份额赎回”原则,即信诚中证500份额的申购以金额申请,赎回以份额申请;

3. 信诚中证500份额持有人在场外销售机构赎回信诚中证500份额时,遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4. 当日信诚中证500份额的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销,在当日业务办理时间结束后不得撤销;

5. 投资人办理信诚中证500份额场外申购、赎回应使用基金账户,办理信诚中证500份额场内申购、赎回应使用深圳证券账户;

6. 投资人办理信诚中证500份额的场内申购、赎回业务时,需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,按新规定执行;

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可依法更改上述原则,但应在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 四、信诚中证 500 份额申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出信诚中证500份额申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构和深圳证券交易所规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的信诚中证500份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司作为注册登记机构代为办理注册登记业务。注册登记机构应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，如投资人未进行前述查询，因申请未得到注册登记机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，本基金注册登记机构可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人委托的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### 五、信诚中证 500 份额申购和赎回的数额和价格

##### 1. 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

(1) 投资人在办理信诚中证500份额场内申购时，单笔申购的最低金额为1,000元人民币。投资人办理信诚中证500份额场外申购时，单笔最低金额调整为1元人民币(含申购费)，追加申

购最低金额调整为1元人民币（含申购费）。通过直销中心首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1000元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等情形导致被动达到或超过50%的除外）。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（2）基金份额持有人在办理场外赎回时，赎回最低份额为1份，基金份额持有人在销售机构（网点）保留的基金份额不足1份的，登记系统有权将全部剩余份额自动进行强制赎回处理。

2. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前2日依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上公告。

3. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或信诚中证500份额单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

#### 4. 信诚中证500份额的申购份额计算

信诚中证500份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。注册登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。计算公式如下：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{日基金份额净值}$$

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担；通过场内方式进行申购的，申购份额计算结果采用截尾法保留至整数位，不足 1 份部分对应的申购资金将返还给投资人。

例一：某投资人通过场外投资 5,000 元申购信诚中证 500 份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日信诚中证 500 份额的基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71$  元

申购费用 =  $5,000 - 4,940.71 = 59.29$  元

申购份数 =  $4,940.71 / 1.128 = 4,380.06$  份

即：该投资人通过场外投资 5,000 元申购信诚中证 500 份额，假设申购当日信诚中证 500 份额的基金份额净值为 1.128 元，则可得到 4,380.06 份信诚中证 500 份额。

例二：某投资人通过场内投资 10,000 元申购信诚中证 500 份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日信诚中证 500 份额的基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 =  $10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42$  元

申购手续费 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.58$  元

申购份额 =  $9,881.42 / 1.025 = 9,640.41$  份

因场内申购份额计算结果采用截尾法保留至整数份，故投资人申购所得份额为 9,640 份，不足 1 份部分对应的申购资金将返还给投资人。具体计算公式为：

实际净申购金额 =  $9,640 \times 1.025 = 9,881$  元

退款金额 =  $10,000 - 9,881 - 118.58 = 0.42$  元

即：该投资人投资 10,000 元从场内申购信诚中证 500 份额，假设申购当日信诚中证 500 份额的基金份额净值为 1.025 元，则其可得到信诚中证 500 份额 9,640 份，退款 0.42 元。

## 5. 信诚中证500份额的赎回金额计算

投资人在赎回信诚中证500份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费}$$

赎回金额单位为元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

例三：某信诚中证500份额持有人持有10,000份信诚中证500份额一年后(未满2年)决定从场外赎回，对应的赎回费率为0.25%，假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值是1.148元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.148 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.25\% = 28.70 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480 - 28.70 = 11,451.30 \text{ 元}$$

即：该信诚中证500份额持有人持有10,000份信诚中证500份额一年后(未满2年)从场外赎回，假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值是1.148元，则可得到的净赎回金额为11,451.30元。

例四：某信诚中证500份额持有人从场内赎回10,000份信诚中证500份额，赎回费率为0.5%，假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.148元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.148 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.5\% = 57.40 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480 - 57.40 = 11,422.60 \text{ 元}$$

即：该信诚中证500份额持有人从深圳证券交易所场内赎回10,000份信诚中证500份额，假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.148元，则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

## 6. 信诚中证500份额的基金份额净值计算

信诚中证500份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，



由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 六、信诚中证 500 份额申购与赎回的费用

1. 信诚中证500份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。信诚中证500份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产，对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，其中不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2. 根据基金合同的规定，信诚中证500份额的申购费率不超过申购金额的5%，赎回费率不超过赎回金额的5%，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费。

3. 信诚中证500份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额	场外申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<200万	0.8%
200万≤M<500万	0.4%
M≥500万	1000元/笔

(注：M：申购金额；单位：元)

信诚中证500份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

为更好地满足投资者的理财需求，根据相关基金基金合同、招募说明书的有关规定，本公司决定自2015年12月1日起，针对旗下现有所有指数分级证券投资基金基础份额的场内申购费率实施费率优惠，优惠活动截止日期另行公告。

调整后信诚中证500指数分级证券投资基金场内申购费率如下：

单笔申购金额	申购费率
M < 100万	0
100万 ≤ M < 200万	0
200万 ≤ M < 500万	0

M≥500万	0
--------	---

4. 信诚中证500份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：

持有时间	场外赎回费率
Y < 7天	1.5%
7天 ≤ Y < 1年	0.5%
1年 ≤ Y < 2年	0.25%
Y ≥ 2年	0

(注：Y：持有时间，其中1年为365日，2年为730日)

信诚中证500份额的场内赎回费率为固定值0.5%，对持续持有期少于7日的赎回费率为1.5%。

从场内转托管至场外的信诚中证500份额，从场外赎回时，其持有期限从注册登记机构登记的原场内份额登记确认日开始计算。

5. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低信诚中证500份额的申购费率和赎回费率。

6. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前2日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者对信诚中证500份额的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人合理判断认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受信诚中证500份额的申购申请。

7. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。

8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述1、2、3、5、6、8项情形之一，并且基金管理人决定暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的信诚中证500份额赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受信诚中证500份额的赎回申请。

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足

额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例支付给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过20个工作日，并在指定媒介上公告。投资人在场外申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以延期赎回或取消赎回。在暂停赎回的情况消除后，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的信诚中证500份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额(包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额)的10%，即为巨额赎回。

### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，按照投资人在提交赎回申请时事先选择的延期赎回或取消赎回区别处理，选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

当基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额（包括信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额，下同）10% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请：对于该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 10% 以上的那部分赎回申请，基金管理人可以进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（3）暂停赎回：信诚中证 500 份额连续 2 日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受信诚中证 500 份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登信诚中证 500 份额重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（包括 2 周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上刊登信诚中证 500 份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登信诚中证 500 份

额重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的信诚中证500份额的基金份额净值。

## 十一、基金转换

在法律法规及监管机构允许且相关注册登记机构业务规则允许的情况下，本基金管理人可以开展信诚中证500份额与其它基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十二、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理信诚中证500份额定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理信诚中证500份额定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 第十部分 信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的上市交易

