

B01信息披露Disclosure

中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证500指数分级证券投资基金之信诚中证500A份额和信诚中证500B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《信诚中证500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》，信诚中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，信诚中证500份额的简称：信诚500，基金代码：165611）之信诚中证500A份额（场内简称：信诚500 A，基金代码：150029）和信诚中证500B份额（场内简称：信诚500 B，基金代码：150029）的终止上市日为2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日），基金份额折算基准日为2020年12月31日，以基金份额折算基准日终信诚中证500份额的基金份额净值为基准，信诚中证500A份额、信诚中证500B份额按照各自的基金份额净值折算成场内信诚中证500份额。

针对本基金之信诚中证500A份额和信诚中证500B份额终止运作、终止上市的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、基金份额折算基准日前（含基金份额折算基准日），信诚中证500A份额和信诚中证500B份额仍可正常交易，期间敬请投资者高度关注以下风险：

（1）由于信诚中证500A份额和信诚中证500B份额可能存在折溢价交易情形，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本公告第四条）。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。

投资者应密切关注信诚中证500A份额和信诚中证500B份额的基金份额净值变化情况（可通过本公司网站查询）。

（2）信诚中证500A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，信诚中证500A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中证500份额，由于信诚中证500份额为跟踪中证500指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原信诚中证500A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

信诚中证500B份额具有一定的杠杆属性，具有较高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，信诚中证500B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中证500份额，由于信诚中证500份额为跟踪中证500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，但原信诚中证500B份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、信诚中证500A份额和信诚中证500B份额折算为信诚中证500份额前，信诚中证500A份额和信诚中证500B份额的持有人有两种方式退出：

（1）在场内买入符合本基金基金份额配比的对应份额，合并为信诚中证500份额，按照信诚中证500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、由于信诚中证500A份额和信诚中证500B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重大下降，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、在份额折算基准日终，以信诚中证500份额的基金份额净值为基准，信诚中证500A份额、信诚中证500B份额按照各自的基金份额净值（而不是二级市场价格）折算成场内信诚中证500份额。信诚中证500A份额和信诚中证500B份额的基金份额持有人持有的折算场内信诚中证500份额的数量（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。

信诚中证500A份额和信诚中证500B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，例如如下：

假设份额折算基准日信诚中证500份额、信诚中证500 A份额和信诚中证500B份额的基金份额净值分别为：0.900元、1.030元、0.980元，投资者甲、乙、丙分别持有场内信诚中证500份额、信诚中证500A份额、信诚中证500B份额各100,000份，其所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前			折算后	
基金份额净值(元)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额	
场内 信诚中证500份	1,000	100,000	(无变化)	1,000	100,000 场内 信诚中证500 份
信诚 中证500A 份额	1,030	100,000	1.0300000000 (全部折算为信诚中证500份额)	1,000	103,000 场内 信诚中证500 份
信诚 中证500B 份额	0,980	100,000	0.9800000000 (全部折算为信诚中证500份额)	1,000	98,000 场内 信诚中证500 份

5、信诚中证500A份额和信诚中证500B份额折算为信诚中证500份额后，信诚中证500份额只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或赎回。部分投资者可能由于不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，信诚中证500A份额和信诚中证500B份额合并或折算为信诚中证500份额后，基金份额持有人自信诚中证500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，本基金的回赎费率如下：

定，本基金的回赎费率如下：

（1）场内赎回费率

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日≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥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）

场内中转托管至场外后的信诚中证500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。

本公司承诺诚信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和基金安全，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法规文件。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2020年12月28日

中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证800金融指数分级证券投资基金之信诚金融A份额和信诚金融B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《信诚中证800金融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》，信诚中证800金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，信诚金融A份额的简称：信诚金融A，基金代码：165621）之信诚金融A份额（场内简称：金融A，基金代码：150157）和信诚金融B份额（场内简称：金融B，基金代码：150158）的终止上市日为2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日），基金份额折算基准日为2020年12月31日，以基金份额折算基准日终信诚中证800金融指数的基金份额净值为基准，信诚金融A份额、信诚金融B份额按照各自的基金份额净值折算成场内信诚金融份额。

针对本基金之信诚金融A份额和信诚金融B份额终止运作、终止上市的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、基金份额折算基准日前（含基金份额折算基准日），信诚金融A份额和信诚金融B份额仍可正常交易，期间敬请投资者高度关注以下风险：

（1）由于信诚金融A份额和信诚金融B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生重大变化，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本公告第四条）。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。

投资者应密切关注信诚金融A份额和信诚金融B份额的基金份额净值变化情况（可通过本公司网站查询）。

（2）信诚金融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，信诚金融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金融份额，由于信诚金融A份额为跟踪中证800金融指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原信诚金融A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

信诚金融B份额具有一定的杠杆属性，具有较高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，信诚金融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金融份额，由于信诚金融B份额为跟踪中证800金融指数的基础份额，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，但原信诚金融B份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

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

（1）在场内买入等量的对应份额（即信诚金融A份额持有人买入等量的信诚金融B份额，或者信诚金融B份额持有人买入等量的信诚金融A份额），合并为信诚金融份额，按照信诚金融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、由于信诚金融A份额和信诚金融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重大下降，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、在份额折算基准日终，以信诚金融份额的基金份额净值为基准，信诚金融A份额、信诚金融B份额按照各自的基金份额净值（而不是二级市场价格）折算成场内信诚金融份额。信诚金融A份额和信诚金融B份额的基金份额持有人持有的折算后场内信诚金融份额的数量（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。

信诚金融A份额和信诚金融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，例如如下：

假设份额折算基准日信诚金融份额、信诚金融A份额和信诚金融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金融份额、信诚金融A份额、信诚金融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			折算后	
基金份额净值(元)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额	
场内 信诚金融B份额	0,900	100,000	(无变化)	0,900	100,000 场内 信诚金融B份额
信诚金融A份额	1,010	100,000	1.122222222 (全部折算为信诚金融份额)	0,900	112,222 场内 信诚金融B份额
信诚金融B份额	0,790	100,000	0.877777778 (全部折算为信诚金融份额)	0,900	87,777 场内 信诚金融B份额

5、信诚金融A份额和信诚金融B份额折算为信诚金融份额后，信诚金融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不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，信诚金融A份额和信诚金融B份额合并或折算为信诚金融份额后，基金份额持有人自信诚金融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，本基金的回赎费率如下：

（1）场内赎回费率

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日≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥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）

场内中转托管至场外后的信诚金融份额，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。

本公司承诺诚信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和基金安全，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法规文件。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2020年12月28日

中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证800医药指数分级证券投资基金之信诚医药A份额和信诚医药B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《信诚中证800医药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》，信诚中证800医药指数分级证券投资基金（以下简称“本基金