



劳动最光荣

劳动最崇高

劳动最伟大

劳动最美丽



## 关于调整中证500B(证券代码:150029)折算基准日证券简称的公告

2015年9月14日,信诚中证500指数分级证券投资基金B类份额(证券简称:中证500B,证券代码:150029)的基金份额净值为0.240元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件,根据基金合同的约定,将以2015年9月15日作为基金份额折算基准日办理不定期份额折算业务。

为加强折算基准日交易风险提示,根据交易所规则,经向深圳证券交易所申请,2015年9月15日信诚中证500指数分级证券投资基金B类份额证券简称前冠以“\*”标识,证券简称由“中证500B”暂时调整为“\*证500B”,证券编码保持不变。2015年9月16日起证券简称将恢复正常。

基金管理人提醒投资者警惕基金风险,切勿盲目投资。

信诚基金管理有限公司  
2015年9月15日

## 信诚沪深300指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》关于不定期份额折算的相关规定,当信诚沪深300指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,本基金将在基金份额折算日分别对信诚沪深300指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:信诚300,基础份额,代码:165515)、信诚沪深300指数分级证券投资基金A份额(场内简称:沪深300A,代码:150051)、信诚沪深300指数分级证券投资基金B份额(场内简称:沪深300B,代码:150052)进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2015年9月14日,沪深300B的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阀值0.250元,在此提请投资者密切关注沪深300B份额近期净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对可能发生的不定期份额折算,基金管理人特别提示如下:

一、由于沪深300A份额、沪深300B份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。特提醒参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

二、沪深300B份额具有预期风险、预期收益较低的特征。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低,将恢复到初始杠杆水平。相应地,沪深300B份额的参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、沪深300A份额具有预期风险、预期收益较高的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时,原沪深300A持有人的收益风险特征将发生一定变化,由持有单一的较低风险收益特征的沪深300A变为同时持有沪深300A与信诚300份额,因此原沪深300A持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外,信诚300为跟踪指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原沪深300A持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

四、由于触发折算阀值当日,沪深300B净值可能已低于阀值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,因此折算基准日沪深300B净值可能与折算阀值0.250元有一定差异。

五、基金管理人的其他重要提示:

根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量信诚300份额、沪深300A份额、沪深300B份额的持有人在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金份额的风险。

若本基金发生上述不定期份额折算情形,为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停沪深300A份额与沪深300B份额的上市交易和信诚300份额的申购赎回等业务。届时基金管理人将针对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》及《信诚沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》。投资者可致电本公司客户服务电话400-666-0066,或登录本公司网站www.xcfunds.com了解或咨询详情。

信诚基金管理有限公司  
2015年9月15日

## 信诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持有停牌股票估值方法的提示性公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》

(【2008】38号文),并参照《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》(以下简称“《参考方法》”),信诚基金管理有限公司(以下简称“本公司”)自2008年9月起,采用中国证券业协会基金估值工作小组提供的关于停牌股票估值的参考方法,对所管理的基金持有的长期停牌股票的公允价值进行估值。

经与托管人协商一致,自2015年9月14日起,本公司对旗下证券投资基金持有的停牌股票“长园集团(证券代码:600525)”采用“指数收益法”进行估值。

待上述股票交易体现了活跃市场交易特征后,将恢复采用当日收盘价格进行估值,届时不再另行公告。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆基金管理人网站([www.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com))或拨打客户服务电话400-666-0066咨询有关信息。

特此公告。

信诚基金管理有限公司  
2015年9月15日

## 信诚添金分级债券型证券投资基金之季季添金份额折算和申购与赎回结果的公告

信诚基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)于2015年9月9日在指定媒体及本公司网站([www.xcfunds.com](http://www.xcfunds.com))发布了《信诚添金分级债券型证券投资基金之季季添金份额开放申购、赎回及转换业务的公告》(简称“《开放公告》”)和《信诚添金分级债券型证券投资基金之季季添金份额折算方案的公告》(简称“《折算公告》”)。2015年9月11日为信诚添金分级债券型证券投资基金之季季添金份额(以下简称“季季添金”的第三个运作周期第三个基金份额折算基准日及开放申购与赎回日,现将相关事项公告如下:

一、本次季季添金的基金份额折算结果

根据《折算公告》的规定,2015年9月11日,折算后,季季添金的基金份额净值调整为1.000元,季季添金的折算比例为1.010595890,折算后,季季添金的基金份额总额为319,529,999.76份,折算后,季季添金的基金份额总额为322,915,704.99份。各基金份额持有人持有的季季添金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。

投资者自2015年9月11日起(含该日)可在销售机构查询其原持有的季季添金份额的折算结果。

二、本次季季添金开放申购与赎回的确认结果(以下所涉及申购与赎回内容皆涵盖基金份额的转换转入与转换转出。)

根据《开放公告》的规定,所有经确认有效的季季添金的赎回申请全部予以成交确认,据以确认的季季添金赎回份额为13,015,245.92份。

岁岁添金的份额数为164,146,210.56份。根据《基金合同》的规定,季季添金的份额余额原则上不得超过7/3倍岁岁添金的份额余额(即383,007,824.64份,下同)。

