

# 信诚中证信息安全指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》关于不定期份额折算的相关规定，当信诚中证信息安全指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 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信息安全份额（场内简称：信息安全，基础份额，代码：165523）、信诚信息安全 A 份额（场内简称：信息安 A，代码：150309）、信诚信息安全 B 份额（场内简称：信息安 B，代码：150310）进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2018 年 8 月 31 日，信息安 B 的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值 0.250 元，在此提请投资者密切关注信息安 B 份额近期净值的波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对可能发生的不定期份额折算，本基金管理人特别提示如下：

一、由于信息安 A 份额、信息安 B 份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，其折溢价率可能发生较大变化。特提醒参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

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

三、信息安 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时，原信息安 A 持有人的风险收益特征将发生一定变化，由持有单一的较低风险收益特征的信息安 A 变为同时持有信息安 A 与信息安 B 份额，因此原信息安 A 持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，信诚信息安全为跟踪指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原信息安 A 持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

四、由于触发折算阈值当日，信息安 B 净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日信息安 B 净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

五、本基金管理人的其他重要提示：

根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算(最小单位为 1 份)，舍去部分计入基金资产，持有极小数量信息安全份额、信息安 A 份额、信息安 B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本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息安 A 份额与信息安 B 份额的上市交易和信息安 B 份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》及《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金招募说明书》。投资者可致电本公司客户服务电话 400-666-0066，或登录本公司网站 [www.citicprufunds.com](http://www.citicprufunds.com) 了解或咨询详情。

七、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2018 年 9 月 3 日