

**信诚中证信息安全指数分级证券投资基金  
基金产品资料概要更新**

编制日期：2020年08月31日

送出日期：2020年09月01日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

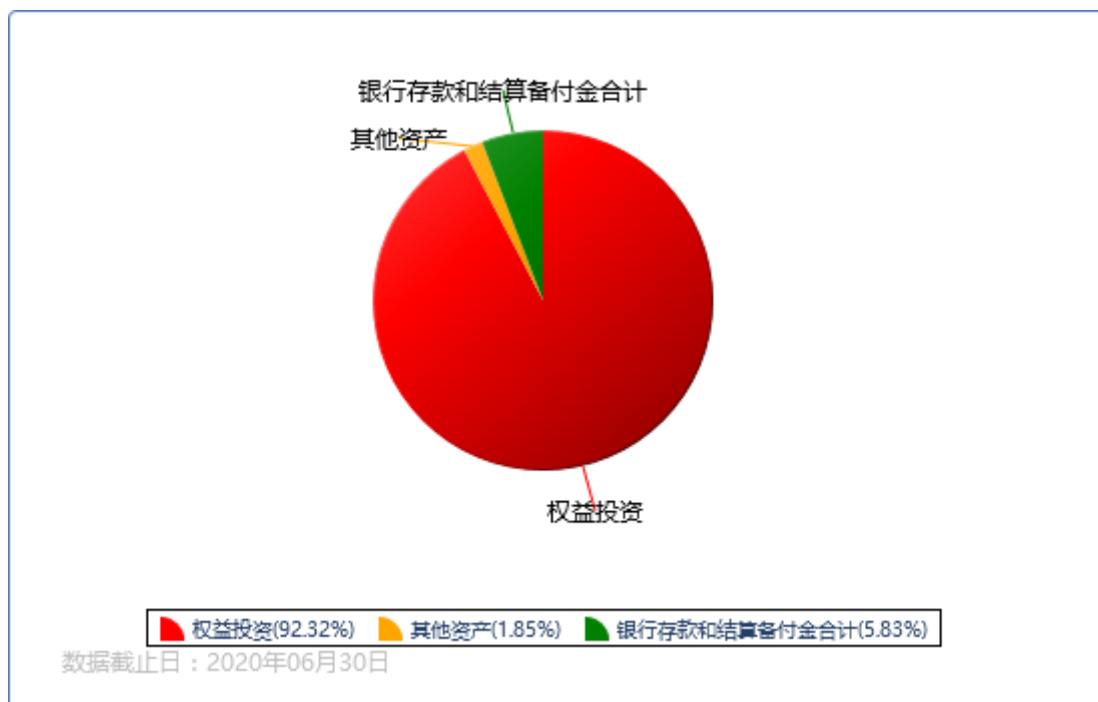
基金简称	信诚中证信息安全指数分 级	基金主代码	165523
下属分级简称	信诚中证信息安全指数分级 A	信诚中证信息安全指数分级 B	
下属分级代码	150309	150310	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公 司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2015年06月26日	基金类型	股票型
上市交易所	深圳证券交易所	上市日期	2015年07月15日
运作方式	其他开放式	开放频率	信诚信息安全份额接 受场外与场内申购和 赎回；信诚信息安全 A 份额、信诚信息安全 B 份额只上市交易，不 接受申购和赎回。
交易币种	CNY		
基金经理简介	姓名	开始担任本基金基金 经理的日期	证券从业日期
	黄稚	2019年09月04日	2011年07月15日
其他条目	其他条目名称	其他条目内容	
	1	本基金场内简称：信诚中证信息安全 指数分级场内简称为信息安全；信诚 中证信息安全指数分级 A 场内简称为 信息安 A；信诚中证信息安全指数分 级 B 场内简称为信息安 B	
	2	-	

