

关于信诚新双盈分级债券型证券投资基金赎回及转换转出结果和新双盈 A 份额折算的公告

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）分别于 2020 年 4 月 30 日和 2020 年 5 月 7 日在指定媒介及本公司网站（www.citicprufunds.com.cn）发布了《关于信诚新双盈分级债券型证券投资基金折算方案的公告》（简称“《折算公告》”）和《信诚新双盈分级债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换转出业务的公告》（简称“《开放公告》”）。2020 年 5 月 8 日为信诚新双盈分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）A 份额（以下简称“新双盈 A”）第七个运作周年的第三个基金份额折算基准日及新双盈 A 和本基金 B 份额（以下简称“新双盈 B”）的开放日，现将相关事项公告如下：

一、本次新双盈 A 的基金份额折算结果

根据《折算公告》的规定，2020 年 5 月 8 日，折算后，新双盈 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，新双盈 A 的折算比例为 1.008196721。折算前，新双盈 A 的基金份额总额为 7,501,223.73 份，折算后，新双盈 A 的基金份额总额为 7,562,709.17 份。各基金份额持有人持有的新双盈 A 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资产。

投资者自 2020 年 5 月 8 日起（含该日）可在销售机构查询其原持有的新双盈 A 的份额折算结果。

二、本次新双盈 A 与新双盈 B 开放赎回及转换转出的确认结果

（以下所涉及赎回内容皆涵盖基金份额的转换转出。）

新双盈 B 已于 2020 年 5 月 6 日进行了基金份额折算，根据 2020 年 5 月 8 日刊登的《关于信诚新双盈分级债券型证券投资基金 B 份额折算结果的公告》显示，此次新双盈 B 折算后的基金份额总额为 4,709,287.70 份。

本次开放日仅开放申购、赎回及转换转出业务，不开放转换转入业务，经本公司统计，2020 年 5 月 8 日，本公司共收到投资者关于新双盈 A 的有效申购申请(包括基金转入)总金额为 8000000.00 元，有效赎回申请（包括基金转出)总份额为 125920.05 份；新双盈 B 的有效申购申请(包括基金转入)总金额为 4000000 元，有效赎回申请（包括基金转出)总份额为 232641.88 份。

根据本基金《基金合同》、《招募说明书》等法律文件以及《开放公告》中对于新双盈 A 和新双盈 B 的共同开放日其申购与赎回申请的确认原则的说明：

在本基金（包括新双盈 A 和新双盈 B）的每个开放日（T 日）的下一个工作日（T+1 日），所有经确认有效的的新双盈 A 和新双盈 B 的基金份额的赎回申请全部予以成交确认。

在任一运作周年的第 3 个新双盈 A 的开放日，即新双盈 A 和新双盈 B 共同的开放日（即运作周年到期日）提出的对于新双盈 A 和新双盈 B 的申购申请，如果对新双盈 A 和新双盈 B 的有效申购与赎回申请进行确认后，新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二，则所有经确认有效的的新双盈 A 和新双盈 B 的申购申请全部予以成交确认；如果对新双盈 A 和新双盈 B 的有效申购与赎回申请进行确认后，新双盈 A 的份额余额小于新双盈 B 份额余额的三分之二，则所有经确认有效的的新双盈 A 的申购申请全部予以成交确认，并对新双盈 B 分以下三种情形进行处理：

（a）在对新双盈 A 的有效申购与赎回申请进行确认后，如果仅对新双盈 B 的有效赎回申请进行确认，新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二，则对新双盈 B 的有效申购申请全部不予确认；

(b) 在对新双盈 A 的有效申购与赎回申请进行确认后, 如果仅对新双盈 B 的有效赎回申请进行确认, 新双盈 A 的份额余额仍小于新双盈 B 份额余额的三分之二倍, 则对新双盈 B 的有效申购申请全部不予确认, 并按照新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二倍的原则, 对新双盈 B 的份额余额进行按比例强制赎回;