### 一、上市交易的基金份额

本基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的上市交易。

### 二、上市交易的地点

深圳证券交易所

### 三、上市交易的时间

2011年3月14日

### 四、上市交易的规则

1. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额分别采用不同的交易代码上市交易；
2. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额净值；

3. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

4. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额买入申报数量为100份或其整数倍；

5. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币；

6. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

## 五、上市交易的费用

信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

## 六、上市交易的行情揭示

信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

## 七、上市交易的注册登记

投资人T日买入成功后，注册登记机构在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人T日卖出成功后，注册登记机构在T日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

## 八、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

九、相关法律法规、中国证监会及深圳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，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。

十、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功

能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 第十一部分 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务

### 一、基金份额的登记

1. 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转登记从场内转入的信诚中证500份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额以及场内认购、申购或通过跨系统转登记从场外转入的信诚中证500份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人的深圳证券账户下。

2. 登记在证券登记结算系统中的信诚中证500份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的信诚中证500份额可以申请场外赎回。

3. 登记在证券登记结算系统中的信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。

### 二、系统内转托管

1. 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

2. 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理信诚中证500份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有信诚中证500份额的系统内转托管。

3. 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额上市交易或信诚中证500份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4. 募集期内不得办理系统内转托管。

5. 基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

### 三、跨系统转登记



1. 跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的信诚中证500份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2. 信诚中证500份额跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3. 募集期内不得办理跨系统转登记。

4. 基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### **四、基金的非交易过户**

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### **五、基金的冻结和解冻**

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## **第十二部分 基金的份额配对转换**

本基金合同生效后，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

**一、份额配对转换是指本基金的信诚中证 500 份额与信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。**

1. 分拆。基金份额持有人将其持有的每十份信诚中证500份额的场内份额申请转换成四份信诚中证500 A份额与六份信诚中证500 B份额的行为。

2. 合并。基金份额持有人将其持有的每四份信诚中证500 A份额与六份信诚中证500 B份额进行配对申请转换成十份信诚中证500份额的场内份额的行为。

## 二、份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。

投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、注册机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

## 三、份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自基金合同生效后不超过6个月的时间内开始办理，基金管理人将在开始办理份额配对转换前2日在指定媒介公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体业务办理时间见招募说明书，在招募说明书规定的上述时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间、交易规则或注册登记机构规则更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

## 四、份额配对转换的原则

1. 份额配对转换以份额申请。
2. 申请进行“分拆”的信诚中证500份额的场内份额必须是10的整数倍。
3. 申请进行“合并”的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且两者的比例为4：6。
4. 信诚中证500份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转登记为信诚中证500份额的场内份额后方可进行。
5. 份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前2日在指定媒介公告。

## 五、份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

## 六、暂停份额配对转换的情形

1. 基金管理人认为继续接受份额配对转换可能损害基金份额持有人利益时决定暂停份额配对转换的情形。

2. 其他基金管理人出于保护投资人利益的角度，决定暂停份额配对转换的情形。

3. 深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务的情形。

4. 法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

## 七、份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可按照不高于0.3%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用，具体见相关业务公告。

# 第十三部分 基金的投资

## 一、投资目标

本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证500指数的有效跟踪，为投资者提供一个投资中证500指数的有效工具。

## 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的

90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、投资策略

本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在中证500 指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1) 基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回

回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。

#### 四、标的指数与业绩比较基准

##### 1. 标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证500指数。

中证500指数是由上海和深圳证券交易所中选取500只A股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

如果中证500指数被停止编制及发布，或中证500指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证500指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更合适投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益并履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

##### 2. 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证500指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定媒介上公告。

#### 五、风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚

中证500 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；信诚中证500 B份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 六、投资决策与投资管理流程

### 1. 投资决策依据

以《基金法》和本基金基金合同等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

### 2. 投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金投资的整体策略和原则，审定基金定期投资检讨报告及决定基金禁止的投资事项等。基金经理负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

### 3. 投资管理流程

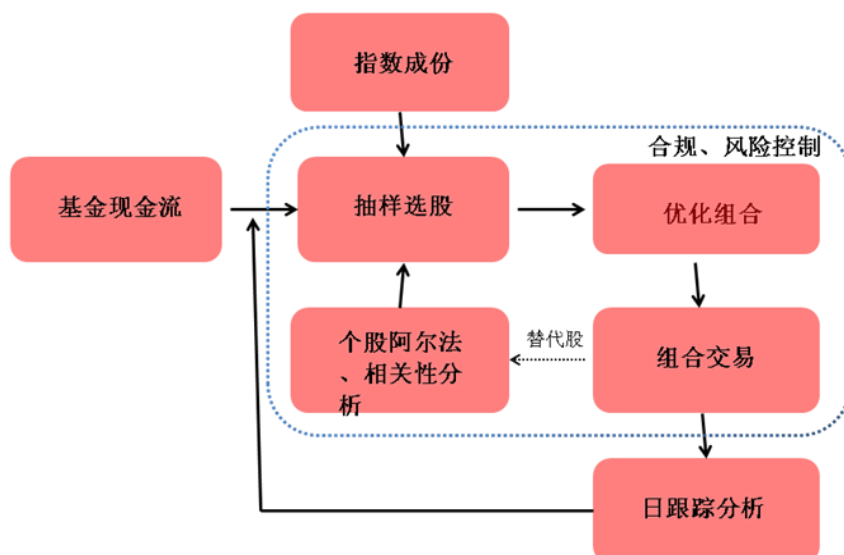
(1) 每日跟踪分析：本基金跟踪指数，因此指数跟踪的偏离度和风险分析尤为重要。数量分析组对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行每日跟踪测算，并提供数量风险分析报告。投研部行业研究员对基准指数成份股中基本面变化、流动性变化的企业情况提供及时的风险分析报告。运营部每日提供基金申购赎回的数据分析，供基金经理投资决策参考。

(2) 基金经理根据数量风险分析和申购赎回分析报告，在追求跟踪误差最小化的目标下，控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险，降低交易成本。

(3) 交易部依据基金经理指令，制定交易策略，通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。

(4) 风险管理部根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议。监察稽核部对指数化抽样复制的执行过程进行合规监控。基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况控制投资组合的流动性风险。

投资管理流程图如下所示：



## 七、投资限制

### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- (2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
- (4) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；
- (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
- (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
- (7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- (8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
- (9) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持

证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(10) 本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(11) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

(12) 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(13) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

(16) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的90%，且不得超过基金资产净值的95%；

(17) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(18) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交



易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；但完全按照有关指数的构成比例进行的投资不计入受此限。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(9)、(12)、(18)、(19)、(20)项以外，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的资产配置比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其

有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不正当利益。

## 九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2020年1月16日复核了本招募说明书中的投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告的财务数据截止至2019年12月31日。

