

方正富邦基金管理有限公司

关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金办理不定期 份额折算业务的公告

根据《方正富邦中证保险指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）“第二十一部分 基金份额折算”的相关规定，当方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额（方正富邦中证保险份额）的基金份额净值高至 1.500 元或以上时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 8 月 17 日，方正富邦中证保险份额的基金份额净值为 1.529 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 2020 年 8 月 18 日为折算日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算日

本次不定期份额折算的折算日为 2020 年 8 月 18 日。

二、基金份额折算对象

由于本基金为分级基金，因此基金份额折算对象包含基金份额折算日登记在册的本基金之基础份额（方正富邦中证保险份额的场外份额和场内份额的合计，基金代码：167301，其中场内简称：保险分级）、方正富邦中证保险 A 份额（场内简称：保险 A，基金代码：150329）和方正富邦中证保险 B 份额（场内简称：保险 B，基金代码：150330）。

三、基金份额折算方式

当方正富邦中证保险份额的基金份额净值达到 1.500 元后，本基金将分别对方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额和方正富邦中证保险份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额的比例为 1:1，份额折算后方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额的基金份额参考净值、方正富邦中证保险份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

当方正富邦中证保险份额的份额净值达到 1.500 元后，方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额、方正富邦中证保险份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

(1) 方正富邦中证保险 A 份额

份额折算原则：

①份额折算前方正富邦中证中证保险 A 份额的份额数与份额折算后方正富邦中证保险 A 份额的份额数相等；

②方正富邦中证保险 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即参考净值超出 1 元以上的部分全部折算为场内方正富邦中证保险份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$$

方正富邦中证保险 A 份额持有人新增的场内方正富邦中证保险

$$\text{份额数量} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前方正富邦中证保险 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前方正富邦中证保险 A 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后方正富邦中证保险 A 份额的份额数

(2) 方正富邦中证保险 B 份额

份额折算原则：

①份额折算后方正富邦中证保险 B 份额与方正富邦中证保险 A 份额的份额数保持 1：1 配比；

②份额折算前方正富邦中证保险 B 份额的资产净值与份额折算后方正富邦中证保险 B 份额的资产净值及新增场内方正富邦中证保险份额的资产净值之和相等；

③份额折算前方正富邦中证保险 B 份额的持有人在份额折算后将持有方正富邦中证保险 B 份额与新增场内方正富邦中证保险份额。

$$NUM_B^{\text{前}} = NUM_B^{\text{后}}$$

方正富邦中证保险 B 份额持有人新增的场内方正富邦中证保险份额数量

$$= \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前方正富邦中证保险 B 份额的基金份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前方正富邦中证保险 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后方正富邦中证保险 B 份额的份额数

(3) 方正富邦中证保险份额

份额折算原则：

①场外方正富邦中证保险份额持有人份额折算后获得新增场外方正富邦中证保险份额，场内方正富邦中证保险份额持有人份额折算后获得新增场内方正富邦中证保险份额。

方正富邦中证保险份额持有人新增的方正富邦中证保险份额数量

$$= \frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前方正富邦中证保险份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前方正富邦中证保险份额的份额数

方正富邦中证保险份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；方正富邦中证保险份额的场内份额经折算后的份额数，以及方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额折算成方正富邦中证保险份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

（4）举例

某投资人持有方正富邦中证保险份额、方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额分别为 100,000 份，10,000 份和 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，假设三类份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）如下表所示（为便于投资者理解，此处采用假设的净值进行计算；折算日折算前准确的净值以当日日终基金管理人计算并经托管人复核的净值为准），折算后，方正富邦中证保险份额的基金份额净值、方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额

的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值/ 基金份额参考 净值 (假设值)	基金份额数	基金份额净值 /基金份额参 考净值	基金份额数
方正富邦 中证保险 份额	1.500 元	100,000	1.000 元	150,000 份方正富 邦中证保险份额
方正富邦 中证保险 A 份额	1.025 元	10,000	1.000 元	10,000 份方正富邦 中证保险 A 份额+新 增 250 份方正富邦 中证保险份额
方正富邦 中证保险 B 份额	1.975 元	10,000	1.000 元	10,000 份方正富邦 中证保险 B 份额+新 增 9,750 份方正富 邦中证保险份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算日（即 2020 年 8 月 18 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管，下同）及配对转换业务；方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额正常交易；折算日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算日后的第一个工作日（即 2020 年 8 月 19 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务；方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额将于该日停牌一天；本基金

登记结算机构及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算日后的第二个工作日(即 2020 年 8 月 20 日),基金管理人将公告份额折算确认结果,基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额;自该日起,本基金恢复办理赎回、场外申购、转托管(除场外转场内)及配对合并业务,方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额将于当日开市起恢复正常交易。(基金管理人于 2019 年 3 月 9 日发布了《关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金暂停场内申购业务及跨系统转托管(仅限场外转场内)业务的公告》,自 2019 年 3 月 12 日起,暂停本基金场内申购业务及本基金份额的跨系统转托管(仅限场外转场内)业务。基金管理人于 2020 年 8 月 18 日发布了《关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金暂停场内分拆业务的公告》,自 2020 年 8 月 20 日起暂停办理方正富邦中证保险份额(基金代码:167301,场内简称:保险分级)的场内分拆业务。为保障基金份额持有人利益,后续将继续遵循上述相关限制,相关限制如有调整,以基金管理人届时最新公告为准,具体详见相关公告。)

4、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》,2020 年 8 月 20 日方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 8 月 19 日的方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)。

5、2020 年 8 月 20 日方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证

保险 B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

五、重要提示

1、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》，本基金将在 2020 年底前完成规范整改，请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。

2、方正富邦中证保险 A 份额表现为较低风险、收益相对稳定的特征。当发生基金合同规定的不定期份额折算时，基金份额折算基准日折算前方正富邦中证保险 A 份额超 1.000 元的部分将折算为方正富邦中证保险份额，即原方正富邦中证保险 A 份额的持有人在不定期份额折算后将持有方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险份额。因此，原方正富邦中证保险 A 份额的基金份额持有人所持有基金份额的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

3、方正富邦中证保险 B 份额表现为高风险、高收益的特征。当发生基金合同规定的不定期份额折算时，基金份额折算基准日折算前方正富邦中证保险 B 份额超 1.000 元的部分将折算为方正富邦中证保险份额，即原方正富邦中证保险 B 份额的持有人在不定期份额折算后将持有方正富邦中证保险 B 份额和方正富邦中证保险份额。因此，原方正富邦中证保险 B 份额的基金份额持有人所持有基金份额的风

险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。经过折算，方正富邦中证保险 B 份额的杠杆将恢复到初始杠杆水平，高于折算前的杠杆倍数。

4、方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，其折溢价率可能随之发生较大变化。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。

5、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日方正富邦中证保险份额的净值可能与触发折算阈值的 1.500 元有一定差异。

6、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），余额计入基金资产，持有极小数量方正富邦中证保险份额的基金份额持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

7、由于本基金暂停办理场内分拆业务（详见 2020 年 8 月 18 日基金管理人发布的《关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金暂停场内分拆业务的公告》），原方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额持有人无法通过办理分拆业务将此次折算获得的场内方正富邦中证保险份额分拆为方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额。

8、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登陆本

公司网站：www.founderff.com 或者拨打本公司客服电话：400—818—0990（免长途话费）。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金管理人提醒投资者基金投资的“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。投资有风险，决策须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读基金的基金合同、最新招募说明书及其他法律文件。

特此公告。

方正富邦基金管理有限公司

二〇二〇年八月十八日