

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定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据信诚沪深300指数分级证券投资基金（以下简称：本基金）基金合同、招募说明书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，中信保诚基金管理有限公司（以下简称：本公司）以2020年12月15日为份额折算基准日，对信诚沪深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）的场外份额、场内份额和信诚沪深300指数分级证券投资基金A份额（以下简称“沪深300A”，交易代码：150051）实施定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2020年12月15日，信诚300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的场内份额、沪深300A份额经折算后的份额数截位取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产。份额折算比例四舍五入精确到小数点后第9位，如下表所示：

基金份额名称	折算前份额（份）	新增份额折算比例	折算后基金份额净值（元）	折算后基金份额累计净值（元）	折算后份额（份）
信诚300场外份额	77,454,346.18	0.019716798	1.151	1.749	78,981,497.88
信诚300场内份额	38,180,905.00	0.019716798	1.151	1.749	42,344,623.00
沪深300A份额	86,497,661.00	0.039433596	1.000	1.459	86,497,661.00

注1：该“折算后份额”包括沪深300A份额经折算后产生的新增信诚300场内份额。

注2：信诚300场外份额经份额折算后产生新增的信诚300场外份额；信诚300场内份额经份额折算后产生新增的信诚300场内份额；沪深300A份额经份额折算后产生新增的信诚300场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2020年12月17日起，本基金恢复申购、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）和配对转换业务，沪深300A份额将于2020年12月17日在深圳证券交易所复牌。

三、其他需要提示的事项

1、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。

2、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的份额净值（四舍五入至0.001元），即1.000元。由于沪深300A折算前存在折价交易情形，2020年12月15日的收盘价为1.029元，扣除约定收益后为0.984元，与2020年12月17日的前收盘价存在较大差异，2020年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。

3、沪深300A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。

4、由于沪深300A新增份额所折算成的信诚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。

5、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。

四、投资者可以通过以下途径了解或咨询相关情况

1、本公司客户服务电话：400-666-0066

2、本公司网站: www.citicprufunds.com.cn

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2020年12月17日