### 1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	224,861,586.52	91.94
	其中：股票	224,861,586.52	91.94
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	446,300.00	0.18
	其中：债券	446,300.00	0.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,061,673.01	7.39
8	其他资产	1,197,628.88	0.49
9	合计	244,567,188.41	100.00

## 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1.2.1 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	861,768.88	0.35
B	采矿业	6,890,730.40	2.84
C	制造业	126,998,596.90	52.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,503,700.80	2.68
E	建筑业	3,018,248.00	1.24
F	批发和零售业	10,714,924.90	4.41
G	交通运输、仓储和邮政业	7,744,346.90	3.19
H	住宿和餐饮业	891,873.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,047,859.05	9.49
J	金融业	12,986,578.42	5.35
K	房地产业	9,023,254.30	3.72
L	租赁和商务服务业	3,308,965.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	1,326,989.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	1,392,806.16	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	202,686.00	0.08
Q	卫生和社会工作	1,763,003.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	4,938,594.44	2.03
S	综合	2,545,534.00	1.05
	合计	224,160,459.15	92.31

### 1.2.2 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	694,549.33	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	701,127.37	0.29

### 1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

### 1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 1.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600745	闻泰科技	21,000	1,942,500.00	0.80
2	002463	沪电股份	63,900	1,419,219.00	0.58
3	000066	中国长城	90,900	1,414,404.00	0.58
4	002384	东山精密	57,900	1,340,385.00	0.55

5	601099	太平洋	329,300	1,248,047.00	0.51
6	002129	中环股份	104,600	1,235,326.00	0.51
7	600584	长电科技	55,500	1,219,890.00	0.50
8	601128	常熟银行	133,800	1,218,918.00	0.50
9	300014	亿纬锂能	23,700	1,188,792.00	0.49
10	002465	海格通信	107,600	1,165,308.00	0.48

### 1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688025	杰普特	4,655	178,565.80	0.07
2	688138	清溢光电	10,066	139,816.74	0.06
3	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.05
4	688089	嘉必优	2,607	82,563.69	0.03
5	688181	八亿申购	1,554	68,344.92	0.03

### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	446,300.00	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	446,300.00	0.18

### 1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	128085	鸿达转债	1,671	167,100.00	0.07
2	128086	国轩转债	1,015	101,500.00	0.04
3	128084	木森转债	477	47,700.00	0.02
4	110063	鹰 19 转债	440	44,000.00	0.02

5	123036	先导转债	330	33,000.00	0.01
---	--------	------	-----	-----------	------

#### 1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### 1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

#### 1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2006	IC2006	1	1,032,880.00	9,480.00	-
IC2003	IC2003	3	3,138,960.00	114,840.00	-
公允价值变动总额合计(元)					124,320.00
股指期货投资本期收益(元)					404,076.50
股指期货投资本期公允价值变动(元)					58,160.00

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》

及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-

股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生

工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

##### 1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，

参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

#### 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

##### 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

##### 1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

#### 1.11 投资组合报告附注

##### 1.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、

###### 处罚说明

太平洋证券股份有限公司于 2019 年 6 月 28 日收到云南证监局《限制业务活动事先告知书》(云证监函〔2019〕160 号),于 2019 年 7 月 12 日收到云南证监局《关于对太平洋证券股份有

限公司采取限制业务活动措施的决定》（〔2019〕9号），太平洋证券因对下属全资另类投资子公司太证非凡投资有限公司管控不到位，未有效督促太证非凡强化合规风险管理及审慎开展业务等问题被云南证监局暂停另类投资子公司业务 3 个月。

对“太平洋”的投资决策程序的说明：本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，太平洋属于该指数成分股，本基金对于该证券是按照标的指数成分股进行相应投资的。

除此之外，本基金指数投资的前十名证券的发行主体及积极投资的前五名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

#### 1.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	607,352.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,728.22
5	应收申购款	586,548.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,197,628.88

#### 1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 1.11.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明



## 1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## 1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688025	杰普特	178,565.80	0.07	非公开发行股票
2	688138	清溢光电	139,816.74	0.06	非公开发行股票
3	688399	硕世生物	124,827.90	0.05	非公开发行股票
4	688089	嘉必优	82,563.69	0.03	非公开发行股票
5	688181	八亿申购	68,344.92	0.03	新股流通受限

## 1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 第十四部分 基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。基金业绩数据截至2019年12月31日。

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	① - ③	② - ④
2011年2月11 日至2011年12 月31日	-30.00%	1.29%	-29.59%	1.41%	-0.41%	-0.12%

2012年1月1日 至2012年12月 31日	-0.55%	1.43%	0.44%	1.46%	-0.99%	-0.03%
2013年1月1日 至2013年12月 31日	17.17%	1.31%	16.16%	1.37%	1.01%	-0.06%
2014年1月1日 至2014年12月 31日	39.66%	1.16%	36.91%	1.18%	2.75%	-0.02%
2015年1月1日 至2015年12月 31日	46.97%	2.83%	41.29%	2.68%	5.68%	0.15%
2016年1月1 日至2016年12 月31日	-11.17%	1.80%	-16.75%	1.81%	5.58%	-0.01%
2017年1月1 日至2017年12 月31日	4.74%	0.88%	-0.11%	0.88%	4.85%	0.00%
2018年1月1 日至2018年12 月31日	-29.48%	1.39%	-31.84%	1.43%	2.36%	-0.04%
2019年1月1 日至2019年12 月31日	30.50%	1.33%	25.11%	1.39%	5.39%	-0.06%

2011年2月11 日至2019年12 月31日	43.33%	1.58%	12.68%	1.59%	30.65%	-0.01%
--------------------------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

## (二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期自2011年2月11日至2011年8月10日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## 第十五部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金的基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### 四、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十六部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 二、估值方法

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，

调整最近交易市价，确定估值价；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定估值价；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定估值价；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；在证券交易所挂牌的同一股票在估值日无交易的，以根据1.(1)确定的同一股票的估值价估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4. 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估

值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 四、基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值。

#### 1. 信诚中证500份额的基金份额净值计算

T日信诚中证500份额的基金份额净值 = T日闭市后的基金资产净值 / T日本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额）的基金份额余额总数

#### 2. 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算

假设T日为基金份额净值计算日， $t = \min(\text{自基金合同生效日至T日}, \text{自最近一个份额折算日次日至T日})$ ，NAV500<sub>t</sub>为T日信诚中证500份额的基金份额净值，NAVA<sub>t</sub>为T日信诚中证500 A份额的基金份额净值，NAV B<sub>t</sub>为T日信诚中证500 B份额的基金份额净值，R年为信诚中证500 A份额的约定年收益率。

$$\text{NAVA}_t = 1 + R \text{年} \times \frac{t}{\text{运作周年实际天数}}$$

$$\text{NAV B}_t = (\text{NAV500}_t - 0.4 \times \text{NAVA}_t) / 0.6$$

例：假设  $t=99$ ，运作周年实际天数为 365 天， $R \text{年}=5.95\%$ ， $\text{NAVA}_0=1.000$ ， $\text{NAV500}_{99}=1.400$ ：

$$\text{NAVA}_{99} = 1.000 + 5.95\% \times 99 / 365 = 1.016$$

$$\text{NAV}_{99} = (1.400 - 0.4 \times 1.016) / 0.6 = 1.656$$

信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 五、估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，按照前述的计算方式确定，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。



