

关于富国中证军工指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《富国中证军工指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）“二十一、基金份额折算”的相关规定，当富国中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额（富国军工份额）的基金份额净值高至 1.500 元或以上时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 7 月 14 日，富国军工份额的基金份额净值为 1.501 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2020 年 7 月 15 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2020 年 7 月 15 日。

二、基金份额折算对象

由于本基金为分级基金，因此基金份额折算对象包含基金份额折算基准日登记在册的本基金之基础份额（富国军工份额的场外份额和场内份额的合计，基金代码：161024，其中场内简称：军工分级）、富国军工 A 份额（场内简称：军工 A，基金代码：150181）和富国军工 B 份额（场内简称：军工 B，基金代码：150182）。

三、基金份额折算方式

当富国军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对富国军工 A 份额、富国军工 B 份额和富国军工份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保富国军工 A 份额和富国军工 B 份额的比例为 1:1，份额折算后富国军工 A 份额的基金份额参考净值、富国军工 B 份额的基金份额参考净值和富国军工份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。基金份额折算基准日折算前富国军工份额的基金份额净值及富国军工 A 份额、富国军工 B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为富国军工份额分别分配给富国军工份额、富国军工 A 份额和富国军工 B 份额的持有人。

（1）富国军工份额

$$\text{富国军工份额持有人新增的富国军工份额数} = \frac{(\text{NAV}_{\text{基础}}^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.000}$$

持有场外富国军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外富国军工份额的分配；持有场内富国军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内富国军工份额的分配。

(2) 富国军工 A 份额

折算后富国军工 A 份额的份额数保持不变，即 $\text{NUM}_A^{\text{后}} = \text{NUM}_A^{\text{前}}$

富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数

$$= \frac{(\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_A^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$\text{NUM}_A^{\text{后}}$ ：折算后富国军工 A 份额的份额数，下同

(3) 富国军工 B 份额

折算后富国军工 B 份额的份额数保持不变，即 $\text{NUM}_B^{\text{后}} = \text{NUM}_B^{\text{前}}$

富国军工 B 份额持有人新增的场内富国军工份额的份额数

$$= \frac{(\text{NAV}_B^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$\text{NUM}_B^{\text{后}}$ ：折算后富国军工 B 份额的份额数，下同

$\text{NUM}_B^{\text{前}}$ ：折算前富国军工 B 份额的份额数，下同

$\text{NAV}_B^{\text{前}}$ ：折算前富国军工 B 份额的基金份额参考净值，下同

(4) 折算后富国军工份额的总份额数

折算后富国军工份额的总份额数=折算前富国军工份额的份额数+富国军工份额持有人新增的富国军工份额数+富国军工 A 份额持有人新增的场内富国军工份额数+富国军工 B 份额持有人新增的场内富国军工份额数

(5) 举例

某投资人持有富国军工份额、富国军工 A 份额和富国军工 B 份额分别为 100,000 份，10,000 份和 10,000 份，在本基金的不定期份额折算基准日，假设三类份额的基金份额净值如下表所示（为便于投资者理解，此处采用假设的净值进

行计算；基准日折算前准确的净值以当日日终基金管理人计算并经托管人复核的净值为准），折算后，富国军工份额、富国军工 A 份额和富国军工 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值 (假设值)	基金份额	基金份额净值	基金份额
富国军工份额	1.500 元	100,000 份	1.000 元	150,000 份富国军工份额
富国军工 A 份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份富国军工 A 份额 +新增 280 份富国军工份 额
富国军工 B 份额	1.972 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份富国军工 B 份 额 +新增 9,720 份富国军工 份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2020 年 7 月 15 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管）、配对转换业务；富国军工 A 份额和富国军工 B 份额正常交易；基准日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 7 月 16 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管）、配对转换业务；富国军工 A 份额和富国军工 B 份额将于该日停牌一天；本基金注册登记人及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 7 月 17 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；自该日起，本基金恢复办理场外申购、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管（场内转场外））、配对转换（仅包括合并）业务，但仍需遵循基金管理人 2019 年 3 月 8 日发布的《关于富国中证军工指数分级证券投资基金恢复场外大额申购、定投及转换转入业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》、2020 年 3 月 14 日发布的《关于富国中证军工指数分级证券投资

基金暂停场内申购业务的公告》及 2020 年 3 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下分级基金暂停场内份额分拆业务的公告》中的相关限制，相关限制如有调整，以基金管理人届时最新公告为准；富国军工 A 份额和富国军工 B 份额将于当日开市起恢复正常交易。

4、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 7 月 17 日富国军工 A 份额和富国军工 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 7 月 16 日的富国军工 A 份额和富国军工 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

5、2020 年 7 月 17 日富国军工 A 份额和富国军工 B 份额均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。

五、重要提示

1、本基金富国军工 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后，原富国军工 A 份额持有人将持有富国军工 A 份额和富国军工份额，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，风险收益特征将发生较大变化，预期收益实现的不确定性将会增加；此外，富国军工份额为跟踪中证军工指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原富国军工 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、富国军工 B 份额表现为高风险、高收益的特征，但在不定期份额折算后，原富国军工 B 份额持有人将同时持有较高风险收益特征富国军工 B 份额与较低风险收益特征富国军工份额，风险收益特征将发生较大变化，且折算后其杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到初始的 2 倍杠杆水平。此外，富国军工 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。

3、由于富国军工 A 份额和富国军工 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，富国军工 A 份额和富国军工 B 份额的折溢价率可能随之发生较大变化。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。

4、由于本基金暂停办理场内份额分拆业务（详见 2020 年 3 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下分级基金暂停场内份额分拆业务的公告》），原富国军工 A 份额和富国军工 B 份额持有人无法通过办理分拆业务将此次折算

获得的场内富国军工份额分拆为富国军工 A 份额和富国军工 B 份额。

5、折算后，本基金富国军工份额的份额数量会增加。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量富国军工 A 份额、富国军工 B 份额和场内富国军工份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，折算基准日的富国军工份额净值与折算阈值 1.500 元可能有一定差异。

7、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知晓基金投资的“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。敬请投资者投资于本基金前应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。

8、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.fullgoal.com.cn 或者拨打本公司客服电话：400—888—0688（免长途话费）。

特此公告。

富国基金管理有限公司

2020 年 7 月 15 日