

信诚中证信息安全指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《信诚中证信息安全指数分级证券投资基金基金合同》（简称“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的基础份额（以下简称“信息安全”）的基金份额净值达到 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 2 月 12 日，本基金信息安全份额的基金份额净值为 1.522 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2020 年 2 月 13 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2020 年 2 月 13 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的信诚信息安全份额（场内简称：信息安全，基础份额，代码：165523）、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金 A 份额（场内简称：信息安 A，代码：150309）和信诚中证信息安全指数分级证券投资基金 B 份额（场内简称：信息安 B，代码：150310）。

三、基金份额折算方式

信息安全份额、信息安 A 份额、信息安 B 份额按照《基金合同》“第二十一部分、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当信诚信息安全份额的基金份额净值大于或等于 1.500 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、信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额进行份额折算，份额折算后信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后信诚信息安全份额、信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 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信息安全份额、信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 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信息安全份额分别分配给信诚信息安全份额、信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额的持有人。

（1）信诚信息安全份额的折算

信诚信息安全份额持有人新增的信诚信息安全份额数 =
$$\frac{\text{NUM}_{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

信诚信息安全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资产；信诚信息安全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），余额计入基金资产。

（2）信诚信息安全 A 份额的折算

折算后信诚信息安全 A 份额的份额数保持不变，即：
$$\text{NUM}_{\text{后}} = \text{NUM}_{\text{前}}$$

信诚信息安全 A 份额持有人新增的信诚信息安全份额数 =
$$\frac{\text{NUM}_{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，
$$\text{NUM}_{\text{后}}$$

A: 折算后信诚信息安全 A 份额的份额数, 下同

信诚信息安全 A 份额折算成信诚信息安全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) 信诚信息安全 B 份额的折算

折算后信诚信息安全 B 份额的份额数保持不变, 即: NUM 后

$B = \text{NUM 前}$

B

信诚信息安全 B 份额持有人新增的信诚信息安全份额数 = [NUM 前

$B \times (\text{NAV 前}$

$B - 1.000)]$

$/ 1.000$

其中,

NUM 前

B: 折算前信诚信息安全 B 份额的份额数, 下同

NUM 后

B: 折算后信诚信息安全 B 份额的份额数, 下同

信诚信息安全 B 份额折算成信诚信息安全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。

(4) 折算后信诚信息安全份额的总份额数

折算后信诚信息安全份额的总份额数 = 不定期份额折算前信诚信息安全份额的份额数

+ 信诚信息安全份额持有人新增的信诚信息安全份额数 + 信诚信息安全 A 份额持有人新增

的信诚信息安全份额数 + 信诚信息安全 B 份额持有人新增的信诚信息安全份额数

(5) 举例

假设: 某投资人持有场内信息安全份额、信息安 A 份额、信息安 B 份额分别为 10,000 份。

在本基金的不定期份额折算基准日, 假设三类份额的基金份额净值分别如下表所示 (为便于投资者理解, 此处采用假设的份额净值进行计算, 基准日折算前准确的份额净值以当日日终基金管理人计算并经托管人复核的份额净值为准), 份额折算后, 信息安全份额、信息安 A

3

份额、信息安 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

折算前 折算后

基金份额 基金份额 基金 基金份额

净值 (假设值) 份额净值

信息安全份

额

1.523 元 10,000 份 1.000 元 15230 份信息安全份额

信息安 A 份

额

1.019 元 10,000 份 1.000 元 10,000 份信息安 A 份额+

190 份信息安全份额

信息安 B 份

额

2.027 元 10,000 份 1.000 元 10,000 份信息安 B 份额+

10,270 份信息安全份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 不定期份额折算基准日(即 2020 年 2 月 13 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; 信息安 A、信息安 B 正常交易。当日晚间, 基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

(二) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即 2020 年 2 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, 信息安 A、信息安 B 暂停交易。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) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即 2020 年 2 月 17 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(但仍需遵循基金管理人 2019 年 2 月 27 日发布的《信诚中证信息安全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 3 月 6 日发布的《信诚中证信息安全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》及 2019 年 3 月 7 日发布的《信诚中证信息安全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》中的相关限制, 相关限制如有调整, 以基金管理人届时最新公告为准), 信息安 A、信息安 B 正常交易。

(四) 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 17 日信息安 A、信息安 B 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 2 月 14 日的信息安 A、信息安 B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元), 2020 年 2 月 17 日当日信息安 A 份额和信息安 B 份额均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。

4

五、重要提示

1、本基金信息安 A、信息安 B 将于 2020 年 2 月 14 日暂停交易, 并于 2020 年 2 月 17 日起恢复正常交易。

2、本基金信息安 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征, 但在不定期份额折算后信息安 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化, 由持有单一的较低风险收益特征的信息安 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的信息安 A 份额与较高风险收益特征的信息安全份额, 因此原信息安 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加; 此外, 信息安全份额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 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性, 还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金信息安 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。在不定期份额折算后信息安 B 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化, 由持有单一的高风险收益特征的信息安 B 份额变为同时持有高风险收益特征的信息安 B 份额与较高风险收益特征的信息安全份额。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅提升, 相应地, 信息安 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅增加。

4、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。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则, 信息安 A 份额、信息安 B 份额、信息安全份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为 1 份), 舍去部分计入基金财产, 持有极小数量信息安 A 份额、信息安 B 份额、信息安全份额的持有人, 存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、信息安全份额折算基准日的份额净值与折算条件 1.500 元可能有一定差异。

7、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。

5

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 2 月 13 日