

# 中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚中证 500 指数 分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

中信保诚基金管理有限公司已于2020年9月25日在《中国证券报》、中信保诚基金管理有限公司网站（www.citicprufunds.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund/）发布了《关于以通讯方式召开信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于2020年9月28日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

## 一、会议基本情况

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2010]1877号文核准的信诚中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于2011年2月11日生效。

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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》”）有关规定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于信诚中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2020年9月26日起，至2020年10月26日17:00止（纸质表决以表决票收件人收到表决票时间为准；短信表决以基金管理人指定系统记录时间为准）。

3、通讯纸质表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：中信保诚基金管理有限公司客户服务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

邮政编码：200120

联系电话：400-666-0066

请在信封表面注明：“信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

## 二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于信诚中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“《议案》”），《议案》详见附件一。

## 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年10月16日，即在2020年10月16日交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

## 四、投票方式

### （一）纸质表决方式

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（<http://www.citicprufunds.com.cn/>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（包括基金管理人认可的业务专用章，下同），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

（4）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机

构代其在本次基金份额持有人大会上投票；

(5) 以上各项中的公章、批文、业务专用章、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内（以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层），请在信封表面注明：“信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## **（二）短信表决方式（仅限个人投资者）**

为方便基金份额持有人参与本次大会投票，自2020年9月26日0:00起，至2020年10月26日17:00止（以基金管理人指定短信平台收到表决时间为准），基金管理人提供短信通道供个人投资者参与本次大会投票。

(1) 短信表决意见内容为“#个人客户姓名#证件号码#信诚中证500#表决意见”（双引号不用输入，#号需输入），表决意见为“同意”、“反对”、“弃权”中的一项，有且只有一种表决意见。请个人投资者务必按照上述格式要求回复短信。

(2) 基金份额持有人通过短信表决方式投票，需使用预留手机号码发送短信表决意见内容。若基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。

(3) 个人持有人可将上述短信表决意见内容发送至基金管理人指定短信平台号码（10691159555806）。基金管理人也可发送征集投票的提示短信给在基金管理人处预留手机号码的基金份额持有人，以便于基金份额持有人使用短信通道参与表决。

(4) 如因短信通道通讯故障等不可抗力或非基金管理人原因导致上述投票短信无法及时送达基金份额持有人或本基金管理人无法及时收到投票的，基金管理人不承担短信投票失效的责任，基金份额持有人在截止日前可以选择其他投票方式进行投票。

(5) 通过短信进行表决的方式仅适用于本基金的个人投资者，对机构投资者暂不开通。

## 五、授权（仅限纸面授权方式）

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

### 1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购、买入本基金的同时也可以签署授权委托书，待份额确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以本基金登记机构的登记为准。

### 2、受托人（代理人）

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

### 3、授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（<http://www.citicprufunds.com.cn/>）等方式获取授权委托书样本。

#### （1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书

复印件等)。

②机构基金份额持有人委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件二的样本),并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证明文件复印件;如代理人为机构,还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

③合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证明文件复印件;如代理人为机构,还需提供该代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

④以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

#### (2) 对基金管理人的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的,可通过邮寄授权文件和所需的相关文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件专人送交基金管理人办公地点。

#### 4、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权的,以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的,如最后时间收到的授权委托有多次,以表示具体表决意见的纸面授权为准;

(2) 如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的,视为委托人

授权代理人按照代理人意志行使表决权；

(3) 基金份额持有人以非纸面方式进行授权的，为无效授权；

(4) 如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权；

(5) 如委托人既进行了委托授权，自身又通过其它有效投票方式（含纸质表决方式及短信表决方式）参与表决的，则以委托人自身有效投票方式为准。最终表决意见的认定按本公告“六、计票”的相关原则处理。

#### 5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2020年10月23日16：30时。将纸面授权委托书和所需的相关文件寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

### 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后第2个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、纸面表决票效力的认定如下：

(1) 纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收件人收到时间为准。2020年10月26日17：00以后送达基金管理人的，为无效表决。

(2) 纸面表决票的效力认定

①纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如纸面表决票上的表决意见未选、多选、表决意见空白、表决意见模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

③如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i. 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ii. 送达时间为同一天的，如果能判断收到时间先后的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；若无法判断收到时间先后的，则视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

iii. 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

#### 4、短信表决效力确定规则

基金份额持有人通过短信表决方式投票，未使用预留手机号码回复的，视为无效表决，无效表决不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。使用预留手机号码回复的，需在表决短信里提供正确的身份证件号码、个人客户姓名及基金简称并明确选择“同意”、“反对”或“弃权”的一种。表决短信里仅提供了正确的其他信息，但表决意见未选、多选或选择形式不符合要求的视为弃权。表决短信里未提供身份证件号码、个人客户姓名、基金简称的，或提供的以上信息有误，或有其他不符合要求的情况，为无效表决，无效表决不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

基金份额持有人通过基金管理人的短信表决通道重复提交短信表决票的，以基金管理人在截止时间之前最后一次收到的基金份额持有人所发送成功的表决短信为准，先送达的表决短信视为被撤回。

#### 5、基金份额持有人以多种表决方式进行表决的，按如下原则处理：

(1) 如同时存在有效纸质、非纸质（短信表决方式）表决意见的，不论表决时间先后，均以有效的纸质表决意见为准。

(2) 如同时存在多份纸质表决意见的，效力认定规则见本公告“六、计票”

下第3点。

## 七、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额持有人所代表的各类基金份额占权益登记日各自份额类别基金总份额的50%以上(含50%)；

2、《议案》应当经参加大会的信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额持有人或其代理人在各自基金份额类别内所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400-666-0066

联系人：王文博

联系电话：400-666-0066 转9

电子邮件：ds@citicprufunds.com.cn

传真：(021) 5012 0886

网址：<http://www.citicprufunds.com.cn>

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市凤阳路660号

联系电话：(021) 62154848, 62178903 (直线)

联系人：林奇

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

注册及办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：(021) 31358666

## 九、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、

国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改,取消分级运作机制,将信诚中证500A份额与信诚中证500B份额按照基金份额净值转换为信诚中证500份额。届时,基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。

敬请投资者合理安排投资计划。

2、请基金份额持有人在邮寄表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

3、为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,本基金将在本次基金份额持有人大会计票日自开市起开始停牌,直至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30复牌。

4、基金管理人将在发布《关于以通讯方式召开信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》后2个工作日内连续公布相关提示性公告,就本次会议相关情况做必要说明,请予以留意。

5、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中信保诚基金管理有限公司网站及中国证监会基金电子信息披露平台查阅,投资者如有任何疑问,可致电400 666 0066咨询。

6、本公告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

附件一:《关于信诚中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二:授权委托书(样本)

附件三:信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四:信诚中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书

中信保诚基金管理有限公司

2020年9月29日

附件一：

## 关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案

信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人：

综合市场需求分析，为更好地满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》有关约定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，对本基金实施转型：包括终止信诚中证 500 指数分级证券投资基金的信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的运作，由分级基金转为非分级的上市基金，调整基金投资目标、投资范围、投资策略和限制、申购赎回安排、基金费用、收益分配方式、估值方法以及依据相关法律法规更新修订基金合同等，并更名为“中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）”。转型方案说明见附件四《信诚中证 500 指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

同时，为实施本基金转型方案，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时有效的法律法规，对《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上提案，请予审议。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 9 月 25 日

附件二：

## 授 权 委 托 书

本人（或本机构）特此授权 \_\_\_\_\_ 代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2020 年 10 月 26 日的以通讯方式召开的信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人（代理人）的表决意见为准。本人（或本机构）同意代理人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人（签字/盖章）： \_\_\_\_\_

委托人证件号码（填写）： \_\_\_\_\_

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）证件号码（填写）：

签署日期：      年      月      日

### 授权委托书填写注意事项:

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》及本公告要求的授权委托书。

2、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。



附件四：

## 信诚中证 500 指数分级证券投资基金转型方案说明书

### 一、声明

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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》”）有关规定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，拟对信诚中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）实施转型。

本次信诚中证 500 指数分级证券投资基金转型议案应当经参加大会的信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的基金份额持有人或其代理人在各自基金份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

