# 关于富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金之富国证券A份额和富国证券B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《关于富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之富国证券A份额（场内简称：证券A级，基金代码：150223）和富国证券B份额（场内简称：证券B级，基金代码：150224）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），折算基准日为2020年12月31日。在折算基准日日终，以富国证券份额的基金份额净值为基准，富国证券A份额、富国证券B份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内富国证券份额。

针对本基金之富国证券A份额和富国证券B份额终止运作的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、折算基准日前（含折算基准日），富国证券A份额和富国证券B份额仍可正常交易，期间敬请投资者高度关注以下风险：

（1）由于富国证券A份额和富国证券B份额可能存在折溢价交易情形，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本公告第4条）。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。

投资者应密切关注富国证券A份额和富国证券B份额的基金份额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

参考净值变化情况（可通过本公司网站查询）。

（2）富国证券 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，富国证券 A 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证券份额，由于富国证券份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，**原富国证券 A 份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。**

富国证券 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，富国证券 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证券份额，由于富国证券份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额，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，但原富国证券 B 份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、富国证券 A 份额和富国证券 B 份额折算为富国证券份额前，富国证券 A 份额和富国证券 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（即富国证券 A 份额持有人买入等量的富国证券 B 份额，或者富国证券 B 份额持有人买入等量的富国证券 A 份额），合并为富国证券份额，按照富国证券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或转换转出。

3、由于富国证券 A 份额和富国证券 B 份额的持有人可能选择场

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、在折算基准日日终，以富国证券份额的基金份额净值为基准，富国证券 A 份额、富国证券 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）**折算成场内富国证券份额。**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。**

富国证券A份额和富国证券B份额基金份额持有人持有的折算后场内富国证券份额取整计算（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，折算后的基金份额以登记机构最终确认的数据为准。**由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临其所持基金资产净值减小的风险，对于持有份额数极少的富国证券 A 份额、富国证券 B 份额的基金份额持有人，将面临持有的基金份额折算后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。**

**富国证券A份额和富国证券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：

**假设折算基准日富国证券份额、富国证券 A 份额和富国证券 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证券份额、富国证券 A 份额、富国证券 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 |
| 富国证券份 | 0.900 | 100,000 | （无变化） | 0.900 | 100,000 份场内富国 |

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 额 | | | | | 证券份额 |
| 富国证券 A 份额 | 1.010 | 100,000 | 1.122222222（全部折算为富国证券份额） | 0.900 | 112,222 份场内富国证券份额 |
| 富国证券 B 份额 | 0.790 | 100,000 | 0.877777778（全部折算为富国证券份额） | 0.900 | 87,777 份场内富国证券份额 |

5、**富国证券 A 份额和富国证券 B 份额折算为富国证券份额后，**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，富国证券 A 份额和富国证券 B 份额合并或折算为富国证券份额后，**基金份额持有期自富国证券份额确认之日起计算，其中富国证券 A 份额和富国证券 B 份额的基金份额持有人持有的折算后场内富国证券份额持有期自 2021 年 1 月 4 日起计算。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。**

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，本基金的赎回费率如下：

富国证券份额的赎回费率为持续持有期 7 日以内 1.5%，持续持有期 7 日及以上 0.5%。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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中 25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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。投资有风险，敬请投资者认真阅读相关公告，了解本基金目前的风险收益特征变化和相关安排，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况谨慎作出投资决策。

投资者可登陆基金管理人网站（www.fullgoal.com.cn）或拨打客服电话 95105686，4008880688（免长途话费）咨询相关信息。

特此公告。

富国基金管理有限公司

2020 年 12 月 11 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn