关于广发中证医疗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《广发中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关规定，当广发中证医疗指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额——广发医疗份额（场内简称：医疗分级；场内代码 502056）的基金份额参考净值达到或超过 1.5000 元时，广发医疗份额、广发医疗 A 份额（场内简称：医疗 A；场内代码 502057）、广发医疗 B 份额（场内简称：医疗 B；场内代码 502058）将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 3 月 6 日，广发医疗份额的基金份额净值为 1.5027 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及上海证券交易所、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 3 月 9 日作为基金份额折算基准日，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 2020 年 3 月 9 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额、广发医疗份额。

三、基金份额折算方式

1、当广发医疗份额的基金份额净值达到或超过 1.5000 元后，本基金将分别对广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额和广发医疗份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额的比例为 1:1，份额折算后广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额的基金份额参考净值和广发医疗份额的基金份额净值均调整为 1 元。

2、当广发医疗份额的基金份额净值达到或超过 1.5000 元后，广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额、广发医疗份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

（1）广发医疗 A 份额

份额折算原则：

①份额折算前广发医疗 A 份额的份额数与份额折算后广发医疗 A 份额的份额数相等；

②广发医疗 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内广发医疗份额。

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

广发医疗 A 份额持有人新增的场内广发医疗份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{1.0000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗 A 份额的份额数

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 A 份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 A 份额参考净值，即折算基准日广发医疗 A 份额的基金份额参考净值

(2) 广发医疗 B 份额

份额折算原则：

① 份额折算后广发医疗 B 份额与广发医疗 A 份额的份额数保持 1：1 配比；

② 份额折算前广发医疗 B 份额的资产净值与份额折算后广发医疗 B 份额的资产净值及广发医疗 B 份额新增场内广发医疗份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前广发医疗 B 的持有人在份额折算后将持有广发医疗 B 份额与新增场内广发医疗份额。

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

广发医疗 B 份额持有人新增的场内广发医疗份额的份额数

$$= \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.0000)}{1.0000}$$

其中：

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗 B 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗 A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 B 份额的份额数

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 B 份额参考净值，即折算基准日广发医疗 B 份额的基金份额参考净值

(3) 广发医疗份额

份额折算原则：

场外广发医疗份额持有人份额折算后获得新增场外广发医疗份额，场内广发医疗份额持有人份额折算后获得新增场内广发医疗份额。

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗份额的份额数

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗份额净值，即折算基准日广发医疗份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗份额的份额数

四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，广发医疗份额的基金份额净值、广发医疗 A 份额与广发医疗 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，广发医疗份额的基金份额净值、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额的基金份额参考净值均调整 1.0000 元，则各持有广发医疗份额、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	折算前基金份额数（份）	折算前基金份额净值/参考净值（元）	折算后基金份额数	折算后基金份额净值/参考净值（元）
广发医疗份额	10,000	1.5000	15,000 份广发医疗份额	1.0000
广发医疗 A 份额	10,000	1.0280	10,000 份广发医疗 A 份额 +280 份广发医疗份额	1.0000
广发医疗 B 份额	10,000	1.9720	10,000 份广发医疗 B 份额 +9720 份广发医疗份额	1.0000

五、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 2020 年 3 月 9 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务。广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额正常交易。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 2020 年 3 月 10 日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医

疗 B 份额将于该日停牌一天。当日，本基金注册登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认及份额折算。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 3 月 11 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。由于各销售机构系统及业务安排等原因，折算后份额可查询时间可能有所不同，具体以各销售机构为准。

当日，本基金恢复办理赎回、转换转出、转托管、配对转换业务；申购、转换转入及定期定额投资业务仍需遵循基金管理人 2020 年 2 月 14 日发布的《关于广发中证医疗指数分级证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》中的相关限制，相关限制如有调整，以基金管理人届时最新公告为准。广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额将于该日开市起恢复正常交易。

（四）根据上海证券交易所的相关规定，2020 年 3 月 11 日广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额复牌当日即时行情显示的前收盘价为 2020 年 3 月 10 日的广发医疗份额、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

（五）2020 年 3 月 11 日，广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 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。

六、重要提示

（一）本基金广发医疗 A 份额为预期风险、收益相对较低的子份额。在不定期份额折算后，广发医疗 A 份额持有人将持有广发医疗 A 份额和广发医疗份额。因此，原广发医疗 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。此外，广发医疗份额为跟踪中证医疗指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此广发医疗 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

（二）本基金广发医疗 B 份额为预期风险、收益相对较高的子份额。在不定期份额折算后，广发医疗 B 份额持有人在份额折算后将持有广发医疗 B 份额与广发医疗份额。因此，原广发医疗 B 份额的基金份额持有人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，广发医疗 B 份额的杠杆将恢复至初始杠杆水平，高于折算前的杠杆倍数。相应地，广发医疗 B 份额的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅增加。

(三) 由于广发医疗份额、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 类份额折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后, 广发医疗份额、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额的折溢价率可能发生较大变化。提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价变化相关的风险。

(四) 原广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内广发医疗份额分拆为广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额。

(五) 由于广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额新增份额折算成广发医疗份额的场内份额数和广发医疗份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份), 折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额, 按照投资者零碎份额数量大小顺序排列, 零碎份额数量相同的, 由中国结算上海分公司证券登记系统随机排列。中国结算上海分公司证券登记系统按照排列顺序, 依次均登记为 1 份, 直至完成全部折算。

持有较少广发医疗 A 份额数、广发医疗 B 份额数或场内广发医疗份额数的份额持有人存在无法获得新增场内广发医疗份额的可能性。因此, 上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

(六) 此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日, 折算基准日的广发医疗份额净值与折算阈值 1.5000 元有一定差异。

(七) 本公司承诺以诚实信用、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应知晓基金投资的“买者自负”原则, 投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等相关法律文件, 充分认识投资风险, 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。(八) 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.gffunds.com.cn 或者拨打本公司客服电话: 95105828(免长途话费)。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2020 年 3 月 9 日