

信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金 可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》关于不定期份额折算的相关规定，当信诚 TMT 份额（场内简称：信诚 TMT，基础份额，代码：165522）的基金份额净值大于或等于 1.500 元，本基金将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2020 年 2 月 20 日，信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额（信诚 TMT 份额）的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值 1.500 元，在此提请投资者密切关注信诚 TMT 份额近期净值的波动情况。

针对可能发生的不定期份额折算，本基金管理人特别提示如下：

一、信诚 TMT 份额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。当发生合同规定的上述不定期份额折算时，信诚 TMT 份额的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额折算日折算前信诚 TMT 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信诚 TMT 份额。

二、TMT 中证 A 份额（场内简称：TMT 中证 A，代码：150173）具有预期风险、预期收益较低的特征。当发生合同规定的上述不定期份额折算时，基金份额折算日折算前 TMT 中证 A 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信诚 TMT 份额，TMT 中证 A 份额的基金份额净值将调整为 1.000 元。即原 TMT 中证 A 份额的持有人在不定期份额折算后将持有 TMT 中证 A 份额和信诚 TMT 份额。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的低风险收益特征份额变为同时持有低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

三、TMT 中证 B 份额（场内简称：TMT 中证 B，代码：150174）具有预期风险、预期收益较高的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时，基金份额折算日折算前 TMT 中证 B 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信诚 TMT 份额，TMT 中证 B 份额的基金份额净值将调整为 1.000 元。即原 TMT 中证 B 份额的持有人在不定期份额折算后将持有 TMT 中证 B 份额和信诚 TMT 份额。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

四、TMT 中证 A 份额、TMT 中证 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。

五、根据合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日信诚 TMT 份额的净值可能与触发折算的阈值 1.500 元有一定差异。

六、本基金管理人的其他重要提示：

若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停 TMT 中证 A 份额与 TMT 中证 B 份额的上市交易和信诚 TMT 份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金基金合同》及《信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金招募说明书》。投资者可致电本公司客户服务电话 400-666-0066，或登录本公司网站 www.citicprufunds.com.cn 了解或咨询详情。

七、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请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。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 2 月 21 日