

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

根据《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”），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 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将以 2020 年 1 月 31 日为折算基准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，定期份额折算基准日（即基金合同约定的“折算日”，下同）为每个基金运作周年的最后一个工作日。本次定期份额折算基准日为 2020 年 1 月 31 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 500 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“信诚 500”，交易代码：165511）和信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 份额（以下简称“中证 500A”，交易代码：150028）。

三、基金份额折算方式

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

1)信诚 500 折算

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

$$\text{信诚 500 份额持有人新增的信诚 500 份额数} = 0.4 \times \text{NUM 前 500} \times (\text{NAV 前 A} - 1.000) / \text{NAV 后 500}$$

其中：

NAV 前 500：定期份额折算前信诚 500 的基金份额净值，下同

NAV 后 500：定期份额折算后信诚 500 的基金份额净值，下同

NAV 前 A：定期份额折算前中证 500A 的基金份额净值，下同

NUM 前 500：定期份额折算前信诚 500 的份额数，下同

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

信诚 500 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 500 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)中证 500A 折算

定期份额折算后中证 500A 份额的基金份额净值=1.000 元

定期份额折算后中证 500A 份额的份额数=定期份额折算前中证 500A 的份额数

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

NAV 后 500

其中：

NUM 前 A：定期份额折算前中证 500A 的份额数，下同

中证 500A 折算成信诚 500 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) 中证 500B 份额折算

信诚中证 500B 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 500 的总份额数

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

5) 举例：

假设 2020 年 1 月 31 日为定期份额折算基准日，当日折算前信诚 500 份额的基金份额净值为 1.261 元，中证 500A 份额的基金份额净值为 1.043 元，中证 500B 份额的基金份额净值为 1.406 元，投资人甲持有信诚 500 份额的场内份额 10000 份，投资人乙持有中证 500A 份额 5000 份，投资人丙持有信诚 500 份额的场外份额 10000 份，投资人丁持有中证 500B 份额 8000 份，则：

份额折算基准日份额折算后信诚 500 份额的基金份额净值 = $1.261 - 0.4 \times (1.043 - 1.000) = 1.244$ 元，中证 500A 份额的基金份额净值 = 1.000 元，中证 500B 份额的基金份额净值 = 1.406 元。

投资人甲新增的信诚 500 份额数 = $[0.4 \times 10000 \times (1.043 - 1.000)] / 1.244 = 138$ 份（场内份额截位取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的信诚 500 份额数 = $[5000 \times (1.043 - 1.000)] / 1.244 = 172$ 份（场内份额截位取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

投资人丙新增的信诚 500 份额数 = $[0.4 \times 10000 \times (1.043 - 1.000)] / 1.244 = 138.26$ 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财产）

即：份额折算基准日份额折算后，投资人甲共持有信诚 500 份额的场内份额 10138 份，投资人乙共持有信诚 500A 份额 5000 份及信诚 500 份额的场内份额 172 份，投资人丙共持有信诚 500 份额的场外份额 10138.26 份，投资人丁仍持有中证 500B 份额 8000 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 2020 年 1 月 31 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换业务；中证 500A 和中证 500B 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 2020 年 2 月 3 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换业务；中证 500A 暂停交易，中证 500B 正常交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有者办理份额登记确认。

（三）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 2 月 4 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、转托管、配对转换业务，中证 500A 和中证 500B 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》，2020 年 2 月 4 日中证 500A 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 2 月 3 日的中证 500A 份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于中证 500A 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 2020 年 2 月 4 日的前收盘价可能有较大差异，2020 年 2 月 4 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）中证 500A 于期末的约定应得收益将折算为信诚 500 场内份额分配给中证 500A 的份额持有人，而信诚 500 为跟踪中证 500 指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此中证 500A 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）由于中证 500A 新增份额所折算成的信诚 500 的场内份额数和信诚 500 场内份额经折算后的份额数皆取整计算（最小单位为 1 份），舍去部份计入基金财产，持有较少中证 500A 或信诚 500 的份额持有人存在无法获得新增场内信诚 500 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

2020 年 1 月 21 日