

国海富兰克林基金管理有限公司

关于富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

办理定期份额折算业务的公告

根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》（简称：“基金合同”）及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金（简称：“本基金”）将在2020年1月2日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外）。本次定期份额的折算基准日为2020年1月2日。

二、份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之基础份额（以下简称：国富中证100，场内简称：国富100，基金代码：164508）和富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金A份额（以下简称：国富中证100A，场内简称：国富100A，基金代码：150135）。

三、份额折算方式

国富中证100 A 份额和国富中证100 B份额按照基金合同“基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对国富中证100 A 份额

的应得收益进行定期份额折算，每2份国富中证100份额将按1份国富中证100 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，国富中证100 A 份额和国富中证100 B份额的份额配比保持1：1的比例。

对于国富中证100 A 份额期末的约定收益，即每个会计年度12月31日国富中证100 A 份额的基金份额参考净值超出1.000元部分，将折算为场内国富中证100份额分配给国富中证100 A 份额持有人。国富中证100份额持有人持有的每2份国富中证100份额将按1份国富中证100 A 份额获得新增国富中证100份额的分配。持有场外国富中证100份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国富中证100份额的分配；持有场内国富中证100份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国富中证100份额的分配。经过上述份额计算，国富中证100 A 份额的基金份额参考净值和国富中证100份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对国富中证100A份额和国富中证100份额进行应得收益的定期份额计算。

每个会计年度的第一个工作日进行国富中证100 A份额上一年度应得收益额定期份额折算时，有关计算公式如下：

1、国富中证 100 A 份额的折算

定期份额折算后国富中证 100 A 份额的份额数=定期份额折算前国富中证 100 A 份额的份额数

定期份额折算后国富中证 100 A 份额的基金份额参考净值为
1.000 元。

$$NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前国富中证100份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{每份国富中证100A份额上年度期末资产净值} - 1.000) \times NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}$$

国富中证 100 A 份额持有人新增的场内国富中证 100 份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}}$$

其中： $NAV_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国富中证 100A 份额参考净值

$NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后国富中证 100 份额净值

$NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国富中证 100 份额的份额数

$NUM_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国富中证 100 A 份额的份额数

2、国富中证 100 B 份额的折算

每个会计年度的定期份额折算不改变国富中证 100 B 份额的参考净值及其份额数。

3、国富中证 100 份额的折算

$$NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前国富中证100份额的资产净值} - 0.5 \times (\text{每份国富中证100A份额上年度期末资产净值} - 1.000) \times NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}$$

国富中证 100 份额持有人新增的国富中证 100 份额

$$= \frac{NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{每份国富中证100A份额期末资产净值}-1.000}{NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后国富中证 100 份额净值

$NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国富中证 100 份额的份额数

国富中证 100 份额持有人定期份额折算后持有的国富中证 100 份额的份额数= 定期份额折算前国富中证 100 份额的份额数 + 国富中证 100 份额持有人新增的国富中证 100 份额数。

国富中证100份额的场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有；国富中证100份额的场内份额经折算后的份额数保留至整数位（最小单位为1份），不足1份的零碎份，按各个零碎份从大到小排序，依次向相应的基金份额持有人计增1份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

4、举例

假设2020年1月2日为定期份额折算基准日，国富中证100份额的基金份额净值为1.360元。当天场外国富中证100份额、场内国富中证100份额、国富中证100 A 份额、国富中证100 B份额基金份额的份额数分别为20亿份、5亿份、10亿份、10亿份。前一个会计年度末每份国富中证100 A 份额资产净值为1.068元，且未进行不定期份额折算。

(1) 定期份额折算的对象为基准日登记在册的国富中证100 A

份额和国富中证100份额，即10亿份和25亿份。

(2) 国富中证100 A 份额持有人折算后持有国富中证100 A 份额 =折算前国富中证100 A 份额=10亿份

定期份额折算后国富中证100份额净值=

$$\begin{aligned} & NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} - 1.000) \\ & = 1.360 - 0.5 \times (1.068 - 1.000) = 1.326 \text{元} \end{aligned}$$

