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，会议投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28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，会议投票表决起止时间为自2020年9月24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：

一、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金融份额。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28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第一次提示性公告

中信保诚基金管理有限公司已于2020年9月25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500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了便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一次提示性公告。

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[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基金合同》（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基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《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》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2020年9月26日起，至2020年10月26日17:00止（纸质表决以表决票收件人收到表决票时间为准；短信表决以基金管理人指定系统记录时间为准）。

3、通讯纸质表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：中信保诚基金管理有限公司客户服务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

邮政编码：200120

联系电话：400-666-0066

请在信封表面注明：“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专用”

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《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》（以下简称“《议案》”），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年10月16日，即在2020年10月16日交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

（一）纸质表决方式

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（http://www.citicprufunds.com.cn/）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（包括基金管理人认可的业务专用章，下同），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

（4）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票；

（5）以上各项中的公章、批文、业务专用章、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内（以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层），并请在信封表面注明：“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专用”。

（二）短信表决方式（仅限个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次大会投票，自2020年9月26日0:00起，至2020年10月26日17:00止（以基金管理人指定短信平台收到表决时间为准），基金管理人提供短信通道供个人投资者参与本次大会投票。

（1）短信表决意见内容为“#个人客户姓名#证件号码#信诚中证500#表决意见”（双引号不用输入，#号需输入），表决意见为“同意”、“反对”、“弃权”中的一项，有且只有一种表决意见。请个人投资者务必按照上述格式要求回复短信。

（2）基金份额持有人通过短信表决方式投票，需使用预留手机号码发送短信表决意见内容。若基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。

（3）个人持有人可将上述短信表决意见内容发送至基金管理人指定短信平台号码（10691159555806）。基金管理人也可发送征集投票的提示短信给在基金管理人处预留手机号码的基金份额持有人，以便于基金份额持有人使用短信通道参与表决。

（4）如因短信通道通讯故障等不可抗力或非基金管理人原因导致上述投票短信无法及时送达基金份额持有人或本基金管理人无法及时收到投票的，基金管理人不承担短信投票失效的责任，基金份额持有人在截止日前可以选择其他投票方式进行投票。

（5）通过短信进行表决的方式仅适用于本基金的个人投资者，对机构投资者暂不开通。

五、授权（仅限纸面授权方式）

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购、买入本基金的同时也可以签署授权委托书，待份额确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以本基金登记机构的登记为准。

2、受托人（代理人）

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、授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（http://www.citicprufunds.com.cn/）等方式获取授权委托书样本。

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

③合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

④以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

（2）对基金管理人的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的，可通过邮寄授权文件或和所需的相关文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件专人送交基金管理人办公地点。

4、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；

（2）如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权；

（3）基金份额持有人以非纸面方式进行授权的，为无效授权；

（4）如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权；

（5）如委托人既进行了委托授权，自身又通过其它有效投票方式（含纸质表决方式及短信表决方式）参与表决的，则以委托人自身有效投票方式为准。最终表决意见的认定按本公告“六、计票”的相关原则处理。

5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2020年10月23日16:30时。将纸面授权委托书和所需的相关文件寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后第2个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、纸面表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收件人收到时间为准。2020年10月26日17:00以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）纸面表决票的效力认定

①纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如纸面表决票上的表决意见未选、多选、表决意见空白、表决意见模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

③如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i.送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ii.送达时间为同一天的，如果能判断收到时间先后的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；若无法判断收到时间先后的，则视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

iii.送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

4、短信表决效力确定规则

基金份额持有人通过短信表决方式投票，未使用预留手机号码回复的，视为无效表决，无效表决不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。使用预留手机号码回复的，需在表决短信里提供正确的身份证件号码、个人客户姓名及基金简称并明确选择“同意”、“反对”或“弃权”的一种。表决短信里仅提供了正确的其他信息，但表决意见未选、多选或选择形式不符合要求的视为弃权。表决短信里未提供身份证件号码、个人客户姓名、基金简称的，或提供的以上信息有误，或有其他不符合要求的情况，为无效表决，无效表决不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

基金份额持有人通过基金管理人的短信表决通道重复提交短信表决票的，以基金管理人在截止时间之前最后一次收到的基金份额持有人所发送成功的表决短信为准，先送达的表决短信视为被撤回。

5、基金份额持有人以多种表决方式进行表决的，按如下原则处理：

（1）如同时存在有效纸质、非纸质（短信表决方式）表决意见的，不论表决时间先后，均以有效的纸质表决意见为准。

（2）如同时存在多份纸质表决意见的，效力认定规则见本公告“六、计票”下第3点。

七、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见和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%)；

2、《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）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