(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

- (1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
- (2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。
- (3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。
- (4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。
- (5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
4. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

5. 法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 九、特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

# 第十七部分 基金的收益与分配

## 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

## 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

## 三、收益分配原则

本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止信诚中证500 A份额与

信诚中证500 B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 第十八部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市初费和上市月费；
9. 账户开户费和账户维护费；
10. 基金合同生效后的标的指数许可使用费；
11. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经

基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

## 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

## 3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费

标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费，标的指数许可使用基点费的计费时间从基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的0.02%/年，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。

在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$\text{收取下限的日均摊销数额} = 5 \text{万} / \text{季度} * 4 \text{季度} / \text{年} \div \text{当年天数} (365 \text{天或} 366 \text{天}) \approx 550 \text{元} / \text{天}$$

$$H = \text{Max} ( E \times 0.02\% / \text{当年天数}, 550 )$$

H为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。

4. 除管理费、托管费、标的指数许可使用费和前述所列之外的基金费用，由基金托管人与基金管理人协商后，根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期

基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### 四、费率调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

### 五、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十九部分 基金份额折算

### 一、定期份额折算

#### 1. 定期份额折算的折算日

每个基金运作周年的最后一个工作日。

运作周年指自基金合同生效日或最近一个定期份额折算日次日起每满一周年的运作期间。若该运作期间的最后一日为工作日，则定期份额折算日为该日；若该运作期间的最后一日为非工作日，则定期份额折算日为该日之前的最后一个工作日。

如，假设本基金成立于2011年1月21日，则本基金成立后的第一个运作周年的运作期间为2011年1月21日至2012年1月20日，假设2012年1月20日（周五）为工作日，则第一个定期份额折算日为2012年1月20日；第二个运作周年的运作期间为2012年1月21日至2013年1月20日，假设2013年1月20日（周日）为非工作日，在其之前的最后一个工作日为2013年1月18日（周五），则第二个定期份额折算日为2013年1月18日；第三个运作周年的运作期间为2013年1月19日至2014年1月18日，假设2014年1月18日（周六）为非工作日，在其之前的最后一个工作日为2014年1月17日（周五），则第三个定期份额折算日为2014年1月17日；其他运作周年和定期份额折算日的计

算类同。

## 2. 定期份额折算的折算对象

基金份额定期折算日登记在册的信诚中证500份额和信诚中证500 A份额，信诚中证500 B份额不参与定期折算，除非定期折算时同时满足不定期折算的条件。

## 3. 定期份额折算的折算频率

每年折算一次。

## 4. 定期份额折算的折算方式

定期份额折算后信诚中证500 A份额的基金份额净值调整为1.000元，基金份额折算日折算前信诚中证500 A份额的基金份额净值超出1.000元的部分将折算为信诚中证500份额的场内份额分配给信诚中证500 A份额持有人。信诚中证500份额持有人持有的每十份信诚中证500份额将按四份信诚中证500 A份额获得新增信诚中证500份额的分配，经过上述份额折算后，信诚中证500份额的基金份额净值将相应调整。

### 1) 信诚中证500份额折算

$$NAV_{后500} = NAV_{前500} - 0.4 \times (NAV_{前A} - 1.000)$$

$$信诚中证500份额持有人新增的信诚中证500份额数 = 0.4 \times NUM_{前500} \times (NAV_{前A} - 1.000) / NAV_{后500}$$

其中：

NAV<sub>前500</sub>：定期份额折算前信诚中证500份额的基金份额净值，下同

NAV<sub>后500</sub>：定期份额折算后信诚中证500份额的基金份额净值，下同

NAV<sub>前A</sub>：定期份额折算前信诚中证500 A份额的基金份额净值，下同

NUM<sub>前500</sub>：定期份额折算前信诚中证500份额的份额数，下同

持有信诚中证500份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增信诚中证500份额的场外份额的分配；持有信诚中证500份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增信诚中证500份额的场内份额的分配。

信诚中证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；信诚中证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) 信诚中证500 A份额折算

定期份额折算后信诚中证500 A份额的基金份额净值=1.000元

定期份额折算后信诚中证500 A份额的份额数 = 定期份额折算前信诚中证500 A份额的份额数

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

其中：

NUM<sub>前 A</sub>：定期份额折算前信诚中证 500 A 份额的份额数，下同

信诚中证 500 A 份额折算成信诚中证 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) 信诚中证 500 B 份额折算

信诚中证 500 B 份额不进行份额折算，其基金份额净值和份额数保持不变。

### 4) 折算后信诚中证 500 份额的总份额数

折算后信诚中证 500 份额的总份额数 = 定期份额折算前信诚中证 500 份额的份额数 + 信诚中证 500 份额持有人新增的信诚中证 500 份额数 + 信诚中证 500 A 份额持有人新增的信诚中证 500 份额数。

例一：假设基金份额折算日折算前信诚中证 500 份额的基金份额净值为 0.850 元，信诚中证 500 A 份额的基金份额净值为 1.058 元，信诚中证 500 B 份额的基金份额净值为 0.711 元，投资人甲持有信诚中证 500 份额的场内份额 10000 份，投资人乙持有信诚中证 500 A 份额 5000 份，投资人丙持有信诚中证 500 B 份额 8000 份，则：

份额折算后信诚中证 500 份额的基金份额净值 =  $0.850 - 0.4 \times (1.058 - 1.000) = 0.827$  元，信诚中证 500 A 份额的基金份额净值 = 1.000 元

投资人甲新增的信诚中证 500 份额数 =  $[0.4 \times 10000 \times (1.058 - 1.000)] / 0.827 = 280$  份（场内份额取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的信诚中证 500 份额数 =  $[5000 \times (1.058 - 1.000)] / 0.827 = 350$  份（场内份额取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

即：份额折算后，投资人甲共持有信诚中证 500 份额的场内份额 10280 份，投资人乙共持有信诚中证 500 A 份额 5000 份及信诚中证 500 份额的场内份额 350 份，投资人丙仍持有信诚中证 500 B 份额 8000 份。

## 5. 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的上市交易和信诚中证 500 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 6. 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

## 7. 特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

## 二、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当信诚中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元；当信诚中证 500 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元。

