

信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资 基金之 TMT 中证 B 溢价风险提示公告

近期，中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 B 份额（场内简称：TMT 中证 B，代码：150174）二级市场交易价格较基金份额参考净值的溢价幅度较高，2020 年 4 月 29 日 TMT 中证 B 二级市场收盘价为 0.716 元，相对于当日 0.594 元的基金份额净值，溢价幅度达到 20.54%。截止 2020 年 4 月 30 日，TMT 中证 B 二级市场收盘价为 0.760 元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

- 1、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《资管新规》）要求，公募产品不得进行份额分级，应在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范，请投资者关注相关风险，如溢价买入可能造成较大损失等。
- 2、TMT 中证 B 具有预期风险、预期收益较高的特征。由于 TMT 中证 B 内含杠杆机制的设计，TMT 中证 B 基金份额参考净值的变动幅度将大于信诚中证 TMT 产业份额（场内简称：信诚 TMT，基础份额，代码：165522）净值和信诚中证 TMT 产业 A 份额（场内简称：TMT 中证 A，代码：150173）参考净值的变动幅度，即 TMT 中证 B 的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。TMT 中证 B 的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。
- 3、TMT 中证 B 的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。
- 4、截至本公告披露日，信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。
- 5、截至本公告披露日，信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。
- 6、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，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 5 月 6 日