(c) 在对新双盈 A 的有效申购与赎回申请进行确认后, 如果仅对新双盈 B 的有效赎回申请进行确认, 此时新双盈 A 的份额余额大于新双盈 B 份额余额的三分之二倍, 则按照新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二倍的原则, 对新双盈 B 的有效申购申请按当日申请比例进行成交确认, 而不会对新双盈 B 既有的份额余额进行强制赎回。

如果对新双盈 A 和新双盈 B 的有效申购与赎回申请进行确认后, 新双盈 A 的份额余额大于新双盈 B 份额余额的三分之二倍, 则所有经确认有效的新双盈 B 的申购申请全部予以成交确认, 并对新双盈 A 分以下三种情形进行处理:

(a) 在对新双盈 B 的有效申购与赎回申请进行确认后, 如果仅对新双盈 A 的有效赎回申请进行确认, 新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二倍, 则对新双盈 A 的有效申购申请全部不予确认;

(b) 在对新双盈 B 的有效申购与赎回申请进行确认后, 如果仅对新双盈 A 的有效赎回申请进行确认, 新双盈 A 的份额余额仍大于新双盈 B 份额余额的三分之二倍, 则对新双盈 A 的有效申购申请全部不予确认, 并按照新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二倍的原则, 对新双盈 A 的份额余额进行按比例强制赎回;

(c) 在对新双盈 B 的有效申购与赎回申请进行确认后, 如果仅对新双盈 A 的有效赎回申请进行确认, 此时新双盈 A 的份额余额小于新双盈 B 份额余额的三分之二倍, 则按照新双盈 A 的份额余额等于新双盈 B 份额余额的三分之二倍的原则, 对新双盈 A 的有效申购申请按当日申请比例进行成交确认, 而不会对新双盈 A 既有的份额余额进行强制赎回。

经本公司统计, 2020 年 5 月 8 日, 新双盈 A 的有效申购申请总额为 8000000.00 元, 有效赎回申请总份额为 125920.05 份。新双盈 B 的有效申购申请总额为 4000000.00 元, 有效赎回申请总份额为 232641.88 份。新双盈 A 的份额余额小于 2/3 倍新双盈 B 的份额余额。

根据此次开放日新双盈 A 与新双盈 B 的有效申购与赎回申请的数额, 并结合相关申购、赎回的确认原则, 本基金管理人对新双盈 A 的所有有效申购与赎回申请以所有有效申购与赎回申请以申请进行确认, 同时对新双盈 B 的有效申购申请进行比例确认, 计算方式如下:

新双盈 B 申购申请的确认比例 = (七分之三倍开放后新双盈 A 的份额余额数 - (新双盈 B 经折算后的份额数 - 新双盈 B 有效赎回申请份额数)) / 比例确认前新双盈 B 的有效申购申请份额数

其中, 开放后新双盈 A 的份额余额数 = 新双盈 A 折算后的基金份额总额 + 新双盈 A 开放日的有效申购份额数 - 新双盈 A 开放日的有效赎回申请总额。

本次新双盈 B 申购申请的确认比例为 53.4887192%。

投资者对新双盈 B 的申购申请确认金额 = 投资者提交的对新双盈 B 的有效申购申请金额 × 新双盈 B 申购申请的确认比例。

当发生比例确认时, 新双盈 B 的申购申请确认金额不受申购最低限额的限制。申购申请确认金额的计算结果保留到小数点后两位, 小数点两位以后的部分四舍五入, 由此产生的误差计入基金资产。

本基金管理人已经于 2020 年 5 月 8 日根据上述原则对本次新双盈 A 及新双盈 B 的赎回申请进行了确认, 并为投资者办理了有关份额权益的注册登记变更手续。投资者可于 2020 年 5 月 12 日起到各销售网点查询赎回的确认情况。投资者赎回申请成功后, 本基金管理人将自 2020 年 5 月 8 日起 7 个工作日内通过相关销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户。本基金此次实施基金份额折算及开放赎回与转换转出业务结束后, 信诚新双盈分级债券型证

券投资基金的总份额为 22,052,555.89 份，其中，新双盈 A 的总份额为 15,436,789.12 份，新双盈 B 的总份额为 6,615,766.77 份，新双盈 A 与新双盈 B 的份额配比为 7：3。

风险提示：

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时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。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 5 月 12 日