关于信诚中证500指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定以通讯方式召开信诚中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，会议权票表决起止时间为自2020年9月26日起，至2020年10月26日17:00止。为保护投资者利益，现基金管理人提示如下：

一、如本次基金份额持有人大会表决成功召开或议案未通过的，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，将信诚中证500A份额与信诚中证500B份额按照基金份额净值转换为信诚中证500分额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

二、信诚中证500A份额（场内简称：中证500A，基金代码：150028）与信诚中证500B份额（场内简称：中证500B，基金代码：150029）将于基金份额持有人大会计票日（2020年10月28日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止停牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

三、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站（www.citicprufunds.com.cn）查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话400-666-0066咨询。

中信保诚基金管理有限公司
2020年9月25日

关于信诚中证800金融指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定以通讯方式召开信诚中证800金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，会议权票表决起止时间为自2020年10月23日起，至2020年10月23日17:00止。为保护投资者利益，现基金管理人提示如下：

为此，本基金管理人提示如下：

一、如本次基金份额持有人大会表决成功召开或议案未通过的，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，将信诚金融A份额与信诚金融B份额按照基金份额净值转换为信诚金融分额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

二、信诚金融A份额（场内简称：金融A，基金代码：150157）与信诚金融B份额（场内简称：金融B，基金代码：150158）将于基金份额持有人大会计票日（2020年10月27日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止停牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

三、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站（www.citicprufunds.com.cn）查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话400-666-0066咨询。

中信保诚基金管理有限公司
2020年9月25日

中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2010]1877号文核准的信诚中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于2011年2月11日生效。

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚中证500指数分级证券投资基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，对本基金实施转型；包括终止信诚中证500指数分级证券投资基金的信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的证券交易，由分级基金转为非分级的上市基金，调整基金投资目标、投资范围、投资策略和限制，申请调整业绩比较基准，基金费用、收益分配方式、名称方式以及依据相关法律法规规定的其他事项，并提交为“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”。转型方案说明见附件四《信诚中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

同时，为实施本基金转型方案，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时的有效的法律法规，对《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上提案，请予审议。

中信保诚基金管理有限公司
2020年9月25日

附件二：

授权委托书

本人（或本机构）特此授权代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年10月26日的以通讯方式召开的信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以委托人（代理人）的表决意见为准。本人（或本机构）同意代理人转授权，转授权权限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）证件号码（填写）：

签署日期：　　年　月　日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》及本公告要求的授权委托书。

2、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件三：

信诚中证500指数分级证券投资基金
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
审议事项		同意	反对　弃权
关于信诚中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案			
基金份额持有人（或受托人、代理人）签名或盖章			
			年　月　日

说明：

请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票（但其他各项符合会议通知规定的）均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。

附件四：

信诚中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书

一、声明

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，拟对信诚中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）实施转型。

本次信诚中证500指数分级证券投资基金转型议案应当经参加大会的信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额持有人或其代理人在各自基金份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方有效，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

信诚中证500指数分级证券投资基金的转型已经中国证监会变更注册，基金份额持有人大会表决通过的决议需报证监会备案，中国证监会对本次信诚中证500指数分级证券投资基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“信诚中证500指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”。

（二）不再设置基金分级的分级、折算与配对转换等机制

“信诚中证500指数分级证券投资基金”拟转型为“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”，转型后由分级股票型基金变更为股票型基金，因而不再设置基金分级的分级、折算与配对转换等机制，删去相关内容，包括基金分级分级、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的上市交易、基金的分级配对转换、基金份额折算、信诚金融A份额与信诚金融B份额的上市交易、基金的分级配对转换、基金份额折算、信诚金融A份额与信诚金融B份额的终止运作等章节以及其他相关条款。

（三）增加C类基金份额

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，就转型后形成的中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）增加C类基金份额。在投资者申购C类基金份额时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

（四）调整基金份额的上市交易安排

本基金转型前将申请信诚中证500A份额与信诚中证500B份额退市。转型后的中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）可申请入类基金份额上市交易。具体修改内容为：

