

华宝基金管理有限公司关于华宝中证医疗指数分级证券投资基金管理办 理定期份额折算业务的公告

根据《华宝中证医疗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, 华宝中证医疗指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”) 将以 2018 年 12 月 14 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、基金份额定期折算基准日

根据基金合同的规定, 基金份额折算基准日为每年 12 月 15 日(若该日为非工作日, 则提前至该日之前的最后一个工作日)。本次定期份额折算基准日为 2018 年 12 月 14 日。

二、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的华宝医疗 A 份额(场内简称: 医疗 A, 代码: 150261)、华宝医疗份额(场内简称: 医疗分级, 代码: 162412)。

三、基金份额折算方式

定期份额折算后华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元。基金份额折算基准日华宝医疗 A 份额参考净值超过 1.0000 元的部分, 将折算为场内华宝医疗份额分配给华宝医疗 A 份额持有人。华宝医疗份额持有人持有的每 2 份华宝医疗份额将按 1 份华宝医疗 A 份额获得新增华宝医疗份额的分配。场外华宝医疗份额持有人折算后获得新增场外华宝医疗份额的分配, 场内华宝医疗份额持有人折算后获得新增场内华宝医疗份额的分配。华宝医疗 B 份额不进行份额折算。

(1) 华宝医疗份额

$$\begin{aligned} \text{NAV}_{\text{医疗}}^{\text{后}} &= \left[\text{折算前华宝医疗份额的资产净值} - 0.5 \times \text{NUM}_{\text{医疗}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.0000) \right] / \text{NUM}_{\text{医疗}}^{\text{前}} \\ &= 0.5 \times \text{NUM}_{\text{医疗}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_A^{\text{前}} - 1.0000) / \text{NAV}_{\text{医疗}}^{\text{后}} \end{aligned}$$

其中,

$\text{NUM}_{\text{医疗}}^{\text{前}}$ 为折算前华宝医疗份额的份额数;

$\text{NAV}_A^{\text{前}}$ 为折算前华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值;

$NAV_{\text{医疗}}^{\text{前}}$ 为折算前华宝医疗份额的基金份额净值；

$NAV_{\text{医疗}}^{\text{后}}$ 为折算后华宝医疗份额的基金份额净值。

(2) 华宝医疗 A 份额

折算后华宝医疗 A 份额数与折算前相同： $NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$

华宝医疗 A 份额持有人折算后新增的场内华宝医疗份额的份额数

$$= NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) / NAV_{\text{医疗}}^{\text{后}}$$

其中，

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前华宝医疗 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后华宝医疗 A 份额的份额数。

(3) 华宝医疗 B 份额

定期份额折算不改变华宝医疗 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(4) 折算后华宝医疗份额的总份额数

折算后华宝医疗份额的总份额数=华宝医疗份额持有人折算前持有的华宝医疗份额的份额数+华宝医疗份额持有人折算后新增的华宝医疗份额的份额数+华宝医疗 A 份额持有人折算后新增的场内华宝医疗份额的份额数。

四、基金份额折算余额的处理方法

份额折算后场外基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理方法按照深圳证券交易所或登记机构的相关规则及有关规定执行。

按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

五、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 定期份额期折算基准日(即 2018 年 12 月 14 日)，本基金暂停办理申购(含定期定额投资)、赎回、转托管(包括场外转托管、跨系统转托管，下同)、配对转换业务；华宝医疗 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。华宝医疗 B 份额在整个定期折算期间交易正常进行。

(二) 定期折算基准日后的第一个工作日(即 2018 年 12 月 17 日)，本基金暂停办理申购(含定期定额投资)、赎回、转托管、配对转换业务，华宝医疗 A 份额暂停交易。当日，

本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

(三) 定期折算基准日后的第二个工作日(即 2018 年 12 月 18 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。当日, 本基金恢复办理申购(含定期定额投资)、赎回、转托管、配对转换业务; 华宝医疗 A 份额将于 2018 年 12 月 18 日上午开市起复牌。

(四) 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》, 2018 年 12 月 18 日华宝医疗 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2018 年 12 月 17 日的华宝医疗 A 份额的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)。由于华宝医疗 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 2018 年 12 月 18 日的前收盘价可能有较大差异, 因此 2018 年 12 月 18 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。

六、重要提示

1、本基金华宝医疗 A 份额期末的约定应得收益折算为场内华宝医疗份额分配给华宝医疗 A 份额的持有人, 而华宝医疗份额为跟踪中证医疗指数的基础份额, 其份额净值将随市场涨跌而变化, 因此华宝医疗 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。

2、由于华宝医疗 A 份额经折算产生的新增场内华宝医疗份额数和场内华宝医疗份额经折算后的份额数皆取整计算(最小单位为 1 份), 舍去部分计入基金财产, 持有极小数量华宝医疗 A 份额或场内华宝医疗份额的持有人存在无法获得新增场内华宝医疗份额的可能性。

3、投资者若希望了解本基金定期份额折算业务详情, 请参阅本基金的基金合同及《华宝中证医疗指数分级证券投资基金管理说明书》(以下简称“招募说明书”), 也可访问基金管理人网站(www.fsfund.com)或者拨打本公司客服电话: 400-700-5588(免长途话费)、021-38924558。

4、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, 选择须谨慎。敬请投资者于投资前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和临时公告。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2018年12月11日