

## 中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证信息安全指数分级 证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《信诚中证信息安全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，信诚中证信息安全指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在 2020 年 12 月 4 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为每年 12 月 5 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）。由于 2020 年 12 月 5 日为非工作日，本次定期份额折算基准日为该日之前的最后一个工作日，即 2020 年 12 月 4 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中证信息安全指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：“信息安全”，交易代码：165523）和信诚中证信息安全指数分级证券投资基金之 A 份额（场内简称：“信息安 A”，交易代码：150309）。

### 三、基金份额折算方式

定期份额折算后信息安 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信息安 A 份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分将折算为信息安全份额的场内份额分配给信息安 A 份额持有人。信息安全份额持有人持有的每两份信息安全份额将按一份信息安 A 份额获得新增信息安全份额的分配，经过上述份额折算后，信息安全份额、信息安 A 份额的基金份额净值将相应调整。

#### （1）信息安全份额的折算

$$NAV_{母}^{后} = NAV_{母}^{前} - 0.5 \times (NAV_{A}^{前} - 1.000)$$

$$\text{信息安全份额持有人新增的信息安全份额数} = 0.5 \times NUM_{母}^{前} \times (NAV_{A}^{前} - 1.000) / NAV_{母}^{后}$$

其中：

NAV<sub>母</sub><sup>前</sup>: 定期份额折算前信息安全份额的基金份额净值, 下同

NAV<sub>母</sub><sup>后</sup>: 定期份额折算后信息安全份额的基金份额净值, 下同

NAV<sub>A</sub><sup>前</sup>: 定期份额折算前信息安 A 份额的基金份额净值, 下同

NUM<sub>母</sub><sup>前</sup>: 定期份额折算前信息安全份额的份额数, 下同

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

信息安全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资产; 信息安全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), 余额计入基金资产。

## (2) 信息安 A 份额的折算

定期份额折算后信息安 A 份额的基金份额净值=1.000 元

定期份额折算后信息安 A 份额的份额数=定期份额折算前信息安 A 份额的份额数

信息安 A 份额持有人新增的信息安全份额数= $[\text{NUM}_{\text{A}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{A}}^{\text{前}} - 1.000)] / \text{NAV}_{\text{母}}^{\text{后}}$

其中:

NUM<sub>A</sub><sup>前</sup>: 定期份额折算前信息安 A 份额的份额数, 下同

信息安 A 份额折算成信息安全份额的场内份额取整计算 (最小单位为 1 份), 余额计入基金资产。

## (3) 信息安 B 份额的折算

信息安 B 份额不进行定期份额折算, 其基金份额净值和份额数保持不变。

## (4) 折算后信息安全份额的总份额数

折算后信息安全份额的总份额数=定期份额折算前信息安全份额的份额数+信息安全份额持有人新增的信息安全份额数+信息安 A 份额持有人新增的信息安全份额数。

## (5) 举例:

假设 2020 年 12 月 4 日为定期份额折算基准日, 当日折算前信息安全份额的基金份额净值为 0.893 元, 信息安 A 份额的基金份额净值为 1.043 元, 信息安 B

份额的基金份额净值为 0.743 元，投资人甲持有信息安全份额的场内份额 10000 份，投资人乙持有信息安 A 份额 5000 份，投资人丙持有信息安全份额的场外份额 10000 份，投资人丁持有信息安 B 份额 5000 份，则：

份额折算基准日份额折算后信息安全份额的基金份额净值 $=0.893-0.5\times(1.043-1.000)=0.872$  元，信息安 A 份额的基金份额净值 $=1.000$  元，信息安 B 份额的基金份额净值不变

投资人甲新增的信息安全份额数 $=[0.5\times10000\times(1.043-1.000)]/0.872$  元 $=246$  份（场内份额截位取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金资产）

投资人乙新增的信息安全份额数 $=[5000\times(1.043-1.000)]/0.872$  元 $=246$  份（场内份额截位取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金资产）

投资人丙新增的信息安全份额数 $=[0.5\times10000\times(1.043-1.000)]/0.872$  元 $=246.56$  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资产）

即：份额折算基准日份额折算后，投资人甲共持有信息安全份额的场内份额 10246 份，投资人乙共持有信息安 A 份额 5000 份及信息安全份额的场内份额 246 份，投资人丙共持有信息安全份额的场外份额 10246.56 份，投资人丁仍持有信息安 B 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 4 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；信息安 A 和信息安 B 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 7 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；信息安 A 暂停交易，信息安 B 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 8 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；信息安 A 和信息安 B 正常交易。

## 五、重要提示

（一）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，将信息安 A 份额与信息安 B 份额按照基金份额净值折算为信息安全份额，并终止信息安 A 份额与信息安 B 份额的上市。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 8 日信息安 A 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 12 月 7 日的信息安 A 份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于信息安 A 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 8 日的前收盘价可能有较大差异，2020 年 12 月 8 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）信息安 A 期末的约定应得收益将折算为信息安全场内份额分配给信息安 A 的份额持有人，而信息安全为跟踪中证信息安全主题指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此信息安 A 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）由于信息安 A 新增份额折算成的信息安全的场内份额数和信息安全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），余额计入基金资产，持有较少信息安 A 或信息安全份额持有人存在无法获得新增场内信息安全份额的可能性。

（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](http://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 1 日