(1) 当信诚中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时

1. 不定期份额折算的折算日

信诚中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元，基金管理人即可确定基金份额折算日。

2. 不定期份额折算的折算对象

基金份额折算日登记在册的信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额。

3. 不定期份额折算的折算频率

不定期。

4. 不定期份额折算的折算方式

当信诚中证 500 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，本基金将在基金份额折算日分别对信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额进行份额折算，份额折算后信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的比例仍保持 4:6 不变。份额折算后信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元，基金份额折算日折算前信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分均将折算为信诚中证 500 份额分别分配给信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的持有人。

1) 信诚中证 500 份额折算

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

信诚中证 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；信诚中证 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) 信诚中证 500 A 份额折算

折算后信诚中证 500 A 份额的份额数保持不变，即： $\text{NUM}_{\text{后 A}} = \text{NUM}_{\text{前 A}}$

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

其中，

$\text{NUM}_{\text{后 A}}$ ：折算后信诚中证 500 A 份额的份额数，下同

信诚中证 500 A 份额折算成信诚中证 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) 信诚中证 500 B 份额折算



折算后信诚中证 500 B 份额的份额数保持不变，即： $NUM_{后 B} = NUM_{前 B}$

信诚中证 500 B 份额持有人新增的信诚中证 500 份额数 =  $[NUM_{前 B} \times (NAV_{前 B} - 1.000)] / 1.000$

其中，

$NUM_{前 B}$ ：折算前信诚中证 500 B 份额的份额数，下同

$NUM_{后 B}$ ：折算后信诚中证 500 B 份额的份额数，下同

信诚中证 500 B 份额折算成信诚中证 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。

#### 4) 折算后信诚中证 500 份额的总份额数

折算后信诚中证 500 份额的总份额数 = 不定期份额折算前信诚中证 500 份额的份额数 + 信诚中证 500 份额持有人新增的信诚中证 500 份额数 + 信诚中证 500 A 份额持有人新增的信诚中证 500 份额数 + 信诚中证 500 B 份额持有人新增的信诚中证 500 份额数

例二：假设 T 日信诚中证 500 份额的基金份额净值为 2.035 元，信诚中证 500 A 份额的基金份额净值为 1.029 元，信诚中证 500 B 份额的基金份额净值为 2.706 元，投资人甲持有信诚中证 500 份额的场内份额 10000 份，投资人乙持有信诚中证 500 A 份额 5000 份，投资人丙持有信诚中证 500 B 份额 8000 份，若基金管理人决定以该日为份额折算日，则：

份额折算后信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元，

投资人甲新增的信诚中证 500 份额数 =  $[10000 \times (2.035 - 1.000)] / 1.000 = 10350$  份

投资人乙新增的信诚中证 500 份额数 =  $[5000 \times (1.029 - 1.000)] / 1.000 = 145$  份

投资人丙新增的信诚中证 500 份额数 =  $[8000 \times (2.706 - 1.000)] / 1.000 = 13648$  份

即：份额折算后，投资人甲共持有信诚中证 500 份额的场内份额 20350 份，投资人乙共持有信诚中证 500 A 份额 5000 份及信诚中证 500 份额的场内份额 145 份，投资人丙共持有信诚中证 500 B 份额 8000 份及信诚中证 500 份额的场内份额 13648 份。

#### 5. 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的上市交易和信诚中证 500 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6. 基金份额折算结果的公告

基金份额实施折算前，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

(2) 当信诚中证 500 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元时

##### 1. 不定期份额折算的折算日

信诚中证 500 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元，基金管理人即可确定基金份额折算日。

## 2. 不定期份额折算的折算对象

基金份额折算日登记在册的信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额。

## 3. 不定期份额折算的折算频率

不定期。

## 4. 不定期份额折算的折算方式

当信诚中证 500 B 份额的基金份额净值小于或等于 0.250 元时，本基金将在基金份额折算日分别对信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额进行份额折算，份额折算后信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的比例仍保持 4 : 6 不变。份额折算后信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元，信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的份额数将得到相应的缩减。

### 1) 信诚中证 500 份额折算

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

信诚中证 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；信诚中证 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) 信诚中证 500 A 份额折算

折算后信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的份额配比保持 4 : 6 不变，即：

$$A = \frac{2}{3} \times \text{NUM 后 B}$$

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

信诚中证 500 A 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。信诚中证 500 A 份额折算成信诚中证 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) 信诚中证 500 B 份额折算

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

信诚中证 500 B 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) 折算后信诚中证 500 份额的总份额数

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

例三：假设 T 日信诚中证 500 份额的基金份额净值为 0.557 元，信诚中证 500 A 份额的基金份额净值为 1.025 元，信诚中证 500 B 份额的基金份额净值为 0.245 元，投资人甲持有信诚中证 500 份额的场内份额 10000 份，投资人乙持有信诚中证 500 A 份额 5000 份，投资人丙持有信诚中证 500 B 份额 8000 份，则：

份额折算后信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元，

折算后投资人甲持有的信诚中证 500 份额数 =  $(0.557 \times 10000) / 1.000 = 5570$  份

折算后投资人乙持有的信诚中证 500 A 份额数 =  $\frac{2}{3} \times [0.245 \times (5000 \times \frac{3}{2})] / 1.000 = 1225$  份，

新增的信诚中证 500 份额数 =  $(1.025 \times 5000 - 1225 \times 1.000) / 1.000 = 3900$  份

折算后投资人丙持有的信诚中证 500 B 份额数 =  $(0.245 \times 8000) / 1.000 = 1960$  份

即：份额折算后，投资人甲共持有信诚中证 500 份额的场内份额 5570 份，投资人乙共持有信诚中证 500 A 份额 1225 份及信诚中证 500 份额的场内份额 3900 份，投资人丙持有信诚中证 500 B 份额 1960 份。

#### 5. 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的上市交易和信诚中证 500 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6. 基金份额折算结果的公告

基金份额实施折算前，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

## 第二十部分 信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的终止运作

### 一、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》终止分级运作

1、本基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。为此，基金管理人将向深圳证券交易所申请基金份额终止上市，并办理信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的份额折算。具体终止运作的时间安排见基金管理人届时发布的公告。基金管理人应将基金合同根据前述法律法规做相应修改并公告。

#### 2、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的份额折算

份额折算基准日，信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额将全部折算成场内信诚中证 500 份额。

##### (1) 份额折算基准日

份额折算基准日为信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额终止上市日的前一交易日，具体日

期见基金管理人届时发布的公告。

## (2) 份额折算方式

在份额折算基准日日终，以信诚中证500份额的基金份额净值为基准，信诚中证500A份额、信诚中证500B份额按照各自的基金份额净值折算成场内信诚中证500份额。信诚中证500A份额（或信诚中证500B份额）基金份额持有人持有的折算后场内信诚中证500份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

信诚中证500A份额（或信诚中证500B份额）的折算比例 = 份额折算基准日信诚中证500A份额（或信诚中证500B份额）的基金份额净值 / 份额折算基准日信诚中证500份额的基金份额净值

