

中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 800 有色指数分级证 券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在 2018 年 12 月 14 日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，本基金定期份额折算基准日（即基金合同约定的“折算日”，下同）为每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日）。由于 2018 年 12 月 15 日为非工作日，本次定期份额折算基准日提前至该日之前的最后一个工作日，即 2018 年 12 月 14 日。

二、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“信诚有色”，交易代码：165520）和信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金之 A 份额（以下简称“有色 800A”，交易代码：150150）。

三、基金份额折算方式

定期份额折算后有色 800A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前有色 800A 的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信诚有色的场内份额分配给有色 800A 份额持有人。信诚有色份额持有人持有的每两份信诚有色份额将按一份有色 800A 份额获得新增信诚有色份额的分配，经过上述份额折算后，信诚有色的基金份额净值将相应调整。

1) 信诚有色份额折算

$$NAV_{\text{后母}} = NAV_{\text{前母}} - 0.5 \times (NAV_{\text{前A}} - 1.000)$$

$$\text{信诚有色份额持有人新增的信诚有色份额数} = 0.5 \times \text{NUM}_{\text{前母}} \times (NAV_{\text{前A}} - 1.000) / NAV_{\text{后母}}$$

其中：

NAV_{前母}：定期份额折算前信诚有色份额的基金份额净值，下同

NAV_{后母}：定期份额折算后信诚有色份额的基金份额净值，下同

NAV_{前A}：定期份额折算前有色 800A 份额的基金份额净值，下同

NUM_{前母}：定期份额折算前信诚有色份额的份额数，下同

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

信诚有色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资产；信诚有色的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

2) 有色 800A 份额折算

$$\text{定期份额折算后有色 800A 份额的基金份额净值} = 1.000 \text{ 元}$$

$$\text{定期份额折算后有色 800A 份额的份额数} = \text{定期份额折算前有色 800A 份额的份额数}$$

$$\text{有色 800A 份额持有人新增的信诚有色份额数} = [\text{NUM}_{\text{前A}} \times (NAV_{\text{前A}} - 1.000)] / NAV_{\text{后母}}$$

其中：

NUM_{前A}：定期份额折算前有色 800A 份额的份额数，下同

有色 800A 份额折算成信诚有色份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

3) 信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金之 B 份额（以下简称“有色 800B”）的份额折算

有色 800B 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) 折算后信诚有色份额的总份额数

折算后信诚有色份额的总份额数 = 定期份额折算前信诚有色份额的份额数 + 信诚有色份额持有人新增的信诚有色份额数 + 有色 800A 份额持有人新增的信诚有色份额数。

5) 举例:

假设 2018 年 12 月 14 日为定期份额折算基准日, 当日折算前信诚有色份额的基金份额净值为 1.218 元, 有色 800A 份额的基金份额净值为 1.044 元, 有色 800B 份额的基金份额净值为 1.392 元, 投资人甲持有信诚有色份额的场内份额 10000 份, 投资人乙持有有色 800A 份额 5000 份, 投资人丙持有信诚有色份额的场外份额 10000 份, 投资人丁持有有色 800B 份额 5000 份, 则:

份额折算基准日份额折算后信诚有色份额的基金份额净值 = $1.218 - 0.5 \times (1.044 - 1.000) = 1.196$ 元, 有色 800A 份额的基金份额净值 = 1.000 元, 有色 800 份额的基金份额净值不变

投资人甲新增的信诚有色份额数 = $[0.5 \times 10000 \times (1.044 - 1.000)] / 1.196 = 183$ 份 (场内份额截位取整计算, 最小单位为 1 份, 余额计入基金资产)

投资人乙新增的信诚有色份额数 = $[5000 \times (1.044 - 1.000)] / 1.196 = 183$ 份 (场内份额截位取整计算, 最小单位为 1 份, 余额计入基金资产)

投资人丙新增的信诚有色份额数 = $[0.5 \times 10000 \times (1.044 - 1.000)] / 1.196 = 183.95$ 份 (场外新增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资产)

即: 份额折算基准日份额折算后, 投资人甲共持有信诚有色份额的场内份额 10183 份, 投资人乙共持有有色 800A 份额 5000 份及信诚有色份额的场内份额 183 份, 投资人丙共持有信诚有色份额的场外份额 10183.95 份, 投资人丁仍持有有色 800B 份额 5000 份。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 定期份额折算基准日 (即 2018 年 12 月 14 日), 本基金暂停办理申购 (含定期定额投资)、赎回、转换、转托管、配对转换业务; 有色 800A 和有色 800B 正常交易。当日晚间, 基金管理人计算当日基金份额净值并进行份额折算。

(二) 定期份额折算基准日后的第一个工作日 (即 2018 年 12 月 17 日), 本基金暂停办理申购 (含定期定额投资)、赎回、转换、转托管、配对转换业务; 有色 800A 暂停交易, 有色 800B 正常交易。当日, 本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

(三) 定期份额折算基准日后的第二个工作日 (即 2018 年 12 月 18 日), 基金管理人将公告份额折算确认结果, 持有人可以查询其账户内的基金份额。当日, 本基金恢复办理申购 (含定期定额投资)、赎回、转换、转托管、配对转换业务; 有色 800A 和有色 800B 正常交易。

五、重要提示

(一) 根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》, 2018 年 12 月 18 日有色 800A 即时行情显示的前收盘价为 2018 年 12 月 17 日的有色 800A 份额净值 (四舍五入至 0.001 元)。由于有色 800A 折算前可能存在折溢价交易情形, 折算前的收盘价扣除约定收益后与 2018 年 12 月 18 日的前收盘价可能有较大差异, 12 月 18 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

(二) 有色 800A 于期末的约定应得收益将折算为信诚有色场内份额分配给有色 800A 的份额持有人, 而信诚有色为跟踪中证 800 有色金属指数的基础份额, 其份额净值将随市场涨跌而变化, 因此有色 800A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性, 其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

(三) 由于有色 800A 新增份额折算成的信诚有色的场内份额数和信诚有色的场内份额经折算后的份额数皆取整计算 (最小单位为 1 份), 舍去部份计入基金资产, 持有较少有色 800A 或信诚有色的份额持有人存在无法获得新增场内信诚有色份额的可能性。

(四) 投资者若希望了解基金份额折算业务详情, 可致电中信保诚基金管理有限公司客户服务电话 400-666-0066, 或登录本公司网站 www.citicprufunds.com.cn 进行查询。

风险提示:

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。投资者投资基金时应认真阅读基金合同和招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2018年12月11日