

关于华宝中证医疗指数分级证券投资基金不定期份额折算 结果及恢复交易的公告

根据《华宝中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》的约定及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，华宝中证医疗指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）以2020年6月11日为不定期折算基准日，对在该日登记在册的华宝医疗份额（场内简称：医疗分级，代码：162412）、华宝医疗A份额（场内简称：医疗A，代码：150261）和华宝医疗B份额（场内简称：医疗B，代码：150262）办理了不定期份额折算业务。现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2020年6月11日，华宝医疗份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产；华宝医疗份额的场内份额、华宝医疗A份额、华宝医疗B份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产。份额折算比例精确到小数点后第9位，折算结果如下表所示：

基金份额名称	折算前份额 (单位：份)	折算前基金 份额净值 (或基金份 额参考净 值)(单位： 元)	新增份额折算 比例	折算后份额 (单位：份)	折算后基金 份额净值(或 基金份额参 考净值)(单 位：元)
场外华宝医疗 份额	415,607,919.38	1.4978	0.497772262	622,486,013.56	1.0000
场内华宝医疗 份额	18,139,690.00	1.4978	0.497772262	27,169,124.00	1.0000
华宝医疗A 份额	40,010,399.00	1.0272	0.027199454	40,010,399.00	1.0000
				1,088,261.00 (注1)	
华宝医疗B 份额	40,010,399.00	1.9684	0.968345071	40,010,399.00	1.0000
				38,743,872.00 (注2)	

注1：该“折算后基金份额”为华宝医疗A份额经折算后产生新增的场内华宝医疗份额；

注2：该“折算后基金份额”为华宝医疗B份额经折算后产生新增的场内华宝医疗份额。

投资者自公告之日起可查询经登记机构及本基金管理人确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2020年6月15日起，本基金恢复申购（含不定期定额投资，不包括场内申购）、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管（场内转场外），不包括跨系统转托管（场外转场内））和配对转换业务（不包括场内分拆业务），华宝医疗A份额、华宝医疗B份额将于2020年6月15日开市起复牌。

根据深圳证券交易所《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6月15日复牌首日，华宝医疗A份额即时行情显示的前收盘价将调整为2020年6月12日华宝医疗A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），即1.000元；华宝医疗B份额即时行情显示的前收盘价将调整为2020年6月12日华宝医疗B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），即1.037元。2020年6月15日当日华宝医疗A份额和华宝医疗B份额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。

三、其他需要提示的事项

1、由于华宝医疗A份额、华宝医疗B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，华宝医疗A份额、华宝医疗B份额的折溢价率可能发生较大变化。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。

2、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，折算基准日华宝医疗份额的基金份额净值可能与触发折算的阈值（1.5000元）有一定差异。

3、相对于华宝医疗份额，华宝医疗A份额为预期风险、收益相对较低的特征，但在不定期份额折算后，原华宝医疗A份额持有人将同时持有华宝医疗A份额和华宝医疗份额，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，风险收益特征将发生较大变化，因此华宝医疗A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

4、相对于华宝医疗份额，华宝医疗B份额为预期风险、收益相对较高的子份额，但在不定期份额折算后，原华宝医疗B份额持有人将同时持有华宝医疗B份额与华宝医疗份额，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，风险收益特征将发生较大变化，且折算后其杠杆倍数将恢复到初始杠杆水平，高于折算前的杠杆倍数，相应地，华宝医疗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。

5、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则，场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分舍去，

舍去部分计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。因此，在不定期份额折算过程中，由于尾差处理，可能使持有人的资产净值出现微小误差，但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

6、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买华宝医疗 A 份额、华宝医疗 B 份额，在不定期份额折算后，则折算新增的华宝医疗份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将华宝医疗 A 份额、华宝医疗 B 份额卖出，或者在折算后将新增的华宝医疗份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

7、本基金已于 2019 年 4 月 13 日发布公告，自 2019 年 4 月 15 日起暂停华宝医疗份额的场内申购业务并暂停华宝医疗份额的跨系统转托管（场外转场内）业务；于 2020 年 5 月 16 日发布公告，自 2020 年 5 月 20 日起暂停华宝医疗份额的场内分拆业务。具体详见相关公告。

8、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《资管新规》）要求，公募产品不得进行份额分级，应在《资管新规》规定的过渡期结束前（即 2020 年 12 月 31 日前）进行整改规范，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。

9、投资者若希望了解本基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《华宝中证医疗指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”），也可访问基金管理人网站（www.fsfund.com）或者拨打本公司客服电话：400-700-5588（免长途话费）、400-820-5050（免长途话费）、021-38924558。

10、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，选择须谨慎。敬请投资者于投资前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和临时公告。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2020年6月15日