信诚中证 500 指数分级证券投资基金的转型已经中国证监会变更注册，基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案。中国证监会对本次信诚中证 500 指数分级证券投资基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

### 二、转型方案要点

#### （一）变更基金名称

基金名称由“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）”。

#### （二）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制

“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”拟转型为“中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）”，转型后由分级股票型基金变更为股票型基金，因不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制，删去相关内容，包括基金份额分级、信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的上市交易、基金的份额配对转换、基金份额的折算、信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的终止运作等章节以及其他相关条款。

### （三）增加 C 类基金份额

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，就转型后形成的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）增加 C 类基金份额。在投资者申购 C 类基金份额时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

### （四）调整基金份额的上市交易安排

本基金转型前将申请原信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额退市。转型后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）可申请 A 类基金份额上市交易。具体修改内容为：

变更注册前	变更注册后
<p>（一）上市交易的基金份额 本基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的上市交易。</p> <p>（二）上市交易的地点 深圳证券交易所</p> <p>（三）上市交易的时间 在符合下述第（四）项规定的基金上市条件的前提下，信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额拟在基金合同生效后六个月内申请在深圳证券交易所上市交易。</p> <p>在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。</p> <p>（四）基金上市的条件 如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市交易。</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. 基金募集金额不低于 2 亿元；</li><li>2. 基金份额持有人不少于 1000 人；</li><li>3. 《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。</li></ol> <p>基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。</p> <p>（五）上市交易的规则</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. 信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B</li></ol>	<p>（一）基金份额的上市交易 基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以申请本基金 A 类基金份额上市交易。</p> <p>未来，基金管理人在履行相关程序后也可申请本基金 C 类基金份额等其他份额类别上市交易，基金管理人可根据需要修改基金合同相关内容，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>（二）上市交易的地点 深圳证券交易所</p> <p>（三）上市交易的时间 基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金将申请 A 类基金份额在深圳证券交易所上市交易。</p> <p>在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定报刊上刊登 A 类基金份额上市交易公告书，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>本基金的 A 类基金份额上市后，登记在证券登记系统中的 A 类基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的 A 类基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记系统后，方可上市交易。</p> <p>（四）上市交易的规则 本基金 A 类基金份额上市交易遵循《深</p>

份额分别采用不同的交易代码上市交易；

2. 信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额净值；

3. 信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

4. 信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

5. 信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

6. 信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

#### (六) 上市交易的费用

信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

#### (七) 上市交易的行情揭示

信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

#### (八) 上市交易的注册登记

投资人 T 日买入成功后，注册登记机构在 T 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自 T+1 日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人 T 日卖出成功后，注册登记机构在 T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

#### (九) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

#### (十) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等

圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定。

#### (五) 上市交易的费用

本基金 A 类基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

#### (六) 上市交易的行情揭示

本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日 A 类基金份额的基金份额净值。

#### (七) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金 A 类基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关业务规则执行。

当本基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转换为非上市的开放式基金，基金名称变更为“中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金”，除此之外，本基金的基金费率，基金的投资范围和投资策略等均不变，届时无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。

(八) 相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。

(九) 若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

<p>相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。</p> <p>(十一)若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。</p>	
---	--

**(五) 调整基金份额的申购赎回规则**

对本基金的申购赎回规则进行调整：原信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额只上市交易、不接受申购与赎回；转换后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额可通过销售机构进行日常申购与赎回。

**(六) 修改基金的投资目标、投资范围及投资策略等投资相关条款**

转型后的“中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）”为指数增强型基金，对《基金合同》中投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准等内容进行了修改。

变更注册前	变更注册后
<p>(一)投资目标</p> <p>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 500 指数的有效跟踪，为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。</p> <p>(二)投资范围</p> <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 500 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许</p>	<p>(一)投资目标</p> <p>本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力求控制基金净值增长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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>(二)投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券或票据）、资产</p>