变更注册前	变更注册后
（一）上市交易的基金份额 本基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的上市交易。 （二）上市交易的地点 深圳证券交易所 （三）上市交易的时间 在符合下述第（四）项规定的基金上市条件的前提下，信诚中证500A份额与信诚中证500B份额在基金合同生效后六个月内申请在深圳证券交易所上市交易。 在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前3个工作日在指定媒介上刊登公告。 （四）基金上市的条件 如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市交易。 1.基金募集金额不低于2亿元； 2.基金份额持有人不少于1000人； 3.《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。 基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日的至少3个工作日发布基金上市交易公告书。 （五）上市交易规则 1.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额分别采用不同的交易规则。 2.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额采用价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行； 4.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额采用价格最小变动单位为0.001元人民币； 6.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》与其他有关规定。 （六）上市交易的费用 信诚中证500A份额、信诚中证500B份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。 （八）上市交易的注册登记 投资人于T日买入或动后，注册登记机构在T日自动为投资人登记股票持有人，于T+1日（含该日）后有权买出该部分基金。 投资人于T日卖出或动后，注册登记机构在T日自动为投资人办理股票权益的注册登记手续。 （九）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市情况 信诚中证500A份额、信诚中证500B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所规则执行。 （十）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行。 （十一）若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司调整了基金上市交易的新动能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应动能。	（一）基金份额的上市交易 基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金将申请A类基金份额在深圳证券交易所上市交易。 未来，基金管理人在履行相关程序后也可申请本基金C类基金份额等其他份额类别上市交易，基金管理人可根据需要修改基金合同相关内容，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。 （二）上市交易的地点 深圳证券交易所 （三）上市交易的时间 基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金将申请A类基金份额上市交易。 在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前3个工作日在指定媒介上刊登公告。 （四）基金上市的条件 如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市交易。 1.基金募集金额不低于2亿元； 2.基金份额持有人不少于1000人； 3.《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。 基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日的至少3个工作日发布基金上市交易公告书。 （五）上市交易的规则 1.信诚金融A份额、信诚金融B份额分别采用不同的交易代码上市交易； 2.信诚金融A份额、信诚金融B份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额净值； 3.信诚金融A份额、信诚金融B份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行； 4.信诚金融A份额、信诚金融B份额买入申报数量为100的整数倍； 5.信诚金融A份额、信诚金融B份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币； 6.信诚金融A份额、信诚金融B份额上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。 （六）上市交易的费用 信诚金融A份额、信诚金融B份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。 （七）上市交易的行情揭示 信诚金融A份额、信诚金融B份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。 （八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同应予以修改，并按照新规定执行。 （九）若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司调整了基金上市交易的新动能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应动能。

（五）调整基金份额的申购赎回规则

对本基金的申购赎回规则进行调整：原信诚中证500A份额、信诚中证500B份额只上市交易、不接受申购与赎回；转换后的中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）A类基金份额可通过销售机构进行日常申购与赎回。

（六）修改基金的投资目标、投资范围及投资策略等投资相关条款

转型后的“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”为指数增强型基金，对《基金合同》中投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准等内容进行了修改。

