

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定期份额折算业务的公告

根据《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的相关规定，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”）将以2020年12月15日为基金份额折算基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，基金份额折算基准日为每个会计年度的12月15日（遇节假日顺延）。本次定期份额折算基准日为2020年12月15日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的方正富邦中证保险A份额（场内简称：保险A，基金代码：150329）、方正富邦中证保险份额（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）。

三、基金份额折算方式

方正富邦中证保险A份额和方正富邦中证保险B份额按照本基金基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算，对方正富邦中证保险A份额的约定应得收益进行定期份额折算，每2份方正富邦中证保险份额将按1份方正富邦中证保险A份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，方正富邦中证保险A份额和方正

富邦中证保险 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

对于方正富邦中证保险 A 份额期末的约定应得收益, 即方正富邦中证保险 A 份额每个会计年度基金份额折算基准日的份额净值超出 1.000 元部分, 将折算为场内方正富邦中证保险份额分配给持有人。场内方正富邦中证保险份额持有人持有的每 2 份方正富邦中证保险份额将按 1 份方正富邦中证保险 A 份额获得新增场内方正富邦中证保险份额的分配。场外方正富邦中证保险份额的基金份额持有人持有的每 2 份方正富邦中证保险份额将按 1 份方正富邦中证保险 A 份额获得新增场外方正富邦中证保险份额的分配。经过上述份额折算, 方正富邦中证保险 A 份额的参考净值和方正富邦中证保险份额的基金份额净值将相应调整。

方正富邦中证保险 A 份额本年度应得收益的定期份额折算时, 有关计算公式如下:

1. 方正富邦中证保险 A 份额

定期份额折算后方正富邦中证保险 A 份额的份额数 = 定期份额折算前方正富邦中证保险 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

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

其中:

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

$NAV_A^{\text{前}}$ 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

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后方正富邦中证保险份额的基金份额净值

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

2. 方正富邦中证保险 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变方正富邦中证保险 B 份额持有人持有的方正富邦中证保险 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

3. 方正富邦中证保险份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

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=

$$\frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后方正富邦中证保险份额的份额数=定期份额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持有人新增的方正富邦中证保险份额数

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

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后方正富邦中证保险份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 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。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1. 定期份额折算基准日（即 2020 年 12 月 15 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。方正富邦中证保险 B 份额（场内简称：保险 B，基金代码：150330）在整个定期折算期间交易正常进行。

2. 定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 12 月 16 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务，方正富邦中证保险 A 份额暂停交易。当日，本基金登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3. 定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 12 月 17 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，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 份额恢复交易。

（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。)

五、重要提示

1. 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12月17日方正富邦中证保险A份额即时行情显示的前收盘价为前一交易日（2020年12月16日）的方正富邦中证保险A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于方正富邦中证保险A份额折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除约定收益后与2020年12月17日的前收盘价可能有较大差异，因此2020年12月17日当日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。

2. 本基金方正富邦中证保险A份额期末的约定应得收益将折算为场内方正富邦中证保险份额分配给方正富邦中证保险A份额的持有人，而方正富邦中证保险份额为跟踪中证方正富邦保险主题指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此方正富邦中证保险A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3. 由于方正富邦中证保险A份额经折算产生的新增场内方正富邦中证保险份额数和场内方正富邦中证保险份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量方正富邦中证保险A份额或场内方正富邦中证保险份额的持有人存在无法获得新增场内方正富邦中证保险份额的可能性。

4. 投资者若希望了解基金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：

基金管理人将根据中国人民银行、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》的要求，于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将方正富邦中证保险 A 份额与方正富邦中证保险 B 份额按照基金份额参考净值折算为方正富邦中证保险份额，并终止方正富邦中证保险 A 份额与方正富邦中证保险 B 份额的上市。敬请投资者关注相关风险以及基金管理人发布的相关公告，合理安排投资计划。

根据 2020 年 12 月 2 日发布的《关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，本基金之方正富邦中证保险 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）的终止上市日为 2021 年 1 月 4 日（最后交易日为 2020 年 12 月 31 日），基金份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。

以基金份额折算基准日日终方正富邦中证保险份额的基金份额净值为基准，方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额按

照各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算成场内方正富邦中证保险份额。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。

针对本基金之方正富邦中证保险A份额和方正富邦中证保险B份额终止运作的特别风险提示，具体详见《关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之方正富邦中证保险A份额和方正富邦中证保险B份额终止运作的特别风险提示公告》。敬请投资者注意相关投资风险。

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

二〇二〇年十二月十日