

关于信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金修订基金合同的公告

经国务院同意，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》明确规定，公募产品不得进行份额分级，且要求过渡期后，“金融机构不得再发行或存续违反本意见规定的资产管理产品”。为落实上述规定要求，并根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，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”）对信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同进行了修改，并已报监管部门备案。本次法律文件的修改系根据相关法律法规及监管要求而进行，符合相关法律法规的规定以及基金合同的约定。本次基金合同修订涉及根据监管规定取消分级机制，并据此就信诚有色 A 份额（场内简称：有色 800A，基金代码：150150）与信诚有色 B 份额（场内简称：有色 800B，基金代码：150151）的终止运作，包括终止上市与份额折算等后续具体操作做了安排，具体修改内容详见附件。

重要提示：

- 1、本次基金合同修改自 2020 年 11 月 19 日起生效。
- 2、本基金信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额的终止运作的时间安排，将由基金管理人另行公告。

3、本公司将在公司网站（www.citicprufunds.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）公布修改后的基金合同，基金管理人将届时更新基金的招募说明书和基金产品资料概要相关内容。

风险提示：

1、本基金修订基金合同后，各类份额持有人的影响列示如下表：

公告前 ¹			公告后、折算前			折算后		
持有份额类别	折溢价	净值杠杆	持有份额类别	折溢价	净值杠杆	持有份额类别	折溢价	净值杠杆
A 级份额	D _A	无	不变 ²	D _A 可能收窄	不变 ²	基础份额	无	无
B 级份额	D _B	L _B	不变 ²	D _B 可能收窄	L _B 正常变化	基础份额	无	无
基础份额	无	无	不变 ²	不变 ²	不变 ²	基础份额	无	无

备注 1：“公告前”指的是本次公告之前。

备注 2：“不变”指的是与本次公告之前相比没有变化。

备注 3：D_A=A 级份额价格/A 级份额净值-1；D_B=B 级份额价格/B 级份额净值-1；L_B=基础份额净值/（B 级份额净值×B 级份额数/（A 级份额数+B 级份额数））；

L_B随基础份额净值的变化而变化，而基础份额净值根据标的指数的涨跌而涨跌。

（1）由于信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额可能存在折溢价交易情形，本次基金合同修订后，其折溢价率可能发生较大变化，**如果投资者以溢价买入，折算后可能遭受较大损失**（具体折算方式及示例详见风险提示第 4 条及修订后的基金合同条款）。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

（2）信诚有色 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特

征，但在份额折算后，信诚有色 A 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的信诚有色份额，由于信诚有色份额为跟踪中证 800 有色金属指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原信诚有色 A 份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

信诚有色 B 份额具有一定的杠杆属性，具有高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，信诚有色 B 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的信诚有色份额，由于信诚有色份额为跟踪中证 800 有色金属指数的基础份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，不会形成杠杆性收益或损失，但原信诚有色 B 份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额折算为信诚有色份额前，信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额的持有人有两种方式退出：

(1) 在场内按市价卖出基金份额；

(2) 在场内买入等量的对应份额（即信诚有色 A 份额持有人买入等量的信诚有色 B 份额，或者信诚有色 B 份额持有人买入等量的信诚有色 A 份额），合并为信诚有色份额，按照信诚有色份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

3、本次基金合同修订后，由于信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性

风险。

4、在份额折算基准日日终，以信诚有色份额的基金份额净值为基准，信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额按照各自的**基金份额净值**（而不是二级市场价格）折算成场内信诚有色份额。信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内信诚有色份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。

信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化，示例如下：

假设份额折算基准日信诚有色份额、信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额的基金份额净值的分别为：0.900 元、1.010 元、0.790 元，投资者甲、乙、丙分别持有场内信诚有色份额、信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额各 100,000 份，其所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额净值 (元)	基金份额 (份)		基金份额净值 (元)	基金份额
场内信诚有色份额	0.900	100,000	(无变化)	0.900	100,000 份场内信诚有色份额
信诚有色 A 份额	1.010	100,000	1.12222222 (全部折算为信诚有色份额)	0.900	112,222 份场内信诚有色份额
信诚有色 B 份额	0.790	100,000	0.87777778 (全部折算为信诚有色份额)	0.900	87,777 份场内信诚有色份额

5、信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额折算为信诚有色份额后，信诚有色份额不能在二级市场进行交易，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于

所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额合并或折算为信诚有色份额后，**基金份额持有期自信诚有色份额确认之日起计算。**

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书的约定，本基金的赎回费率如下：

(1) 场外赎回费率

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。赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，具体如下：

持有时间 (Y)	赎回费率
$Y < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq Y < 1$ 年	0.50%
$1 \text{ 年} \leq Y < 2$ 年	0.25%
$Y \geq 2$ 年	0.00%

(注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。1 年为 365 日，2 年为 730 日，依此类推)

从场内转托管至场外的信诚有色份额，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。

(2) 场内赎回费率

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%。

本基金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。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于 7 日的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本公司承诺诚实信用地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未来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件。

特此公告。

附件：信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同修订对照表

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 11 月 18 日

附件：信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同修订对照表

修改前	修改后
<p>四、基金份额分级</p> <p>(三)信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额概要</p> <p>4. 信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的终止运作</p> <p>经基金份额持有人大会决议通过，信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。</p>	<p>四、基金份额分级</p> <p>(三)信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额概要</p> <p>4. 信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的终止运作</p> <p>经基金份额持有人大会决议通过<u>或出现基金合同约定的情形</u>，信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额可申请终止运作。<u>如需召开基金份额持有人大会的</u>，该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。</p>
<p>十二、基金份额持有人大会</p> <p>(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：</p> <p>8、终止信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的运作；</p>	<p>十二、基金份额持有人大会</p> <p>(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：</p> <p>8、终止信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的运作，<u>但根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定取消分级运作机制而需要终止运作的除外</u>；</p>
<p>二十二、基金收益与分配</p> <p>(二) 收益分配原则</p>	<p>二十二、基金收益与分配</p> <p>(二) 收益分配原则</p>

<p>.....</p> <p>经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止信诚有色 A 份额与信诚有色 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原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。</p>	<p>.....</p> <p>经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止信诚有色 A 份额与信诚有色 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原则，<u>根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》终止分级运作的除外</u>。具体见基金管理人届时发布的相关公告。</p>
<p>二十四、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的终止运作</p> <p>(一) 经基金份额持有人大会决议通过，信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额各自表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。</p>	<p>二十四、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的终止运作</p> <p><u>(一) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》终止分级运作</u></p> <p><u>1、本基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。为此，基金管理人将向深圳证券交易所申请基金份额终止上市，并办理信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额的份额折算。具体终止运作的时间安排见基金管理人届时发布的公告。基金管理人应将基金合同根据前述法律法规做相应修改并公告。</u></p> <p><u>2、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的份额折算</u></p> <p><u>份额折算基准日，信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额将全部折算成场内信诚有色份额。</u></p> <p><u>(1) 份额折算基准日</u></p>

份额折算基准日为信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额终止上市日的前一交易日，具体日期见基金管理人届时发布的公告。

(2) 份额折算方式

在份额折算基准日日终，以信诚有色份额的基金份额净值为基准，信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额按照各自的基金份额净值折算成场内信诚有色份额。信诚有色 A 份额（或信诚有色 B 份额）基金份额持有人持有的折算后场内信诚有色份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

信诚有色 A 份额（或信诚有色 B 份额）的折算比例 = 份额折算基准日信诚有色 A 份额（或信诚有色 B 份额）的基金份额净值 / 份额折算基准日信诚有色份额的基金份额净值

信诚有色 A 份额（或信诚有色 B 份额）基金份额持有人持有的折算后场内信诚有色份额 = 基金份额持有人持有的折算前信诚有色 A 份额（或信诚有色 B 份额）的份额数 × 信诚有色 A 份额（或信诚有色 B 份额）的折算比例

(3) 份额折算后的基金运作

信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额全部折算为场内信诚有色份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回，开始申购、赎

回的时间及具体操作以基金管理人的公告为准。

(4) 份额折算的公告

信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额的份额折算结束后，基金管理人应在指定媒介公告。

3、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可暂停相关份额的交易和申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(二) 除本章第(一)条另有约定外，

经基金份额持有人大会决议通过，信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额可申请终止运作。如需召开基金份额持有人大会的，该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持信诚有色份额、信诚有色 A 份额与信诚有色 B 份额各自表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。