<p>基金投资的其他品种，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>(三) 投资策略</p> <p>本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，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%。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：</p> <p>(1) 基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；</p> <p>(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来</p>	<p>支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许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）。</p> <p>本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。</p> <p>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：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例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、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。</p> <p>(三) 投资策略</p> <p>本基金为股票指数增强型基金，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，综合运用量化投资模型和多种指数增强技术，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>在资产配置上，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、金融衍生品、货币市场工具及其他金融工具。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 指数化投资策略</p> <p>本基金将运用指数化的投资方法，</p>
---	--

<p>对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>(四) 标的指数与业绩比较基准</p> <p>1. 标的指数</p> <p>本基金股票资产的标的指数为中证 500 指数。</p> <p>中证 500 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 500 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。</p> <p>如果中证 500 指数被停止编制及发布，或中证 500 指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更合适投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益并履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。</p> <p>2. 业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准为：<math>95\% \times</math> 中证 500 指数收益率 <math>+5\% \times</math> 金融同业存款利率。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时</p>	<p>通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>本基金根据标的指数成份股及其权重的定期调整，在考虑跟踪误差风险的基础上，对投资组合进行相应调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>当成份股因增发、送配等股权变动而影响成份股在标的指数中权重时，本基金将根据指数公司公告及调整权重比例，对投资组合进行相应调整；</p> <p>当成份股发生重大变化时(收购合并、分拆、退市等)，本基金将根据指数公司公告及调整权重比例，对投资组合进行相应调整；</p> <p>因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或基金各项投资禁止行为及持股比例限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将采用合理方法进行适当替代并对投资组合进行相应调整；</p> <p>本基金根据申购赎回情况，对投资组合进行调整，以实现对标的有效跟踪。在其他影响本基金跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在控制跟踪误差的前提下，对投资组合进行合理调整。</p> <p>(2) 指数增强策略</p> <p>本基金指数增强策略以量化多因子模型为基础，主要通过多因子模型对股票进行综合评价和筛选，结合风险控制和组合优化构建投资组合，以追求超越标的指数的业绩表现。</p> <p>1) 多因子模型：本基金结合中国股票市场的宏观环境、行业及个股特性，寻找适合国内市场的长期有效的因子。综合评估各类因子在国内股票市场的长期表现，根据因子类型和效果确定因子组合及权重，构建多因子选股模型，对股票进行综合评价和筛选。</p> <p>多因子模型的因子来源主要包括价值、成长、质量、动量、流动性、波动率、预期等类型。基金管理人将进行</p>
---	--

<p>公告。</p> <p>本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。</p> <p>(五) 风险收益特征</p> <p>本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、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，信诚中证 500 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；信诚中证 500 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。</p> <p>(六) 投资限制</p> <p>1. 组合限制</p> <p>本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>(4) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p>	<p>持续跟踪研究，定期或不定期地对模型涉及的因子与策略进行校验和调整，以反映市场趋势的变化。基金管理人将根据市场环境的变化以及对市场和因子的理解，综合因子的实际表现及影响因子收益的市场因素进行一定前瞻性判断，适时调整各因子类别的具体组合及权重。</p> <p>2) 风险控制与组合优化：在追求超额收益的同时，本基金将对投资组合相对标的指数的风险暴露进行分析和控制，力求将跟踪误差控制在目标范围内。在考虑预期收益和风险的基础上，本基金将结合交易成本、投资比例限制等影响因素，优化投资组合。</p> <p>3) 其他辅助增强策略</p> <p>本基金将根据市场投资机会，结合指数成份股调整等事件进行指数增强。当预期成份股发生调整或成份股调整期间，分析调入调出个股的市场表现，选择调整时机，以期获得超额收益。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>4、可转换债券投资策略</p> <p>本基金将选择发行条款较好、公司基本面良好的可转债，适度参与原股东优先配售或一级市场申购，上市后根据个券的具体情况进行持有或卖出的投资操作；同时，对于可转债的二级市场投资，本基金将综合运用多种可转债投资策略，选择信用风险可控、安全边际较高，或对应的标的股票公司或行业基本面较好、估值合理的可转债进行投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提</p>
--	--

<p>(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;</p> <p>(10) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</p> <p>(11) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;</p> <p>(12) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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>(13) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>(14) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>(15) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>(16) 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) 不低于基金资产净值的 90%, 且不得超过基金资产净值的 95%;</p> <p>(17) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;</p> <p>(18) 本基金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</p>	<p>前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上, 对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析, 采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略, 投资于资产支持证券。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货, 以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货的投资, 实现多头或空头的套期保值操作, 以管理投资组合的系统性风险, 改善组合的风险收益特性。利用股指期货降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。此外, 本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定, 根据风险管理的原则, 在风险可控的前提下, 投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征, 结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析, 对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控, 在最大限度保证基金资产安全的基础上, 力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>8、股票期权投资策略</p> <p>本基金按照风险管理的原则, 在严格控制风险的前提下, 选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断, 结合期权定价模型, 选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>9、其他衍生品投资策略</p> <p>本基金将关注其他金融衍生产品</p>
---	---

<p>保证金、应收申购款等；</p> <p>(19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(20) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；但完全按照有关指数的构成比例进行的投资不计入受此限。</p> <p>如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。</p> <p>除上述第(9)、(12)、(18)、(19)、(20)项以外，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的资产配置比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>2. 禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>(1) 承销证券；</p>	<p>的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资其他衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。</p> <p>10、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> <p>(四) 标的指数与业绩比较基准</p> <p>1. 标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证 500 指数。</p> <p>中证 500 指数是从上海和深圳证券交易所中选取 500 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。</p> <p>2. 业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准为：<math>95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}</math>。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止标</p>
---	---

<p>(2) 向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</p> <p>(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</p> <p>(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；</p> <p>(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。</p> <p>(七) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；</li> <li>2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；</li> <li>3. 有利于基金财产的安全与增值；</li> <li>4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</li> </ol> <p>(八) 基金的融资、融券</p> <p>本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。</p>	<p>的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。</p> <p>(五) 风险收益特征</p> <p>本基金为股票型指数增强基金，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。</p> <p>(六) 投资限制</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 组合限制</li> </ol> <p>基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；</li> <li>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不得包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</li> <li>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分不受此限制；</li> <li>(4) 本基金管理人管理的全部基</li> </ol>
---	--

金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分不受此限制；

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的采取定期开放方式运作的基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行证券投资的部分不受此限制；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（11）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的

	<p>总量；</p> <p>(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>(15) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；</p> <p>(16) 本基金参与转融通证券出借业务将遵守下列要求：出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(18) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：</p> <p>1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金</p>
--	---

	<p>融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4）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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>（19）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：</p> <p>1）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；</p> <p>2）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；</p> <p>4）本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；</p> <p>5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；</p> <p>（20）本基金参与股票期权交易，应当遵守下列要求：</p> <p>1）本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2）本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金</p>
--	---

	<p>或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；</p> <p>3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；</p> <p>(21) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；</p> <p>(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第(2)、(6)、(11)、(16)、(17)项以外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</p> <p>2. 禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>(1) 承销证券；</p> <p>(2) 违反规定向他人贷款或者提</p>
--	--

	<p>供担保；</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。</p> <p>(七) 基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</li> <li>2. 不谋求对上市公司的控股；</li> <li>3. 有利于基金财产的安全与增值；</li> <li>4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</li> </ol>
--	---

### (七) 变更基金的收益与分配

本基金转型前不进行收益分配，转型后的“中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)” 将新增基金收益分配原则、收益分配方案等相关内容。

变更注册前	变更注册后
-------	-------

<p>(一)基金利润的构成 基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。</p> <p>(二)基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>(三)收益分配原则 本基金（包括信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额）不进行收益分配。 经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。</p>	<p>(一)基金利润的构成 基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>(二)基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>(三)基金收益分配原则 1. 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配； 2. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红； 3. 同一类别每一基金份额享有同等分配权； 4. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在不违反法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致可调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>(四)收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>(五)收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》有关规定在指定媒介公告。</p> <p>(六)基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足</p>
---	---

	以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。
--	--

### (八) 调整基金的费率

对本基金的管理费、托管费、原指数许可使用费、申购费率及赎回费率等内容进行了调整，增加了 C 类基金份额的销售服务费。

变更注册前	变更注册后
<p>1. 基金管理人的管理费 在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下： <math>H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}</math> H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。</p> <p>2. 基金托管人的托管费 在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下： <math>H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}</math> H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值 基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。</p> <p>3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费 标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费，标的指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点</p>	<p>1. 基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下： <math>H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}</math> H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p> <p>2. 基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费计算方法如下： <math>H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}</math> H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p>

费的收取标准为本基金的资产净值的0.02%/年，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。

在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

收取下限的日均摊销数额=5万/季度\*4季度/年÷当年天数（365天或366天）≈550元/天

$H = \text{Max} (E \times 0.02\% / \text{当年天数}, 550)$

H为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。

### 3. 销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 4. 基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为增强指数基金，将按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可使用费的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

1、信诚中证500份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额	场外申购费率
M < 100万	1.2%
100万 ≤ M < 200万	0.8%
200万 ≤ M < 500万	0.4%
M ≥ 500万	1000元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

1、本基金C类份额不收取申购费，A类基金份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额 (含申购费)	A类份额申购 费率
M < 100万	1.20%
100万 ≤ M < 200万	0.80%
200万 ≤ M < 500万	0.40%
M ≥ 500万	1000元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

<p>信诚中证 500 份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。</p> <p>2、信诚中证 500 份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：</p> <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>持续持有期 (Y)</th> <th>赎回费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Y&lt;7 天</td> <td>1.50%</td> </tr> <tr> <td>7 天≤Y&lt;1 年</td> <td>0.50%</td> </tr> <tr> <td>1 年≤Y&lt;2 年</td> <td>0.25%</td> </tr> <tr> <td>Y≥2 年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注：Y：持有时间，其中 1 年为 365 日，2 年为 730 日)</p> <p>信诚中证 500 份额的场内赎回费率为固定值 0.5%，对持续持有期少于 7 日的赎回费率为 1.5%。</p> <p>从场内转托管至场外的信诚中证 500 份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。</p> <p>对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金资产。</p>	持续持有期 (Y)	赎回费率	Y<7 天	1.50%	7 天≤Y<1 年	0.50%	1 年≤Y<2 年	0.25%	Y≥2 年	0	<p>A类基金份额的场内申购费率由基金销售机构参照场外申购费率执行。</p> <p>2、本基金基金份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。</p> <p>本基金A类、C类基金份额均收取赎回费。对于持有期限少于7天的基金份额持有人，赎回费将全额计入基金财产；其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>A类基金份额和C类基金份额的场外赎回费率具体赎回费率结构如下：</p> <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>持续持有期 (Y)</th> <th>场外赎回费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Y&lt;7天</td> <td>1.50%</td> </tr> <tr> <td>Y≥7天</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注：Y：持有时间)</p> <p>本基金各类基金份额场内赎回费率参照对应类别基金份额场外赎回费率执行。</p> <p>从场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从注册登记机构登记的原场内份额登记确认日开始计算。</p>	持续持有期 (Y)	场外赎回费率	Y<7天	1.50%	Y≥7天	0
持续持有期 (Y)	赎回费率																
Y<7 天	1.50%																
7 天≤Y<1 年	0.50%																
1 年≤Y<2 年	0.25%																
Y≥2 年	0																
持续持有期 (Y)	场外赎回费率																
Y<7天	1.50%																
Y≥7天	0																

**(九) 其他相关事项的修改**

- 1、考虑到本基金转型后不再是分级基金，删除《基金合同》中关于信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额和分级机制相关的内容。
- 2、删除《基金合同》中关于基金份额发售、基金备案的部分，并补充基金的历史沿革、基金的存续等内容。
- 3、考虑到自《基金合同》生效以来，法律法规陆续修订和发布，基金管理人需要根据法律法规的要求及转型后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的产品特征修订《基金合同》的相关内容。具体修改内容见本说明之附件(《基金合同》修改前后对照表)。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及拟变更后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的产品特性相应修订《基金合同》的内容。

**三、基金份额的终止上市安排**

本基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持

有人大会决议生效后，按照深圳证券交易所的业务规则申请信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额终止上市等相关业务。

#### **四、转型选择期的相关安排**

自持有人大会表决通过后，本基金将安排不少于 20 个交易日的转型选择期，具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期期间，信诚中证 500 份额的赎回、转换转出、转托管业务照常办理，信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的交易、合并业务照常办理。基金管理人可依据法律法规进行调整，具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择卖出信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额或赎回、转换转出信诚中证 500 份额。对于在选择期内未作出上述选择的基金份额持有人，其持有的信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额或信诚中证 500B 份额将根据规则转换成为中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额。

在选择期期间选择赎回的，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对于持有期限不少于 7 天的基金份额持有人，转型选择期期间的赎回费为 0。

在选择期期间，由于信诚中证 500 指数分级证券投资基金需应对赎回、转换转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

#### **五、基金份额的转换和折算**

转型选择期届满后，管理人将确定份额转换基准日（具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告，假设该日为 T 日）。在份额转换基准日（T 日），信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额将终止上市，基金管理人将信诚中证 500

指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成基金份额净值为 1.0000 元的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的 A 类基金份额。

在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统登记在册的信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额将转换为中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统登记在册的信诚中证 500 份额将转换为中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场外份额。

信诚中证 500A 份额（或信诚中证 500B 份额）转换为中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场内基金份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。由于基金份额数取整计算存在误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险；对于持有份额数较少的信诚中证 500A 份额、信诚中证 500B 份额持有人，将面临因持有的基金份额转换后份额数不足 1 份而被计入基金财产的风险。

由信诚中证 500 份额的场内份额或信诚中证 500 份额的场外份额转换的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额数=信诚中证 500 份额的场内份额或信诚中证 500 份额的场外份额数×份额转换基准日每份信诚中证 500 份额的基金份额净值÷1.0000

由信诚中证 500A 份额转换的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额数=信诚中证 500A 份额的份额数×份额转换基准日每份信诚中证 500A 份额的份额参考净值÷1.0000

由信诚中证 500B 份额转换的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的份额数=信诚中证 500B 份额的份额数×份额转换基准日每份信诚中证 500B 份额的份额参考净值÷1.0000

基金份额转换后，中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场内份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险。

经基金份额转换后，中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类基金份额的场外份额数采用截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产。

关于原信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额转换为信诚中证 500 份额的场内份额后的持有期不连续计算，自转换为信诚信息安全份额的场内份额当日起重新计算其持有期。

关于原信诚中证 500 份额的场内份额转换后的持有期限根据中国证券登记结算有限责任公司的相关规则执行。

## **六、合规、运营可行性**

### **（一）法律方面**

转型后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）相关的法律文件经中国证监会变更注册后，基金管理人择时召集基金份额持有人大会。依据《基金合同》和《基金法》的规定，本次信诚中证 500 指数分级证券投资基金转型议案应当经参加大会的信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的基金份额持有人或其代理人在各自基金份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。因此，信诚中证 500 指数分级证券投资基金的转型不存在法律障碍。

### **（二）技术运作方面**

本次基金转型不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人与登记机构已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备等方面进行了深入研究，已经做好了基金转型的相关准备。会计师事务所将继续为转型后的基金提供服务，律师事务所将出具法律意见书，报中国证监会备案并公告。

## **七、基金转型的主要风险及预备措施**

### **（一）持有人大会不能成功召开的风险**

根据《基金法》及基金合同的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接

出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的信诚中证 500 份额、信诚中证 500A 份额与信诚中证 500B 份额的基金份额持有人所代表的各类基金份额占权益登记日各自份额类别基金总份额的 50%以上（含 50%）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的基金份额持有人参加基金份额持有人大会。

## （二）转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于2020年底完成本基金的整改,取消分级运作机制，将信诚中证500A份额与信诚中证500B份额按照基金份额净值转换为信诚中证500份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。

敬请投资者合理安排投资计划。

## 八、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400-666-0066

公司网站：www.citicprufunds.com.cn

## 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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现，基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

原基金为股票型基金，预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金

与货币市场基金，从分拆的两类基金份额来看，信诚中证 500A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；信诚中证 500B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

转型后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF），为股票型证券投资基金，其预期风险、预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，转型后的中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）预期风险高于信诚中证 500 指数分级证券投资基金的信诚中证 500A 份额。

投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 9 月 25 日