信诚中证500A份额（或信诚中证500B份额）基金份额持有人持有的折算后场内信诚中证500份额 = 基金份额持有人持有的折算前信诚中证500A份额（或信诚中证500B份额）的份额数 × 信诚中证500A份额（或信诚中证500B份额）的折算比例

## (3) 份额折算后的基金运作

信诚中证500A份额与信诚中证500B份额全部折算为场内信诚中证500份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回，开始申购、赎回的时间及具体操作以基金管理人的公告为准。

## (4) 份额折算的公告

信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的份额折算结束后，基金管理人应在指定媒介公告。

### 3、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可暂停相关份额的交易和申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

二、经基金份额持有人大会决议通过，信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额各自

表决权的 2/3 以上 ( 含 2/3 ) 通过方为有效。

### 三、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额终止运作后的份额转换

信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额将全部转换成信诚中证500份额的场内份额。

#### 1. 份额转换基准日

信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作日 ( 如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日 ) 。

#### 2. 份额转换方式

在份额转换基准日日终，以信诚中证500份额的基金份额净值为基准，信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额按照各自的基金份额净值转换成信诚中证500份额的场内份额。信诚中证500 A份额 ( 或信诚中证500 B份额 ) 基金份额持有人持有的转换后信诚中证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。

份额转换计算公式：

信诚中证500 A份额 ( 或信诚中证500 B份额 ) 的转换比例 = 份额转换基准日信诚中证500 A份额 ( 或信诚中证500 B份额 ) 的基金份额净值 / 份额转换基准日信诚中证500份额的基金份额净值

信诚中证500 A份额 ( 或信诚中证500 B份额 ) 基金份额持有人持有的转换后信诚中证500份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前信诚中证500 A份额 ( 或信诚中证500 B份额 ) 的份额数 × 信诚中证500 A份额 ( 或信诚中证500 B份额 ) 的转换比例

#### 3. 份额转换后的基金运作

信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额全部转换为信诚中证500份额的场内份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

#### 4. 份额转换的公告

信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额进行份额转换结束后，基金管理人应在指定媒介公告。

## 第二十一部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金募集所在的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 第二十二部分 基金的信息披露

一、基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额

持有人及其日常机构（如有）等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额销售机构；
5. 登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生不一致或有歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书、基金产品资料概要

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管

理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。

《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## （四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## （五）基金份额上市交易公告书

信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## （六）基金净值信息

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理信诚中证500份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周在指定网站披露一次信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值和基金份额累计净值；

2. 在信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额上市交易或开始办理信诚中证500份额申购或者赎回后，基金管理人将在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值；



3. 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### (七) 信诚中证500份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明信诚中证500份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (八) 基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告（合称“基金定期报告”）

1. 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3. 基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

4. 基金合同生效不足2个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

5. 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额（包括信诚中证500份额、信诚中证500A份额、信诚中证500B份额）20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### (九) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的

事件时，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上：

1. 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
2. 基金终止上市交易、基金合同终止、基金清算；
3. 转换基金运作方式、基金合并；
4. 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
5. 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
6. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
7. 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
8. 基金募集期延长；
9. 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
10. 基金管理人的董事在最近12个月内变更超过50%，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过30%；
11. 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
12. 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
13. 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
14. 基金收益分配事项；
15. 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；
17. 信诚中证500份额开始办理申购、赎回；
18. 本基金发生巨额赎回并延期办理；
19. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20. 本基金暂停接受信诚中证500份额申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
21. 本基金开始接受或暂停接受份额配对转换申请；
22. 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
23. 本基金实施基金份额折算；
24. 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作；
25. 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的份额转换；
26. 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；
27. 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### (十) 澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### (十一) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### (十二) 清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并制作清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (十三) 中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式

准则等法律法规以及证券交易所的自律管理规则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第二十三部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的风险

#### 1. 市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观和微观经济因

素、国家政策、市场变动、行业与个股业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

#### (1) 经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家经济、微观经济、行业及上市公司的盈利水平也可能呈周期性变化，从而影响到证券市场及行业的走势。

#### (2) 政策风险

因国家的各项政策，如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致证券市场波动而影响基金投资收益，产生风险。

#### (3) 利率风险

由于利率发生变化和波动使得证券价格和证券利息产生波动，从而影响到基金业绩。

#### (4) 信用风险

当证券发行人不能够实现发行时所做出的承诺，按时足额还本付息的时候，就会产生信用风险。信用风险主要来自于发行人和担保人。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其他债券的信用风险可根据专业机构的信用评级确定。当证券的信用等级发生变化时，可能会产生证券的价格变动，从而影响到基金资产。

#### (5) 再投资风险

再投资获得的收益又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

#### (6) 购买力风险

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

#### (7) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果基金所投资的上市公司基本面或发展前景产生变化，可能导致其股价的下跌，或者可分配利润的降低，使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少风险，但不能

完全规避。

## 2. 管理风险

### (1) 管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

### (2) 新产品创新带来的风险

随着中国证券市场不断发展，各种国外的投资工具也将被逐步引入，这些新的投资工具在为基金资产提供保值增值功能的同时，也会产生一些新的风险，例如利率期货带来的期货投资风险，期权产品带来的定价风险等。同时，基金管理人也可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误，产生投资风险。

## 3. 估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值。

## 4. 流动性风险评估及流动性风险管理工具

### a. 流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在几个方面：建仓成本控制不力，建仓时效不高；基金资产变现能力差，或变现成本高；在投资人大额赎回时缺乏应对手段；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

#### (1) 市场整体流动性问题。

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大额赎回时表现尤为突出。

(2) 市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加基金投资成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

#### b. 基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“第九部分 信诚中证500份额的申购与赎回”章节。

#### c. 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额（包括信诚中证500份额、信诚中证500A份额、信诚中证500B份额）一定比例以上的，基金管理人可以对其采取延期办理赎回申请的措施。详细规则可见《招募说明书》的“第九部分 信诚沪深300份额的申购与赎回”中“九、巨额赎回的情形及处理方式”的内容。

#### d. 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：1) 延期办理巨额赎回申请；2) 暂停接受赎回申请；3) 延缓支付赎回款项；4) 收取短期赎回费；5) 暂停基金估值等；对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

#### 5. 指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，标的指数为中证500指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险：

#### (1) 系统性风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，基金资产主要投资于中证500指数的成份股及其备选成份股，因此中证500指数的市场表现将影响到基金业绩的表现，当中证500指数出现收益变动、波动提高时，本基金的收益可能会受到影响。

#### (2) 指数复制风险

本基金采用分层抽样的方式来复制中证500指数，能否有效地复制指数并将跟踪误差控制在可接受范围内，对本基金的收益将产生影响。当复制方法由于市场条件受到限制或者替代股的选择存在错误时，本基金的收益可能会受到影响。