### 二、基金投资与净值表现

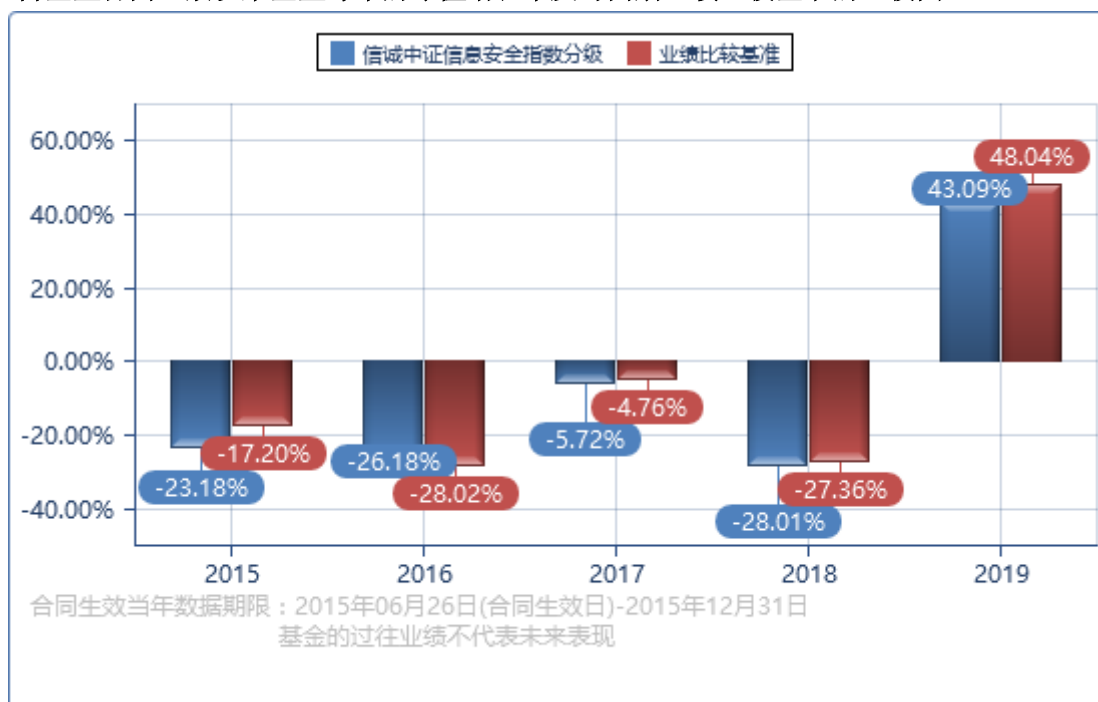
**(一) 投资目标与投资策略**

投资目标	本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证信息安全主题指数的有效跟踪，为投资者提供一个有效的投资工具。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证信息安全主题指数的成份股、备选成份股、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证信息安全主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p> <p>本基金股票资产的标的指数为中证信息安全主题指数。</p>
主要投资策略	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数，即原则上按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证信息安全主题指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚信息安全A份额具有预期风险、预期收益较低的特征；信诚信息安全B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

**(二) 投资组合资产配置图表**



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购前端金额费	M<500000.00	1.0000%	场内, 场外
	500000.00<=M<1000000.00	0.6000%	场内, 场外
	1000000.00<=M	1000.0000 元/笔	场内, 场外
赎回费	N<7 天	1.5000%	场内
	N<7 天	1.5000%	场外
	7 天<=N<365 天	0.5000%	场外
	365 天<=N<730 天	0.2500%	场外
	730 天<=N	0.0000%	场外
	7 天<=N	0.5000%	场内

申购费：M：申购金额；单位：元

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.0000%
托管费	0.2200%
其他费用	信息披露费用、会计师费、律师费等

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1. 市场风险
2. 管理风险
3. 估值风险
4. 流动性风险评估及流动性风险管理工具
5. 指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，标的指数为中证信息安全主题指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险：

#### (1) 系统性风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，基金资产主要投资于中证信息安全主题指数的成份股及其备选成份股，因此中证信息安全主题指数的市场表现将影响到基金业绩的表现，当中证信息安全主题指数出现收益变动、波动提高时，本基金的收益可能会受到影响。