此次2015年9月11日为季季添金的第三个运作周期第三个开放日,根据《基金合同》的规定:在任一运作周年的第三个季季添金的开放日提出的对于季季添金的申购申请,如果对季季添金的有效申购与赎回申请进行确认后,季季添金的份额余额小于或等于岁岁添金份额余额的7/3倍,则经确认有效的季季添金的份额申请全部予以成交确认;如果对季季添金的有效申购与赎回申请进行确认后,季季添金的份额余额大于岁岁添金份额余额的7/3倍,则在经确认后的季季添金的份额余额不超过岁岁添金份额余额的7/3倍的范围内,对有效的申购及赎回等相关业务。届时基金管理人将针对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

经本公司统计,2015年9月11日,季季添金的有效申购申请总额为5,663,719.17元,有效赎回申请总额为13,015,245.92份。本次季季添金的全部有效申购申请经确认后,季季添金的份额余额小于7/3倍岁岁添金的份额余额,为此,基金管理人对全部有效申购申请予以成交确认。

本基金基金管理人已于2015年9月14日根据上述原则对本次季季添金的全部申购与赎回申请进行了确认,并为投资者办理了有关份额权益的注册登记变更手续。投资者可于2015年9月15日起到各销售网点查询申购与赎回的确认情况。投资者赎回申请成功后,基金管理人将自2015年9月14日起7个工作日内通过相关销售机构将赎回款项划至基金份额持有人账户。

本次季季添金实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后,信诚添金分级债券型证券投资基金的总份额为479,710,388.30份,其中,季季添金总份额为315,564,177.4份,岁岁添金的基金份额未发生变化,仍为164,146,210.56份,季季添金与岁岁添金的份额配比为5.767373672.3。

风险提示:

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金基金管理人提醒投资者知晓基金的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

信诚基金管理有限公司  
2015年9月15日

信诚基金管理有限公司

2015年9月15日

## 信诚中证500指数分级证券投资基金管理有限公司 办理不定期份额折算业务的公告

根据《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》(简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当信诚中证500指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之中证500B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,本基金将进行不定期份额折算。

截至2015年9月14日,本基金中证500B份额的基金份额净值为0.240元,达到基金合同规定的不定期份额折算阀值0.250元。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金将以2015年9月15日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下:

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2015年9月15日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的信诚500份额(场内简称:信诚500,基础份额,代码:165511)、信诚中证500指数分级证券投资基金A份额(场内简称:中证500A,代码:150028)和信诚中证500指数分级证券投资基金B份额(场内简称:中证500B,代码:150029)。

三、基金份额折算方式

信诚500份额、中证500A份额、中证500B份额按照《基金合同》“第二十一部分,基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期份额折算条件时,本基金将在基金份额折算日分别对信诚500份额、中证500A份额和中证500B份额进行份额折算,份额折算后中证500A份额和中证500B份额的比例仍保持4:6不变。份额折算后信诚500份额、中证500A份额和中证500B份额的基金份额净值均调整为1.000元,信诚500份额、中证500A份额和中证500B份额的份额数将得到相应的缩减。具体折算原则及公式如下:

当中证500B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,信诚500份额、中证500A份额、中证500B份额将按照如下公式进行份额折算:

1)信诚500份额折算

NUM后 500 = (NUM前 500 × NAV前 500) / 1.000

信诚500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财产;信诚500份额的场内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一位,余额计入基金财产。

2)中证500A份额折算

折算后中证500A份额和中证500B份额的份额配比保持4:6不变,即:

NUM后 500 = (NUM前 500 × NAV前 500) / 1.000

中证500A份额持有人新增的信诚500份额数 = (NUM前 500 × NAV前 500) / 1.000

中证500A份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。中证500A份额折算后信诚500份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

3)中证500B份额折算

NUM后 B = (NUM前 B × NAV前 B) / 1.000

中证500B份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

4)折算后信诚500份额的总份额数

折算后信诚500份额的总份额数 = 不定期份额折算后信诚500份额的份额数 + 中证500B份额持有人新增的信诚500份额数

(5)举例

假设:某投资人持有场内信诚500份额、中证500A份额、中证500B份额分别为10,000份,10,000份,15,000份。在本基金的不定期份额折算基准日,假设三类份额的基金份额净值分别如下表所示(为便于投资者理解,此处采用假设的份额净值进行计算,基准日折算后准确的份额净值以当日终基金管理人计算并经托管人复核的份额净值为准),份额折算后,信诚500份额、中证500A份额、中证500B份额的基金份额净值均调整为1.000元。

	折算前	折算后
基金份额	基金份额净值(假设值)	基金份额净值
信诚500份额	0.240元	1.000元
中证500A份额	1.010595890	1.000元
中证500B份额	0.236079465	1.000元

5.48份中证500B份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一)不定期份额折算基准日(即2015年9月15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;中证500A和中证

500B将于2015年9月15日上午9:30-10:30停牌一小时,并于2015年9月15日

上午10:30复牌。当日晚间,基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

(二)不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2015年9月16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,中

证500A、中证500B暂停交易。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)不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2015年9月17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。

当日下午9:30-10:30停牌一小时,并于2015年9月17日上午9:30-10:30停牌一小时,并于2015年9月17日上午10:30复牌。

(四)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》,

2015年9月17日中证500A、中证500B即时行情显示的前收盘价为2015年9月

16日的中证500A、中证500B的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元),2015