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

根据《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》，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”，方正富邦中证保险份额（基础份额）场内简称：保险分级，基金代码：167301）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折算成场内方正富邦中证保险份额。

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、终止上市的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、基金份额折算基准日前（含基金份额折算基准日），方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 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）由于方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 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**

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

投资者应密切关注方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（www.founderff.com）等方式进行查询。

（2）方正富邦中证保险 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，方正富邦中证保险 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方正富邦中证保险份额，**由于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，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原方正富邦中证保险 A 份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险**。

方正富邦中证保险 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，方正富邦中证保险 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方正富邦中证保险份额，由于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，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，但原方正富邦中证保险 B 份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额折算为方正富邦中证保险份额前，方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 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（即方正富邦中证保险 A 份额持有人买入等量的方正富邦中证保险 B 份额，或者方正富邦中证保险 B 份额持有人买入等

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

量的方正富邦中证保险 A 份额），合并为方正富邦中证保险份额，按照方正富邦中证保险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、由于方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回等方式退出，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、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。**

方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内方正富邦中证保险份额取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额的处理方式按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规则处理，折算后的基金份额以登记结算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，对于持有份额数较少的方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额的持有人，将面临持有的基金份额折算后份额数不足 1 份而被计入基金资产的风险**。

方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 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方正富邦中证保险份额、方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额的基金份额（参考）净值分别为：0.962 元、1.010 元、0.914 元，投资者甲、乙、丙分别持有场内方正富邦中证保险份额、方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额各 100,000 份，其所持基金份额的变

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

化如下表所示:

基金份额	折算前（折算基准日）		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（份）
场内方正富邦中证保险份额	0.962	100,000	（无变化）	0.962	100,000 份场内方正富邦中证保险份额
方正富邦中证保险 A 份额	1.010	100,000	1.049896049（全部折算为场内方正富邦中证保险份额）	0.962	104,989 份场内方正富邦中证保险份额
方正富邦中证保险 B 份额	0.914	100,000	0.950103950（全部折算为场内方正富邦中证保险份额）	0.962	95,010 份场内方正富邦中证保险份额

注：具体折算结果以登记结算机构为准。

5、方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额折算为方正富邦中证保险份额后，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，方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额合并或折算为方正富邦中证保险份额后，**基金份额持有期限自方正富邦中证保险份额确认之日起计算，其中方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内方正富邦中证保险份额持有期限自 2021 年 1 月 4 日起计算**。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期限确定，具体持有时间以登记结算机构系统

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

记录为准。**如果赎回份额时持有期限较短，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:

（1）场外赎回费率

赎回费用由基金赎回人承担，其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。本基金所对应的赎回费率随持有时间递减。具体如下:

持有期限（N）	**赎回费率**
N＜7 日	1.50%
7 日≤N＜1 年	0.50%
1 年≤N＜2 年	0.25%
N≥2 年	0

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额自登记机构确认之日开始计算。1 年为 365 日，2 年为 730 日，依此类推）

（2）场内赎回费率

本基金场内赎回费率具体如下，其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产:

持有期限（N）	**赎回费率**
N＜7 日	1.50%
N≥7 日	0.50%

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额自登记机构确认之日开始计算。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1 年为 365 日，2 年为 730 日，依此类推）

从场内转托管至场外的方正富邦中证保险份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

投资者欲了解详情，请登录基金管理人网站：www.founderff.com 或拨打本公司客服电话：400-818-0990 进行咨询。

风险提示：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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

方正富邦基金管理有限公司

2020 年 12 月 23 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn