

中信保诚基金管理有限公司关于信诚沪深 300 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《信诚沪深 300 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,信诚沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)将在 2020 年 12 月 15 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,本基金定期份额折算基准日(即基金合同约定的“折算日”,下同)为每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日)。本次定期份额折算基准日为 2020 年 12 月 15 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沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“信诚 300”,交易代码:165515)和信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“沪深 300A”,交易代码:150051)。

三、基金份额折算方式

定期份额折算后沪深 300 A 份额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沪深 300A 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信诚 300 份额的场内份额分配给沪深 300A 份额持有人。信诚 300 份额持有人持有的每两份信诚 300 份额将按一份沪深 300A 份额获得新增信诚 300 份额的

分配，经过上述份额折算后，信诚 300 份额的基金份额净值将相应调整。

1)信诚300份额折算

$$NAV_{300}^{\text{后}} = NAV_{300}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

$$\text{信诚 300 份额持有人新增的信诚 300 份额数} = 0.5 \times NUM_{300}^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / NAV_{300}^{\text{后}}$$

其中：

$NAV_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前信诚 300 份额的基金份额净值，下同

$NAV_{300}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后信诚 300 份额的基金份额净值，下同

$NAV_A^{\text{前}}$ ：定期份额折算前沪深 300A 份额的基金份额净值，下同

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前信诚 300 份额的份额数，下同

持有信诚300份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增信诚300份额的场外份额的分配；持有信诚300份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增信诚300份额的场内份额的分配。

信诚300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财产；信诚300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），余额计入基金财产。

2)沪深 300A 份额折算

定期份额折算后沪深300A份额的基金份额净值=1.000元

定期份额折算后沪深300A份额的份额数 = 定期份额折算前沪深300A份额的份额数

$$\text{沪深 300A 份额持有人新增的信诚 300 份额数} = [NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)] / NAV_{300}^{\text{后}}$$

其中：

$NUM_A^{前}$ ：定期份额折算前沪深 300A 份额的份额数，下同

沪深300A份额折算成信诚300份额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) 沪深300B份额折算

沪深300B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300份额的总份额数

折算后信诚300份额的总份额数 = 定期份额折算前信诚300份额的份额数 +
信诚300份额持有人新增的信诚300份额数 + 沪深300A份额持有人新增的信诚
300份额数。

5) 举例：

假设 2020 年 12 月 15 日为定期份额折算基准日，当日折算前信诚 300 份额
的基金份额净值为 1.238 元，沪深 300A 份额的基金份额净值为 1.038 元，沪深
300B 份额的基金份额净值为 1.438 元，投资人甲持有信诚 300 份额的场内份额
10000 份，投资人乙持有沪深 300A 份额 5000 份，投资人丙持有信诚 300 份额
的场外份额 10000 份，投资人丁持有沪深 300B 份额 5000 份，则：

份额折算基准日份额折算后信诚 300 份额的基金份额净值 = $1.238 - 0.5 \times$
 $(1.038 - 1.000) = 1.219$ 元，沪深 300A 份额的基金份额净值 = 1.000 元，沪深 300B
份额的基金份额净值不变

投资人甲新增的信诚 300 份额数 = $[0.5 \times 10000 \times (1.038 - 1.000)] / 1.219 =$
155 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 300 份额数 = $[5000 \times (1.038 - 1.000)] / 1.219 = 155$ 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300份额数 = $[0.5 \times 10000 \times (1.038 - 1.000)] / 1.219 = 155.87$ 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300份额的场内份额10155份，投资人乙共持有沪深300A份额5000份及信诚300份额的场内份额155份，投资人丙共持有信诚300份额的场外份额10155.87份，投资人丁仍持有沪深300B份额5000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12月15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；沪深300A和沪深300B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12月16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；沪深300A暂停交易，沪深300B正常交易。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) 定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2020年12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；沪深300A和沪深300B正常交易。

五、重要提示

(一) 根据本基金管理人于2020年12月2日发布的《信诚沪深300指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，信诚沪深300A份额和信诚沪深300B份额将于2021年1月4日终止上市(最后交易日为2020年12月31日)，并于2020年12月31日日终以信诚沪深300份额的基金份额净值为基准，信诚沪深300A份额、信诚沪深300B份额按照各自的基金份额净值折算成场内信诚沪深300份额。敬请投资者关注相关风险以及基金管理人发布的相关公告，合理安排投资计划。

(二) 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12月17日沪深300A即时行情显示的前收盘价为2020年12月16日的沪深300A份额净值(四舍五入至0.001元)。由于沪深300A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12月17日的前收盘价可能有较大差异，12月17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。

(三) 沪深300A于期末的约定应得收益将折算为信诚300场内份额分配给沪深300A的份额持有人，而信诚300为跟踪沪深300指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此沪深300A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。

(四) 由于沪深300A新增份额折算成的信诚300的场内份额数和信诚300的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，持有较少沪深300A或信诚300的份额持有人存在无法获得新增场内信

诚 300 份额的可能性。

(五) 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热线 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益和本金安全。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的法律文件及相关公告,关注基金特有风险,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 12 月 10 日