#### (2) 指数复制风险

本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证信息安全主题指数，能否有效地复制指数并将跟踪误差控制在可接受范围内，对本基金的收益将产生影响。当复制方法由于市场条件受到限制或者替代股的选择存在错误时，本基金的收益可能会受到影响。

#### (3) 标的指数回报与行业平均回报偏离风险

标的指数的样本空间为中证信息安全主题指数成份股及备选成份股，其并不能完全代表整个信息安全行业，标的指数的回报率与信息安全行业股票的整体回报率可能存在偏离。

#### (4) 标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

## 6、分级结构运作的特有风险

本基金为分级基金，信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额的运作有别于普通的开放式基金和封闭式基金，投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险：

### （1）上市交易的风险

本基金在基金合同生效后，信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

### （2）杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚信息安全 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征；信诚信息安全 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

由于信诚信息安全 B 份额内含杠杆机制的设计，信诚信息安全 B 份额的净值变动幅度将大于信诚信息安全份额和信诚信息安全 A 份额的净值变动幅度，即信诚信息安全 B 份额的净值波动性将高于其他两类基金份额。

### （3）折/溢价交易风险

信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平，但信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换机制的影响，信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额的交易价格可能会相互影响。

### （4）风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后，信诚信息安全 A 份额持有人或信诚信息安全 B 份额持有人将会获得一定比例的信诚信息安全份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

当信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额终止运作后，信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额将全部转换成信诚信息安全份额的场内份额，基金份额持有人所持有的基金份额也将面临风险收益特征出现变化的风险。

### （5）份额转换的风险

当信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额终止运作后，信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额将全部转换成信诚信息安全份额的场内份额。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售业务资格，而只有具备基金销售业务资格的证券公司才可以办理投资人赎回基金份额的业务。因此，基金份额持有人可能面临会员单位不具备基金销售业务资格而导致的不能直接赎回信诚信息安全份额的场内份额的风险。此风险需要引起投资者注意，投资人可以选择在份额转换前将信诚信息安全 A 份额或信诚信息安全 B 份额卖出，或者将新增的信诚信息安全份额的场内份额通过转托管业务转入具有基金销售业务资格的证券公司后赎回基金份额。

信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额持有人进行份额折算而新增的信诚信息安全份额亦存在基金份额持有人可能面临会员单位不具备基金销售业务资格而导致的不能直接赎回信诚信息安全份额的场内份额的风险。

### （6）基金的收益分配风险

在存续期内，本基金将不进行收益分配。本基金管理人将根据基金合同的约定对本基金的信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增

份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

#### 7、本基金标的指数特有风险

##### (1) 指数可投资市值较小的风险

本基金标的指数为中证信息安全主题指数，基金份额持有人可能面临该标的指数可投资市值较小的风险。当标的指数可投资市值较小，且投资人大规模申购或赎回本基金时，本基金可能难以及时建仓或减仓，且本基金建仓或减仓可能对成份股价格产生较大影响，进而影响本基金后续建仓或减仓的交易成本。

##### (2) 基金净值受个股价格波动影响较大的风险

持有人面临基金净值受权重较大的个股价格波动影响较大的风险。

##### (3) 个股流动性受限的风险

当权重较大的个股或多个个股出现暂停交易、涨停或跌停、停牌或发生其他重大事件等导致无法投资的特殊情形时，将有可能导致本基金无法及时建仓或减仓，并可能进一步影响基金的投资、申购与赎回等运作；基金跟踪误差也可能放大。

##### (4) 基金暂停申赎导致二级市场价格大幅波动的风险

当本基金暂停申购、暂停赎回、或同时暂停申购和赎回，且信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额不同时暂停二级市场交易时，持有人可能面临信诚信息安全 A 份额和信诚信息安全 B 份额二级市场价格波幅大幅波动的风险。

#### 8、其他风险

##### (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

#### 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)，客服电话 400-666-0066

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料

#### 六、其他情况说明

无