变更注册前	变更注册后
	（一）投资目标 本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证500指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力求控制基金净值相长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。 （二）投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等），债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）以及法律法律规定或证监会允许投资的其他债券品种）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金以上规模有关法律法规规定进行融资等融通证券出借业务交易。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的80%-95%；权证以外的其他资产的比例不低于基金资产的5%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。前述5%的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构规定执行。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。 （三）投资策略 本基金为股票指数增强型基金，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，综合运用量化投资模型积多种指数增强技术，力争获得超越标的指数的投资收益。 1.资产配置策略 在资产配置上，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中证500指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的90%。同时，基于流动性管理及规避性投资风险的需要，本基金也会在控制风险的前提下适当投资于债券、金融衍生品、货币市场工具及其他金融工具。 2.股票投资策略 （1）指数化投资策略 本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。 ①定期调整 本基金根据标的指数成份股及其权重的定期调整，在考虑跟踪误差风险的基础上，对投资组合进行相应调整。 ②不定期调整 当成份股调整、送配等投权变动而影响成分股在标的指数中权重的，基金将采用合理方法进行适当替代并对投资组合进行相应调整。 本基金根据市场流动性、证券投权变动而影响成分股在标的指数中权重的，基金管理人在履行相应调整程序后，在合理时间内调整本基金的投资组合。 （2）指数增强策略 本基金将运用量化投资模型，对投资组合进行调整，以实现对标的指数的有效跟踪。 在其他影响本基金跟踪标的指数的情况下，本基金管理人将根据市场情况，在控制跟踪误差的前提下，对投资组合进行合理调整。 （3）指数增强策略 本基金指数增强策略以量化多因子模型为基础，主要通过多种模型对股票进行综合评价和筛选，结合风险控制模型和组合优化构建投资组合，以追求超越标的指数的业绩表现。 1）多因子模型：本基金结合中国股票市场的宏观环境、行业及个股特性，寻找适合国内市场的长期有效的因子。综合评估各类因子在市场中的有效性状况，中证系列指数中中证指数和其编制成因子组合及权重，构建多因子选股模型，对股票进行综合评价和筛选。 多因子模型的因子来源主要包括价值、成长、质量、动量、波动率、流动性等类别，基本面因子、技术面因子、市场情绪因子等。 2）风险控制与组合优化：在追求超额收益的同时，本基金将对投资组合相对标的指数的风险暴露进行分析和控制，在考虑预期收益和风险的基础上，本基金将结合交易成本、投资比例限制等影响因素，优化投资组合。 3）其他辅助策略 本基金将根据市场状况、结合指数成分股调整等事件进行指数增强。当预期成分股发生调整或送配等事件时，分析调入调出个股的市场表现，选择调整时机，以期获得超额收益。 3.债券投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在产品特性控制目标入场风险收益特征的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购收益策略等进行主动投资。 4.可转换债券投资策略 本基金将选择投资价值较好、公司基本面良好的可转债，适度参与股权市先先配售或一般市场申购，获取一级市场新股；在持有期内，根据市场进行持有或卖出的投资操作；同时，对于可转债的二级市场投资，本基金将综合运用多种可转债投资策略，选择信用风险分析、安全边际测算、成长潜力分析、期权价值分析等方法进行基本面较好、估值合理的可转债进行投资。 5.资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的特成及流动性、提前偿还率等多种因素的影响。本基金将在基本面分析和债券市场变化等多种因素的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、提前偿还率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。 6.股指期货投资策略 基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，实现多头或空头的套期保值操作，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的风险管理。 7.国债期货投资策略 本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合宏观经济形势和政策趋势的判断，对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现套利资产的长期稳定增值。 8.股票期权投资策略 本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易成本较低的期权品种，以期达到较为稳健的投资回报。 基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择价值合理的股票期权合约。 9.其他衍生品投资策略 如果证券市场出现值得关注的新品种，基金管理人将根据风险管理的原则，在有效控制风险的前提下，经过内部决策程序后，可以做出相应调整。

（七）变更基金的收益与分配

本基金转型前不进行收益分配，转型后的“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”将新增基金收益分配原则，收益分配方案等相关内容。

变更注册前	变更注册后
	（一）基金利润的构成 基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益扣其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。 （二）基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。 （三）基金收益分配原则 1.《基金合同》生效不满3个月不进行收益分配； 2.本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统的基金份额，默认采用现金红利，登记在证券登记系统的基金份额默认采用红利再投资，投资者不选择的视为采用现金红利，登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式与现金分红； 3.同一类别每一基金份额享有同等分配权； 4.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在不违反法律法规及基金合同的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致可调整上述基金收益分配原则，无需召开基金份额持有人大会。 （四）收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 （五）收益分配方案的确定、公告与实施 基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后，报中国证监会备案。 基金收益分配方案经基金份额持有人大会表决通过后，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的基金份额持有人参加基金份额持有人大会。 （二）转型方案被持有人大会否决的风险 为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。 如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，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，将信诚金融A份额与信诚金融B份额按照基金份额净值转换为信诚中证500分额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。 敬请投资者合理安排投资计划。 八、基金管理人联系方式 基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系 基金管理人：中信保诚基金管理有限公司 客服电话：400-666-0066 公司网站：www.citicprufunds.com.cn 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。基金的过往业绩并不代表其将来表现，基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。 原基金为股票型基金，预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，从分析的两类基金份额来看，信诚中证500A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；信诚中证500B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。 转型后的中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF），为股票型证券投资基金，其预期风险、预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，转型后的中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）预期风险高于信诚中证500指数分级证券投资基金的信诚中证500A份额。 投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。 中信保诚基金管理有限公司 2020年9月25日

中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

中信保诚基金管理有限公司已于2020年9月23日在《中国证券报》、中信保诚基金管理有限公司网站（www.citicprufunds.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund/）发布了《关于以通讯方式召开信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于2020年9月24日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2013]1088号文核准的信诚中证800金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于2013年12月20日生效。

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，本基金实施转型；包括终止信诚中证800金融指数分级证券投资基金的信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的证券交易，由分级基金转为非分级的上市基金，调整基金投资目标、投资范围、投资策略和限制，申请调整业绩比较基准，基金费用、收益分配方式、名称方式以及依据相关法律法规规定的其他事项，并提交为“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”。转型方案说明见附件四《信诚中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

同时，为实施本基金转型方案，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时的有效的法律法规，对《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上提案，请予审议。

中信保诚基金管理有限公司
2020年9月23日

附件一：

关于信诚中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案

信诚中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人：

综合市场需求分析，为更好地满足投资者需求，维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》有关约定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，对本基金实施转型；包括终止信诚中证500指数分级证券投资基金的信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的证券交易，由分级基金转为非分级的上市基金，调整基金投资目标、投资范围、投资策略和限制，申请调整业绩比较基准，基金费用、收益分配方式、名称方式以及依据相关法律法规规定的其他事项，并提交为“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”。转型方案说明见附件四《信诚中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

同时，为实施本基金转型方案，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时的有效的法律法规，对《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上提案，请予审议。

中信保诚基金管理有限公司
2020年9月23日

附件二：

授权委托书

本人（或本机构）特此授权代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年10月23日的以通讯方式召开的信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以委托人（代理人）的表决意见为准。本人（或本机构）同意代理人转授权，转授权权限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）证件号码（填写）：

签署日期：　　年　月　日

授权委托书填写注意事项：

1.本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》及本公告要求的授权委托书。

2.基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3.以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4.本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金的证件号码或该证件号码的更新。

5.如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件三：

信诚中证800金融指数分级证券投资基
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
审议事项		同意	反对　弃权
关于信诚中证800金融指数分级证券投资基金转型有关事项的议案			
基金份额持有人（或受托人、代理人）签名或盖章			
			年　月　日

说明：

请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票（但其他各项符合会议通知规定的）均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。

附件四：

信诚中证800金融指数分级证券投资基金转型方案说明书

一、声明

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，拟对信诚中证800金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）实施转型。

本次信诚中证800金融指数分级证券投资基金转型议案应当经参加大会的信诚金融份额、信诚金融A份额与信诚金融B份额的基金份额持有人或其代理人在各自基金份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方有效，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

本次基金转型不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人与登记机构已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备等方面进行了深入研究，已经做好了基金转型的相关准备。会计师事务所将继续为转型后的基金提供服务，律师事务所将出具法律意见书，报中国证监会备案并公告。

七、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额持有人所代表的各类基金份额占权益登记日各自份额类别基金总份额的50%以上（含50%）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的基金份额持有人参加基金份额持有人大会。

（二）转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，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，将信诚金融A份额与信诚金融B份额按照基金份额净值转换为信诚中证800分额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。

敬请投资者合理安排投资计划。

八、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400-666-0066

公司网站：www.citicprufunds.com.cn

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。基金的过往业绩并不代表其将来表现，基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

原基金为股票型基金，预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，从分析的两类基金份额来看，信诚金融A份额具有预期风险、预期收益较低的特征；信诚金融B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

经基金份额转换后，中信保诚中证800金融指数型证券投资基金（LOF）的基金份额的场外份额数采用截位法保留小数点后两位，余位部分计入基金财产。

关于原信诚金融份额与信诚金融B份额转换为信诚金融分额的场内份额后的持有期不连续计算，自转换为信诚金融分额的份额当日起重新计算其持有期。

关于原信诚金融份额的场内份额转换后的持有期限根据中国证券登记结算有限责任公司的相关规则执行。

六、合规、运营可行性

（一）法律方面

转型后的中信保诚中证800金融指数型证券投资基金（LOF）和法律文件经中国证监会变更注册后，基金管理人择时召集基金份额持有人大会，依据《基金合同》和《基金法》的规定，本次信诚中证800金融指数分级证券投资基金份额持有人大会，在有代表基金份额转换成基金份额份额的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。因此，信诚中证800金融指数分级证券投资基金的转型不存在法律障碍。

（二）技术运行方面

本次基金转型不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人与登记机构已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备等方面进行了深入研究，已经做好了基金转型的相关准备。会计师事务所将继续为转型后的基金提供服务，律师事务所将出具法律意见书，报中国证监会备案并公告。

七、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额持有人所代表的各类基金份额占权益登记日各自份额类别基金总份额的50%以上（含50%）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的基金份额持有人参加基金份额持有人大会。

（二）转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险