关于富国中证体育产业指数分级证券投资基金修订基金合同的公告

经国务院同意，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》明确规定，公募产品不得进行份额分级，且要求过渡期后，“金融机构不得再发行或存续违反本意见规定的资产管理产品”。为落实上述规定要求，并根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，富国基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）对富国中证体育产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同进行了修改，并已报监管部门备案。本次法律文件的修改系根据相关法律法规及监管要求而进行，符合相关法律法规的规定以及基金合同的约定。本次基金合同修订涉及根据监管规定取消分级机制，并据此就富国体育 A 份额（场内简称：体育 A，基金代码：150307）与富国体育 B 份额（场内简称：体育 B，基金代码：150308）的终止运作，包括终止上市与份额折算等后续具体操作做了安排，具体修改内容详见附件。

重要提示：

1、本次基金合同修改自 2020 年 11 月 19 日起生效。

2、本基金富国体育 A 份额和富国体育 B 份额的终止运作的时间安排，将由基金管理人提前至少 20 个交易日另行公告。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3、本公司将在公司网站（www.fullgoal.com.cn）公布修改后的基金合同，招募说明书涉及前述内容的，将一并修改，并于本公告发布之日起三个工作日内公告。

风险提示：

1、本基金修订基金合同后，各类份额持有人的影响列示如下表：

公告前[1]			公告后、折算前			折算后		
持有份额类别	折溢价	净值杠杆	持有份额类别	折溢价	净值杠杆	持有份额类别	折溢价	净值杠杆
A级份额	D_A	无	不变[2]	D_A可能收窄	不变[2]	基础份额	无	无
B级份额	D_B	L_B	不变[2]	D_B可能收窄	L_B正常变化	基础份额	无	无
基础份额	无	无	不变[2]	不变[2]	不变[2]	基础份额	无	无

备注1：“公告前”指的是本次公告之前。

备注2：“不变”指的是与本次公告之前相比没有变化。

备注3：D_A=A级份额价格/A级份额参考净值-1；D_B=B级份额价格/B级份额参考净值-1；L_B=基础份额净值/（B级份额参考净值×B级份额数/（A级份额数+B级份额数））；

L_B随基础份额净值的变化而变化，而基础份额净值根据标的指数的涨跌而涨跌。

（1）由于富国体育A份额和富国体育B份额可能存在折溢价交易情形，本次基金合同修订后，其折溢价率可能发生较大变化，**如果投资者以溢价买入，折算后可能遭受较大损失**（具体折算方式及示例详见风险提示第4条及修订后的基金合同条款）。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）富国体育A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征，但在份额折算后，富国体育A份额的持有人将持有具有较高预期

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

风险、较高预期收益特征的富国体育份额，由于富国体育份额为跟踪中证体育产业指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，**原富国体育 A 份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险**。

富国体育 B 份额具有一定的杠杆属性，具有高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，富国体育 B 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的富国体育份额，由于富国体育份额为跟踪中证体育产业指数的基础份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，不会形成杠杆性收益或损失，但原富国体育 B 份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、富国体育 A 份额和富国体育 B 份额折算为富国体育份额前，富国体育 A 份额和富国体育 B 份额的持有人有两种方式退出：

（1）在场内按市价卖出基金份额；

（2）在场内买入等量的对应份额（即富国体育 A 份额持有人买入等量的富国体育 B 份额，或者富国体育 B 份额持有人买入等量的富国体育 A 份额），合并为富国体育份额，按照富国体育份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

3、本次基金合同修订后，由于富国体育 A 份额和富国体育 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特**提请投资者注意流动性风险**。

4、在份额折算基准日日终，以富国体育份额的基金份额净值为基准，富国体育 A 份额、富国体育 B 份额按照各自的**基金份额参考净**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

值（而不是二级市场价格）折算成场内富国体育份额。富国体育 A 份额和富国体育 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内富国体育份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。

富国体育A份额和富国体育B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化，示例如下：

假设份额折算基准日富国体育份额、富国体育 A 份额和富国体育 B 份额的基金份额（参考）净值的分别为：0.900 元、1.010 元、0.790 元，投资者甲、乙、丙分别持有场内富国体育份额、富国体育 A 份额、富国体育 B 份额各 100,000 份，其所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额（参考）净值（元）	基金份额（份）		基金份额净值（元）	基金份额
场内富国体育份额	0.900	100,000	（无变化）	0.900	100,000 份场内富国体育份额
富国体育 A 份额	1.010	100,000	1.122222222（全部折算为富国体育份额）	0.900	112,222 份场内富国体育份额
富国体育 B 份额	0.790	100,000	0.877777778（全部折算为富国体育份额）	0.900	87,777 份场内富国体育份额

5、**富国体育 A 份额和富国体育 B 份额折算为富国体育份额后，**投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，**需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回**。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，富国体育 A 份额和富国体育 B 份额合并或折算为富国体育份额后，**基金份额持有期自富国体育份额确认之日起计算**。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书的约定，富国体育份额的场内场外赎回费率如下：

持有期限N	赎回费率
N＜7日	1.50%
N≥7日	0.50%

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本公司承诺诚实信用地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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

特此公告。

附件：富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金合同修订对照表

富国基金管理有限公司

2020 年 11 月 18 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件：富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
第十二部分 基金份额持有人大会	二、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有富国体育份额、富国体育 A 份额、富国体育 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会： …… （13）终止基金份额的上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外； ……	二、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有富国体育份额、富国体育 A 份额、富国体育 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会： …… （13）终止基金份额的上市，但**根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定取消分级运作机制而需要终止上市或**因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外； ……
新增加	无	**第二十二部分、富国体育 A 份额与富国体育 B 份额的终止运作** **一、本基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止富国体育 A 份额与富国体育 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。为此，基金管理人将向深圳证券交易所申请基金份额终止上市，并办理富国体育 A 份额和富国体育**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		B 份额的份额折算。具体终止运作的时间安排见基金管理人届时发布的公告。基金管理人应将基金合同根据前述法律法规做相应修改并公告。 二、富国体育 A 份额与富国体育 B 份额的份额折算 份额折算基准日，富国体育 A 份额、富国体育 B 份额将全部折算成场内富国体育份额。 1、份额折算基准日 份额折算基准日为富国体育 A 份额与富国体育 B 份额终止上市日的前一交易日，具体日期见基金管理人届时发布的公告。 2、份额折算方式 在份额折算基准日日终，以富国体育份额的基金份额净值为基准，富国体育 A 份额、富国体育 B 份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内富国体育份额。富国体育 A 份额（或富国体育 B 份额）基金份额持有人持有的折算后场内富国体育份额取整计算（最小单位为 1 份),小数部分按照登记机构的相关规则及有关规定处理。 份额折算计算公式： 富国体育 A 份额（或富国体育 B 份额）的折算比例＝份额折算基准日富国体育 A 份额（或富国体育 B 份额)的基金份额参考净值/份额折算基准日富国体育份额的基金份额净值 富国体育 A 份额（或富国体育 B 份额）基金份额持有人持有的折算后场内富国体育份额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		＝基金份额持有人持有的折算前富国体育 A 份额（或富国体育 B 份额）的份额数×富国体育 A 份额（或富国体育 B 份额）的折算比例 3、份额折算后的基金运作 富国体育 A 份额与富国体育 B 份额全部折算为场内富国体育份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回，开始申购、赎回的时间及具体操作以基金管理人的公告为准。 4、份额折算的公告 富国体育 A 份额与富国体育 B 份额的份额折算结束后，基金管理人应在指定媒介公告。 三、基金份额折算期间的基金业务办理 为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可暂停相关份额的交易和申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn