

## 云南铜业股份有限公司 关于最近五年被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施及整改情况的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

鉴于云南铜业股份有限公司（以下简称“云南铜业”或“公司”）拟进行非公开发行股票，公司现就最近五年被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施情况公告如下：

（一）云南证监局于2014年9月25日向公司出具《云南证监局关于云南铜业的监管关注函》（云证监函〔2014〕157号），要求公司就下列事项作出说明：

- 1.监管关注函的主要内容  
2014年9月25日，云南证监局出具《云南证监局关于云南铜业的监管关注函》（云证监函〔2014〕157号），对公司提出如下监管要求：  
“一、加强公司治理，确保上市公司独立性。公司和控股股东应严格按照相关法律法规和上市公司治理准则要求，进一步健全公司法人治理结构，确保上市公司在人员、资产、财务、机构和业务等方面的独立性。  
二、督促控股股东履行好承诺事项。公司控股股东需严格按照所承诺的期限切实履行已公告的承诺事项，同时你公司应做好内幕信息管理工作，杜绝内幕交易和信息披露违规行为。  
三、采取切实有效措施抓好生产经营。公司应进一步认清市场的复杂性和严峻性，把风险和困难估计足，尽快落实各项扭亏预案，着力抓好生产经营。”

- 2.公司的整改措施  
针对上述监管要求，公司采取了相应的整改措施，具体如下：  
（1）公司持续严格按照相关法律法规和上市公司治理准则要求，不断规范完善公司治理，进一步健全公司法人治理结构，确保上市公司在人员、资产、财务、机构和业务等方面的独立性，以推动公司健康、稳定的发展。

- （2）公司持续督促控股股东履行承诺事项，控股股东云铜集团在2007年非公开发行股票时作出的部分承诺存在超期未履行的情况，2010年非公开发行股票时部分承诺存在完成时限不明确的情况。因凉山矿业股份有限公司（以下简称“凉山矿业”）股权结构复杂、内部结构调整、资源整合等方面尚需进一步理顺和油库有色金属有限公司（以下简称“迪庆有色”）现有开发条件尚不完善等原因，导致2007年非公开发行时作出的承诺未能如期履行。鉴于以上情况，为进一步完善控股股东的承诺，控股股东对承诺事项进行了修改完善，提交2014年6月13日公司第六届董事会第十次会议和2014年度第二次临时股东大会审议通过，并进行了公告。

- 截至目前，关于凉山矿业和迪庆有色股权的注入工作尚未完成，控股股东自2014年起成立了专门工作领导小组，持续开展包括资源储量核实、股东沟通、审计评估等资产注入工作，但由于凉山矿业股权及资产权属问题，目前尚未完成资产注入工作。对此，为了尽快完成资产注入工作：（1）控股股东于2016年对凉山矿业承诺事项进行了进一步修改完善，提交公司第七届董事会第六次会议、2017年第一次临时股东大会审议通过，并进行了公告；（2）经公司第七届董事会第十二次会议、2017年第一次临时股东大会审议通过，公司拟通过本次非公开发行股票收购迪庆有色50.01%股权，以解决迪庆有色资产注入问题，履行相关承诺。

- 公司将持续做好内幕信息管理工作，杜绝内幕交易和信息披露违规行为，最近五年未出现因内幕交易和信息披露违规行为被相关部门处罚的行为。
- （3）2013由于铜价较大幅度下跌，公司经营面临较大压力，2013年归属母公司净利润亏损-149,611.64万元。2014年以来公司紧紧围绕“改革创新、加快发展、转型升级、全面控亏”这一主题，采取了切实有效的措施以保证公司盈利，主要采取的措施包括：

- ①积极抓住铜价上涨机遇，精心组织铜冶炼生产。2011年以来铜价持续下跌给公司带来较大经营压力，公司积极抓住2011年以来铜加工费上涨的市场机遇，满负荷精心组织铜冶炼生产，以实现公司降低亏损、实现盈利的目标。
- ②加强公司内部运营管理，提升公司运营效率。公司持续不断地提升管理水平，控制存货规模，加快存货周转速度，同时控制应收账款规模，加快公司资金周转，从多个方面采取措施提升公司运营效率。
- ③严格控制公司各项费用开支，降低公司运营成本。2014年以来公司管理费用整体下降，积极控制公司运营成本，为公司业绩扭亏为盈做出积极贡献。

- 公司按照总体经营要求，制定并落实多项保利举措，并明确了相关责任人，目前各项保利举措已分别落实责任，并加强管控、月清的过程控制办法积极推进措施落地。2014年、2015年、2016年公司分别实现净利润12,920.62万元、6,425.61万元、17,441.97万元。

（二）云南证监局于2014年12月19日向公司出具《云南证监局关于云南铜业的监管关注函》（云证监函〔2014〕186号），对公司提出如下监管要求：

- 1.监管关注函的主要内容  
2014年12月19日，云南证监局出具《云南证监局关于云南铜业的监管关注函》（云证监函〔2014〕186号），对公司提出如下监管要求：  
“一、督促控股股东履行好承诺事项。公司控股股东需严格按照所承诺的期限切实履行已公告的承诺事项。  
二、公司应对为履行承诺事项产生的重要信息及时进行信息披露，做好内幕信息管理工作，杜绝内幕交易和信息披露违规行为。  
三、公司涉及承诺履行的相关事项需严格按照法律法规和公司章程规定的程序实施。”
- 2.公司的整改措施  
针对上述监管要求，公司采取了相应的整改措施，具体如下：  
（1）关于凉山矿业和迪庆有色资产注入承诺事宜，控股股东2014年已启动了凉山矿业注入本公司的工作。在严格遵循上市公司监管制度的前提下，对凉山矿业注入一事，中国铝业公司高度重视和支持，控股股东云铜集团成立了专门的工作领导小组和办公室，在统一组织协调下，2014年起开展股东沟通、环保核查、资源储量核实、财务审计、资产评估等大量基础工作，且控股股东于2016年对凉山矿业承诺事项进行了进一步完善，已提交公司第七届董事会第六次会议、2017年第一次临时股东大会审议通过，并进行了公告，目前在以凉山州委州政府为背景的股东沟通工作以及凉山矿业的资产权属办理方面需要进一步开展工作。为尽快履行承诺，经公司第七届董事会第十二次会议、2017年第一次临时股东大会审议通过，公司拟通过本次非公开发行股票收购迪庆有色50.01%股权，以解决迪庆有色资产注入问题。

- （2）公司建立了内幕信息管理制度，严格按上市公司信息披露要求，对为履行承诺事项产生的重要信息及时进行信息披露，并做好内幕信息管理工作，杜绝内幕交易和信息性陈述或重大遗漏。

- 披露违规行为。
- （3）公司持续严格按照上市公司要求，对涉及承诺履行的相关事项，严格按照法律法规和公司章程规定的程序实施审核、审批和及时合规披露。

（三）云南证监局于2015年7月1日向公司出具《云南证监局关于对云南铜业的监管关注函》（云证监函〔2015〕140号）

- 1.监管关注函的主要内容  
2015年7月1日，云南证监局出具《云南证监局关于对云南铜业的监管关注函》（云证监函〔2015〕40号），要求公司就下列事项作出说明：  
“一、公司对主要产品毛利率的披露错误进行了更正，但利润总额、归属于母公司股东的净利润等利润指标未作更正，请公司说明毛利率披露错误是否对公司利润指标产生影响。  
二、你公司应对本次信息披露错误进行内部责任追究，请你公司对内部责任追究情况做出说明。  
三、你公司在2015年5月16日披露了更正后的2014年年度审计报告，你公司年报审计会计师事务所须对公司审计报告更正后是否影响公司利润指标作出说明，同时自查是否按照审计准则完整、恰当实施审计程序。”

- 2.公司的整改措施  
针对上述事项，公司进行了相应的整改及说明，具体如下：  
（1）公司对毛利率披露错误事项的更正仅是对收入、成本明细分类数据的更正，收入、成本总额不受影响，对公司利润指标也不产生影响。  
（2）根据《云南铜业股份有限公司年报信息披露重大差错责任追究制度》有关规定，公司董事会第六届董事会审计委员会召开了关于2014年年报更正事项专题会议，专题听取了公司年审会计师事务所关于年报更正事项原因汇报。会议总结了本次公司年报更正事项的情况，对年报更正事项的形成原因进行了分析，对定期报告提交审核流程制度存在的不足进行了梳理，并对公司下一步定期报告的披露审核工作提出了具体要求。此外，公司根据《云南铜业股份有限公司年报信息披露重大差错责任追究制度》和《云南铜业股份有限公司董事会审计委员会议事规则》的有关规定，进一步制定了公司审计委员会召开流程规定，对定期报告提交的时间节点和内容要求进行了细化。

- （3）根据公司此次年报更正事项，公司年报审计会计师事务所出具并提交了《关于云南铜业股份有限公司2014年度审计报告更正事项的专项说明》，并对此次年报实施的审计程序进行了相应自查。

- （四）深圳证券交易所于2017年6月15日向公司出具《关于对云南铜业股份有限公司的监管关注函》（公司部监管函〔2017〕第43号）

- 1.监管函的主要内容  
2017年6月15日，深圳证券交易所出具《关于对云南铜业股份有限公司的监管函》（公司部监管函〔2017〕第43号），对下列事项作出催告：  
“你公司子公司云南迪庆矿业开发有限责任公司于2016年7月23日和2016年9月6日分别收到“特色产业专项发展资金”150万元和120万元，该项政府补助占你公司2015年经审计归属于母公司所有者的净利润的910.4%，但你公司未及时履行信息披露义务，直至2017年6月15日方在对本所2016年年报问询函的回复中予以披露。  
你公司的上述行为违反了本所《股票上市规则》（2014年修订）第2.1条和第11.11.4条的规定。本所希望你公司及全体董事、监事、高级管理人员吸取教训，严格遵守《证券法》、《公司法》等法规及《上市规则》的规定，及时、真实、准确、完整地履行信息披露义务，杜绝此类事件发生。  
二、公司的整改措施  
针对上述事项，公司高度重视。针对信息披露存在的问题，公司组织相关人员针对《证券法》、《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等有关法律、法规、规章进行了学习与培训，以确保公司依照相关规定履行信息披露义务。  
除上述情况外，公司最近五年不存在其他被证券监管部门和证券交易所处罚及采取监管措施的情形。特此公告。

## 云南铜业股份有限公司 关于非公开发行股票申请文件反馈意见回复的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

云南铜业股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年10月11日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》（171581号）（以下简称“反馈意见”）。中国证监会依法对公司提交的《云南铜业股份有限公司上市公司非公开发行股票招股说明书》行政许可申请材料进行了审查，需要公司就有关问题作出书面说明和解释，并在30天内向中国证监会行政许可受理部门提交书面回复意见。

公司会同中介机构就反馈意见中提出的相关问题进行了研究和讨论，并按要求对有关问题进行了说明和答复，现根据要求对反馈意见回复进行公开披露，具体内容详见2017年12月11日公司刊登在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的《关于〈云南铜业股份有限公司非公开发行股票申请文件反馈意见〉的回复》。公司将按照要求将上述反馈意见回复材料及及时报送中国证监会。

公司本次非公开发行股票事宜尚需获得中国证监会核准，能否获得核准存在不确定性。公司将根据审核进展情况，严格按照有关规定及时履行信息披露义务。敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

云南铜业股份有限公司董事会  
2017年12月11日

## 云南铜业股份有限公司 关于非公开发行股票申请涉及补充评估相关情况的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

鉴于云南铜业股份有限公司（以下简称“公司”或“上市公司”或“云南铜业”）非公开

发行股份拟收购的标的资产云南迪庆有色金属有限责任公司（以下简称“迪庆有色”）50.01%股权定价所依据的“中同华评报字〔2016〕第966号”《资产评估报告》（以下简称“原评估报告”）评估基准日为2016年9月30日，已超过一年的有效期限。为验证标的资产自2016年9月30日以来是否发生对上市公司的不利变化，保护上市公司及全体股东的利益，公司委托北京中同华资产评估有限公司（以下简称“中同华评估”）以2017年9月30日为基准日对迪庆有色股东全部权益的价值进行了补充评估，并出具了“中同华评报字〔2017〕第1130号”《资产评估报告》（以下简称“补充评估报告”或“本次评估报告”），主要情况如下：

- 一、补充评估报告的评估结果  
本次补充评估以2017年9月30日为基准日，分别采取资产基础法和收益法进行评估，并选用资产基础法评估结果作为最终评估结果，具体结果如下：