#### (3) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的回报率可能存在偏离。

#### (4) 标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

### 6. 投资于股指期货可能引致的特定风险

除投资于一般金融工具所普遍面临的市场风险、流动性风险等，在股指期货的投资过程中，基金资产将可能面临如下特定风险。

#### (1) 基差风险

基金资产可能因为所持有股指期货合约与标的指数价格波动方向不一致而承受基差风险。因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

#### (2) 盯市结算风险

股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较



高。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定的时间内补足，按规定期货保证金账户将被强制平仓，从而导致超出预期的损失。

#### 7. 分级结构运作的特有风险

本基金为分级基金，信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的运作有别于普通的开放式基金和封闭式基金，投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险：

##### (1) 上市交易的风险

本基金在基金合同生效后，信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

##### (2) 杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚中证500 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；信诚中证500 B份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于信诚中证500 B份额内含杠杆机制的设计，信诚中证500 B份额的净值变动幅度将大于信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的净值变动幅度，即信诚中证500 B份额的净值波动性将高于其他两类基金份额。

##### (3) 折/溢价交易风险

信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平，但信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换机制的影响，信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的交易价格可能会相互影响。

##### (4) 风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后，信诚中证500 A份额持有人或信诚中证500 B份额持有人将会获得一定比例的中证500份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

当信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额终止运作后，信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额将全部转换成信诚中证500份额的场内份额，基金份额持有人所持有的基金份额也将面临风险收益特征出现变化的风险。

#### (5) 份额转换的风险

在实施基金份额折算后，信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额的净值增长将全部折算成信诚中证500份额的场内份额；当信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额终止运作后，信诚中证500 A份额和信诚中证500 B份额将全部转换成信诚中证500份额的场内份额。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以办理投资人赎回基金份额的业务。因此，基金份额持有人可能面临会员单位不具备基金代销业务资格而导致的不能直接赎回信诚中证500份额的场内份额的风险。此风险需要引起投资者注意，投资人可以选择在份额折算前将信诚中证500 A份额或信诚中证500 B份额卖出，或者将新增的信诚中证500份额的场内份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

### 8. 其他风险

#### (1) 技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

#### (2) 大额申购/赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

### (3) 顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资人在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

### (4) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金代销机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 二、声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》及《基金产品资料概要》。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收

益或本金安全。

## 第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作，但根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定取消分级运作机制而需要终止上市的除外；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整信诚中证500份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在指定媒介公告。

## 二、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会规定的其他情况。

## 三、基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止之日起30个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

(1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

(2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- (3)对基金财产进行清理和确认；
- (4)对基金财产进行估价和变现；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁；
- (9)公布基金财产清算结果；
- (10)对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用；
- (2)交纳所欠税款；
- (3)清偿基金债务；

(4)根据基金合同终止日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自的基金份额净值分别计算信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公

告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十五部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，投资人自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；
2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
3. 依法转让其持有的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额，依法申请赎回其持有的信诚中证500份额；
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7. 监督基金管理人的投资运作；
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## (二) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
3. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
4. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
5. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
6. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
7. 返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

8. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## (三) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 发售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理信诚中证500份额的申购和赎回申请；
8. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；



9. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13. 依法召集基金份额持有人大会；

14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (四) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续；

3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7. 依法接受基金托管人的监督；

8. 计算并公告信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后的份额转换比例和信诚中证500份额的申购、赎回价格；

9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10. 按规定受理信诚中证500份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12. 编制季度报告、中期报告和年度报告；
13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17. 依据《基金法》等的规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19. 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (五) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；
3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6. 依法召集基金份额持有人大会；
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (六) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1. 安全保管基金财产；
2. 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后的份额转换比例和信诚中证500份额的申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23. 建立并保存基金份额持有人名册；
24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(七) 基金合同当事各方的权利义务以基金合同为依据，不因基金财产账户名称变更而有所改变。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内

有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人大会的审议事项应分别由信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

## (二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人、单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作，但根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定取消分级运作机制而需要终止上市的除外；
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同或其他相关法律文件，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整信诚中证500份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3. 单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

4. 单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配

合，不得阻碍、干扰。

#### (四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。在法律法规和监管机关允许的情况下，表决方式亦可采用网上表决、电话表决等其他表决方式。

3. 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人经有效通知而拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### (五) 基金份额持有人出席会议的方式

## 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯方式开会应按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额应占权益登记日各自基金份额的50%以上(含50%，下同)；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经有效通知拒不到场监督的，不影响表决效力；



4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额占权益登记日各自基金份额的 50% 以上；

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

#### (六) 议事内容与程序

##### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与

公告日期有30日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应的份额级别内享有平等的表决权。

### 2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额表决权的50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

## (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项,应当在五日内依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4. 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## (八) 计票

### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,

其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## (九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### (一) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 中国证监会规定的其他情况。

### (二) 基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止之日起30个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 根据基金合同终止日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自的基金份额净值分别计算信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### 四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同

规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

## 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 第二十六部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人 (或简称“管理人”)

名称：中信保诚基金管理有限公司

注册地址：中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

邮政编码：200120

法定代表人：张翔燕

成立日期：2005年9月30日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2005]142号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人 (或简称“托管人”)

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监



督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- (1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- (2) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
- (3) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；
- (4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
- (5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
- (6) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- (7) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
- (8) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (9) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- (10) 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (11) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；
- (12) 基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
- (13) 基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；
- (14) 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金

资产净值的90%，且不得超过基金资产净值的95%；

(15)基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

(16)基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(17)本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的8%；本基金可变更或根据相关的法律法规取消本条限制，而无需召开持有人大会；

此处流通受限证券定义见下文第5项；

(18)本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(19)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(20)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(21)本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；但完全按照有关指数的构成比例进行的投资不计入受此限。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(7)、(10)、(16)、(19)、(20)项以外，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管

人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券（与上文所述流动性受限资产并不相同，指经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券），应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1) 本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行股票，也不得预付任何形式的保证金。

2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等

原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，予以公告。

5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值、信诚中证500 A份额与信

诚中证500 B份额终止运作后的份额转换比例、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8. 基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

10. 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## (二) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1. 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额终止运作后的份额转换比例、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

3. 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 三、基金财产的保管

#### (一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和托管协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。



4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

基金参与认购未上市债券时，基金管理人应代表本基金与对手方签署相关合同或协议，明确约定债券过户具体事宜。否则，基金管理人需对所认购债券的过户事宜承担相应责任。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除托管协议另有规定外，

基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

#### 四、基金资产净值计算与复核

##### (一) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

本基金分别计算并公告信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值。

##### 1. 信诚中证500份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

$$T \text{ 日信诚中证500份额的基金份额净值} = T \text{ 日闭市后的基金资产净值} / T \text{ 日本基金 ( 包括信诚中证500份额、信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额 ) 的基金份额余额总数}$$