新增的场内国富中证100份额的份额数=

$$\begin{aligned} & \frac{NUM_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}} \\ & = 1,000,000,000 \times (1.068 - 1) / 1.326 = 51,282,051.28 \text{份} \end{aligned}$$

国富中证100 A 份额新增份额折算成国富中证100份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），新增国富中证100份额为51,282,051份；持有的国富中证100 A 份额为10亿份。

(3) 国富中证100份额持有人

$$\text{场外新增的国富中证100份额} = \frac{NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}}$$

$$= 2,000,000,000 / 2 \times (1.068 - 1) / 1.326 = 51,282,051.28 \text{份}$$

定期份额折算后场外国富中证100份额的份额数=定期份额折算前场外国富中证100份额的份额数+场外新增的国富中证100份额

$$= 2,000,000,000 + 51,282,051.28 = 2,051,282,051.28 \text{份}$$

$$\text{场内新增的国富中证100份额} = \frac{NUM_{\text{国富中证100}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_{\text{国富中证100A}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{国富中证100}}^{\text{后}}}$$

$$= 500,000,000 / 2 \times (1.068 - 1.000) / 1.326 = 12,820,512.82, \text{取整后为} 12,820,512 \text{份}$$

定期份额折算后场内国富中证100份额的份额数=定期份额折算前场内国富中证100份额的份额数+场内新增的国富中证100份额
=500,000,000+12,820,512=512,820,512份

四、份额折算期间的业务办理

(一) 份额折算基准日(即2020年1月2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、跨系统转托管, 下同)、配对转换业务; 国富中证100A和国富中证100B正常交易。当日晚间, 基金管理人计算当日国富中证100份额净值和国富中证100A份额、国富中证100B份额的基金份额参考净值并对国富中证100A份额、国富中证100份额进行份额折算。

(二) 份额折算基准日后的第一个工作日(即2020年1月3日), 本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务, 国富中证100A暂停交易, 国富中证100B正常交易。当日, 本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

(三) 份额折算基准日后的第二个工作日(即2020年1月6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, 本基金恢复办理场外申购(含定期定额投资)、场外和场内赎回、转托管(包括系统内转托管和由场内转场外的跨系统转托管)、配对转换业务。自2020年1月6日起, 本基金将继续暂停场内申购业务、跨系统转托管(场外转场内)业务及场外大额交易业务。暂停场外大额交易业务指单日单个基金账户在同一销售机构场外累计申购和定期定额投资总金额不得超过10万元, 若超过10万元(不含

10万元)，则超过部分的交易申请管理人有权对其做整笔确认失败处理。国富中证100A正常交易，国富中证100B正常交易。

五、重要提示

（一）根据深圳证券交易所《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1月6日国富100A即时行情显示的前收盘价为2020年1月3日的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于国富中证100A份额折算前可能存在折溢价交易情形，国富中证100A份额折算前的收盘价扣除约定收益后与2020年1月6日的前收盘价可能有较大差异，2020年1月6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。

（二）本基金国富中证100A期末的约定应得收益将折算为场内国富中证100份额分配给国富中证100A份额的持有人，而国富中证100份额为跟踪中证100指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此国富中证100A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无法达到预期收益的风险。

（三）由于国富中证100A份额期末约定应得收益折算成场内国富中证100份额的份额数和国富中证100份额的场内份额经折算后获得的新增份额数将保留至整数位（最小单位为1份），不足1份的零碎份，按各个零碎份从大到小排序，依次向相应的基金份额持有人计增1份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕，故持有较少国富中证100A份额数或场内国富中证100份额数的份额持有人存在无法获得新增场内国富中证100份额的可能性。

（四）投资者欲了解基金份额折算业务详情，可致电本公司的客户服务电话（4007004518、95105680或021-38789555）或登录本公司网站（www.ftsfund.com）进行查询。

六、风险提示

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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。投资者投资于本公司基金前应认真阅读相关的基金合同和招募说明书等文件，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国海富兰克林基金管理有限公司

2019年12月27日