

关于信诚沪深300指数分级证券投资基金之信诚沪深300A份额和信诚沪深300B份额基金份额折算结果的公告

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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，信诚沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案，并于2020年12月2日发布《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》、2020年12月29日发布《关于信诚沪深300指数分级证券投资基金之信诚沪深300A份额和信诚沪深300B份额基金份额折算的公告》。

根据上述公告，基金管理人以2020年12月31日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的信诚沪深300A份额（场内简称：沪深300A，基金代码：150051）和信诚沪深300B份额（场内简称：沪深300B，基金代码：150052）办理向场内信诚沪深300份额（场内简称：信诚300，基金代码：165515）折算业务，现将折算结果公告如下：

一、份额折算结果

1. 信诚沪深300A份额、信诚沪深300B份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。份额折算比例按截位法精确到小数点后第9位，具体结果如下表所示：

折算前基金份额名称	折算前份额数量（份）	折算比例	折算后基金份额名称	折算后份额数量（份）
信诚沪深300A份额	63,726,655.00	0.823030567	场内信诚沪深300份额	52,448,984.00
信诚沪深300B份额	63,726,655.00	1.176969433		75,004,325.00

2. 折算完成后信诚沪深300份额数量如下：

折算前基金份额名称	折算前份额数量（份）	折算后基金份额名称	折算后份额数量（份）
场内信诚沪深300份额	39,867,934.00	场内信诚沪深300份额	（注1） 167,321,243.00
场外信诚沪深300份额	78,894,804.76	场外信诚沪深300份额	78,894,804.76

注1：该“折算后份额”为信诚沪深300A份额、信诚沪深300B份额经折算后产生的新增场内信诚沪深300份额与折算前场内信诚沪深300份额的合计数。

二、恢复交易与其他重要提示

1. 在基金份额折算过程中，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，持有极小数量信诚沪深300A份额、信诚沪深300B份额，存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

2. 《中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）基金合同》已于2021年1月1日生效，《信诚沪深300指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

信诚沪深300指数分级证券投资基金的基金名称已于2021年1月1日起变更为“中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）”，场外简称由“信诚沪深300指数分级”变更为“中信保诚沪深300”；场内简称不变，仍为“信诚300”；基金代码不变，仍为165515。

中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

3. 《中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，在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，基金管理人可根据有关规定，申请中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）的基金份额上市交易。

在中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）上市交易前，中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）的场内份额持有人只能通过赎回基金份额的方式退出投资；中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）场内份额上市交易后，基金份额持有人可通过赎回或卖出的方式退出投资。

4. 基金管理人自2021年1月5日起，恢复办理中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）的申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管等业务。原信诚沪深300指数分级证券投资基金参与的各项费率优惠等销售活动，中信保诚沪深300指数型证券投资基金（LOF）将继续适用。

5. 投资者可登录基金管理人网站www.citicprufunds.com.cn或者拨打客户服务电话400-666-0066咨询相关信息。

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。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2021年1月5日