##### 2. 信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值计算

信诚中证500 A份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率 ( 税后 ) 加上 3.2%。其中计算信诚中证500 A份额约定收益率的一年期银行定期存款年利率是指基金合同生效日或生效后每个运作周年的最后一个工作日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

例如：若本基金合同生效日为 2011 年 1 月 21 日，则以 2011 年 1 月 21 日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率 ( 税后 ) 加计 3.2% 作为第一个运作周年 ( 2011 年 1 月 21 日至 2012 年 1 月 20 日 ) 的约定收益率。若第一个运作周年的最后一个工作日为 2012 年 1 月 20 日，则以 2012 年 1 月 20 日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率 ( 税后 ) 加计 3.2% 作为下一个运作周年的约定收益率，依此类推。

信诚中证500 A份额的约定收益率除以运作周年实际天数得到信诚中证500 A份额的约定日收益率。信诚中证500 A份额的基金份额净值以 1.000 元为基础，采用信诚中证500 A份额的约定

日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算。其中，运作周年指自基金合同生效日或最近一个定期份额折算日次日起每满一周年的运作期间，运作周年实际天数为该期间的实际天数。信诚中证500 A份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数。

假设T日为基金份额净值计算日， $t = \min(\text{自基金合同生效日至T日}, \text{自最近一个份额折算日次日至T日})$ ，NAV500<sub>t</sub>为T日信诚中证500份额的基金份额净值，NAVA<sub>t</sub>为T日信诚中证500 A份额的基金份额净值，NAV B<sub>t</sub>为T日信诚中证500 B份额的基金份额净值，R<sub>年</sub>为信诚中证500 A份额的约定年收益率。

$$\text{NAVA}_t = 1 + R_{\text{年}} \times \frac{t}{\text{运作周年实际天数}}$$

$$\text{NAV B}_t = (\text{NAV500}_t - 0.4 \times \text{NAVA}_t) / 0.6$$

信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

## 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将信诚中证500份额、信诚中证500 A份额与信诚中证500 B份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务，除非法律、法规、规章另有规定，有权机关另有要求。

## 六、争议解决方式

因托管协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

托管协议受中国法律管辖。

## 七、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更程序

托管协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 第二十七部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资人更改个人信息资料，请利用以下方式进行修改：到原开立基金账户的销售网点，登录中信保诚网站进行或投资者本人致电客服中心。

### （二）网上交易服务

投资人可通过中信保诚基金网站办理基金份额的基金赎回、撤单、修改分红方式等业务。

网上交易服务的基金开户、认购、申购、定投业务已于 2019 年 6 月 24 日正式关闭，有关详情可参见本公司于 2019 年 6 月 21 日发布的相关公告。

### （三）定期定额投资计划

本基金可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则将在本基金开放申购赎回后公告。

### （四）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

### （五）电话查询服务

中信保诚基金免长途费客服专线 400-6660066，为客户提供安全高效的电话自助语音或人工查询服务。

### （六）在线服务

中信保诚基金网站（<http://www.citicprufunds.com.cn>）为基金投资人提供网上查询、网上资讯、网上留言等服务。

### （七）资讯服务

投资人可以通过中信保诚基金提供的网上留言、呼叫中心人工座席、书信、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

(八) 如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容, 请通过上述方式联系本基金管理人。请确保投资前, 您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十八部分 其他应披露事项

在本基金存续期内, 本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化, 但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

自 2019 年 2 月 12 日以来, 涉及本基金的相关公告如下:

1. 中信保诚基金管理有限公司关于中证 500A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告, 2019 年 2 月 12 日;
2. 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告, 2019 年 2 月 12 日;
3. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告, 2019 年 2 月 27 日;
4. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停直销机构跨系统转托管(场外转场内)业务的公告, 2019 年 3 月 6 日;
5. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金恢复代销机构场外大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停办理基金跨系统转托管(场外转场内)业务的公告, 2019 年 3 月 7 日;
6. 中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过东海证券办理定投业务最低限额的公告, 2019 年 3 月 11 日;
7. 中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、定期定额投资最低金额和赎回、转换转出及持有最低份额限制的业务的公告, 2019 年 3 月 21 日;
8. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书(2019 年第 1 次更新), 2019 年 3 月 26 日;
9. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书摘要(2019 年第 1 次更新), 2019 年 3 月 26 日;
10. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告, 2019 年 3 月 28 日;

11. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2018 年年度报告摘要，2019 年 3 月 28 日；
12. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第一季度报告，2019 年 4 月 18 日；
13. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加辉腾汇富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告，2019 年 5 月 20 日；
14. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购定投费率优惠活动的公告，2019 年 5 月 28 日；
15. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务的公告，2019 年 6 月 17 日；
16. 中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值公告，2019 年 7 月 1 日；
17. 中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 6 月 28 日基金资产净值和基金份额净值公告，2019 年 7 月 1 日；
18. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第二季度报告，2019 年 7 月 19 日；
19. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加恒天明泽基金申购费率优惠活动的公告，2019 年 7 月 29 日；
20. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告，2019 年 7 月 31 日；
21. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告，2019 年 8 月 26 日；
22. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告摘要，2019 年 8 月 26 日；
23. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第三季度报告，2019 年 10 月 24 日；
24. 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第三季度报告提示性公告，2019 年 10 月 24 日；
25. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投基金申购费率优惠活动的公告，2019 年 11 月 13 日；
26. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万家财富基金申购费率优惠活动的公告，2019 年 12 月 30 日；

27. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告，2019 年 12 月 31 日；
28. 中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告，2020 年 1 月 1 日；
29. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2019 年第四季度报告，2020 年 1 月 17 日；
30. 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告，2020 年 1 月 17 日；
31. 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告，2020 年 1 月 21 日；
32. 中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性公告，2020 年 1 月 30 日；
33. 中信保诚基金管理有限公司关于顺延办理信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算业务的提示性公告，2020 年 1 月 31 日；
34. 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间中证 500A 份额停复牌的公告，2020 年 2 月 4 日；
35. 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之中证 500A 份额年约定收益率设定的公告，2020 年 2 月 4 日；
36. 中信保诚基金管理有限公司关于中证 500A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告，2020 年 2 月 5 日；
37. 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告，2020 年 2 月 5 日；
38. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告，2020 年 2 月 7 日；
39. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金托管协议，2020 年 2 月 7 日；
40. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书，2020 年 2 月 7 日；
41. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同，2020 年 2 月 7 日；



42. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要，2020 年 2 月 7 日；
43. 《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》修订前后对照表，2020 年 2 月 7 日；
44. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告，2020 年 2 月 19 日；
45. 中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销渠道基金赎回费率优惠活动的公告，2020 年 2 月 19 日。

## 第二十九部分 招募说明书的存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第三十部分 备查文件

- (一) 中国证监会核准信诚中证500指数分级证券投资基金募集的文件
- (二) 《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《信诚中证500指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集信诚中证500指数分级证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 《信诚基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (八) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 11 月 21 日