八、本次大会相关机构

1、召集人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400-666-0066

联系人：王文博

联系电话：400-666-0066 转9

电子邮件：ds@citicprufunds.com.cn

传真：(021) 5012 0886

网址：http://www.citicprufunds.com.cn

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市凤阳路660号

联系电话：（021）62154848,62178903（直线）

联系人：林奇

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

注册及办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：（021）31358666

九、重要提示

1、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。

2、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、为了便本次基金份额持有人大会顺利召开，本基金将在本次基金份额持有人大会计票日自开市起开始停牌，直至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30复牌。

4、基金管理人将在发布《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》后2个工作日内连续公布相关提示性公告，就本次会议相关情况做必要说明，请予以留意。

5、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中信保诚基金管理有限公司网站及中国证监会基金电子信息披露平台查阅，投资者如有任何疑问，可致电400 6660066咨询。

6、本次告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

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》

附件二：授权委托书（样本）

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

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

中信保诚基金管理有限公司
2020年9月28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份额的运作，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、申购赎回安排、基金费用、收益分配方式、估值方法以及依据相关法律法规更新修订基金合同等，并更名为“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。表决意见以受托人（代理人）的表决意见为准。本人（或本机构）同意代理人转授权，转授权仅限一次。

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时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（或委托人、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）通过方为有效，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依法报中国证监会备案。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）不再设置基金份额的分级、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，因而不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制，删去相关内容，包括基金份额分级、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的上市交易、基金的份额配对转换、基金份额的折算、信诚中证500A份额与信诚中证500B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原信诚中证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A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500 B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500 A份额与信诚中证500 B份额拟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个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。 （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前至少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.信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额分别采用不同的交易代码上市交易； 2.信诚中证500 A份额、信诚中证500 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.信诚中证500 A份额、信诚中证500 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. 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额买入申报数量为100份或其整数倍； 5.信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币； 6.信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《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 信诚中证500 A份额、信诚中证500 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 信诚中证500 A份额、信诚中证500 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前一交易日A类基金份额的基金份额净值。 （八）上市交易的注册登记 投资人T日买入成功后，注册登记机构在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金。 投资人T日卖出成功后，注册登记机构在T日自动为投资人办理赎回登记的注册登记手续。 （九）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 信诚中证500 A份额、信诚中证500 B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》和深圳证券交易所的相关业务规则执行。 （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，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。 （十一）若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。	（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，基金管理人可以申请本基金A类基金份额上市交易。 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，基金管理人应依据法律法规规定在指定报刊上刊登A类基金份额上市交易公告书，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。 本基金的A类基金份额上市后，登记在证券登记系统中的A类基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的A类基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记系统后，方可上市交易。 （四）上市交易的规则 本基金A类基金份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定。 （五）上市交易的费用 本基金A类基金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。 （六）上市交易的行情揭示 本基金A类基金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前一交易日A类基金份额的基金份额净值。 （七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 本基金A类基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、深圳证券交易所证券交易所的相关业务规则执行。 当本基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转换为非上市的开放式基金，基金名称变更为“中信保诚中证500指数增强型证券投资基金”，除此之外，本基金的基金管理、基金的投资范围和投资策略等均不变，届时无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。 （八）相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司对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，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。 （九）若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

（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，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，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）以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券或票据）、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）。 本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转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比例不低于80%，投资标的指数成分股及其备选成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中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的规定执行。 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和多种指数增强技术，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80%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、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 当成份股因增发、送配等股权变动而影响成份股在标的指数中权重时，基金将根据指数公司公告及调整权重比例，对投资组合进行相应调整； 当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司公告及调整权重比例，对投资组合进行相应调整； 因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或基金各项投资禁止行为及持股比例限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，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。 本基金根据申购赎回情况，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，本基金管理人可根据市场情况，在控制跟踪误差的前提下，对投资组合进行合理调整。 （2）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，主要通过多因子模型对股票进行评分和预期收益率预测，并结合风险控制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。 a.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国内股票市场的长期表现，根据因子类型和效果确定因子组合及权重，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、流动性、波动率、预期等类型。基金管理人将进行持续跟踪研究，定期或不定期地对模型涉及的因子与策略进行校验和调整，以反映市场趋势的变化。基金管理人将根据市场环境的变化以及对市场和因子的理解，综合因子的实际表现及影响因子收益的市场因素进行一定前瞻性判断，适时调整各因子类别的具体组合及权重。 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，力求将跟踪误差控制在目标范围内。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）其他辅助增强策略 本基金将根据市场投资机会，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成成分股调整期间，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，本基金将严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，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、回购放大策略等策略进行主动投资。 4.可转换债券投资策略 本基金将选择发行条款较好、公司基本面良好的可转债，适度参与原股东优先配售或一级市场申购，上市后根据个券的具体情况进行持有或变出应的投资操作；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，选择信用风险可控、安全边际较高、或对应的标的股票公司成行业基本面较好、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、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响，本基金将在基本面分析和债券市场资深研分析的基础上，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