项目	账面值	评估值	增值额	增值率
迪庆有色100%股权	187,589.36	289,025.69	101,436.34	53.74%

本次发行涉及收购迪庆有色50.01%股权，依据补充评估报告，该等股权的评估值为144,541.75万元。

- 二、评估方法、关键评估参数、评估结论等方面的主要差异、差异原因及合理性  
（一）评估方法

原评估报告与补充评估报告在评估方法上均选取资产基础法与收益法，并以资产基础法作为定价依据。两份评估报告评估方法未发生变化。

- （二）关键评估参数差异及合理性

原评估报告与补充评估报告的关键评估参数对比如下：

序号	项目	原评估报告	补充评估报告
1	金属价格	铜精矿含铜不含税价格为36,005.68元/吨，铜粗矿不含税价格为50,280.00元/吨，铜精矿含铜价格为22734.52元，铜粗矿含铜不含税价格为2,826.15元/克。	铜精矿含铜不含税价格为34,375.86元/吨，铜粗矿不含税价格为47,462.31元/吨，铜粗矿含铜价格为21533.5元，铜精矿含铜不含税价格为4,203.36元/克。
2	固定资产投资规模	依据《经济收益法分种补充说明》，按调整后的固定投资额为40,320.01万元。无形资产土地使用权按照相关企业提供预计土地费用支出为38,530.00万元。	确定资产投资调整为416,829.15万元。无形资产土地使用权按照相关企业实际发生土地费用支出为10,776.67万元。
3	原矿矿石量	该矿山处于建设期，保有资源储量矿石量27,064.13万吨。	根据《储量动用说明》，保有资源储量矿石量调整为227,418.75万吨。
4	生产负荷	根据设计，从试生产开始第一年生产负荷按64%计算，下一生产年度为78%。	从试生产开始第一年生产负荷按30%计算，下一生产年度为70%。
5	收益期限	18.18年	18.06年
6	采矿权折现率	8.17%	8.07%
7	收益法折现率	9.09%	9.22%

- 差异原因及合理性：  
①价格：价格均采用了基准日前5年的平均价格，因基准日发生变化，相应计算的前五年金属均价发生变化。

- ②固定资产投资规模：原评估报告出具时项目尚处于建设期，出于谨慎性考虑采用中国恩菲工程技术有限公司的设计报告数据，由于目前矿山建设基本完成，进入了调试阶段，相应投资额度具有辨识性，故补充评估报告以评估基准日固定资产评估值为基础，更能准确反映实际情况。因固定资产投资规模发生变化，折旧费用及财务费用相应发生变化。
- ③矿山资源量：根据企业提供的《储量动用说明》，因投料试车对矿山资源量消耗，参与本次评估的保有资源储量（111b+122b+333）矿石量进行相应调整。

- ④生产负荷：矿山已于2017年4月份进入生产调试阶段，目前生产负荷较低，考虑可能存在的不可预见生产调试等问题，适当降低了生产负荷。
- ⑤收益期限：关于收益期限的变化是由于生产调试阶段动用资源储量较少，生产负荷较低，综合计算得出收益期限略有变化。

- ⑥采矿权折现率：根据《矿业权评估参数确定指导意见》，原报告评估期间，该矿山为在建矿山，其勘查开发阶段风险报酬率取值为0.8%（取值范围0.35%~1.15%），补充评估报告根据勘查开发阶段风险报酬率取值为0.65%（生产矿山取值范围0.15%~0.65%），无风险报酬率根据基准日时点的取值分别为4.17%和4.22%，故综合计算结果为：原评估报告折现率为8.17，补充评估报告为8.07%。

- ⑦收益法折现率：无风险利率上升及公司资产负债率提高，导致迪庆有色收益法估值时折现率提高。

除上述各项变化外，其他未发生重大变化。

- （三）评估结果  
从评估结果看，补充评估报告以2017年9月30日的资产基础法评估值为289,025.69万元，该评估结果较以2016年9月30日为基准日的资产基础法评估结果287,803.04万元增值1,222.65万元，增值率为0.42%。补充评估报告以2017年9月30的收益法评估值为285,720.00万元，以2016年9月30日为基准日的收益法评估结果276,180.00万元增值9,540.00 万元，增值率为3.45%。整体看，两份评估报告评估结论差异较小，未发生不利于上市公司的重大变化。

经公司第七届董事会第十九次会议决议，鉴于本次以2017年9月30日为基准日的评估结果对拟收购的云南迪庆有色金属有限责任公司50.01%股权的价值予以验证，不改变本次交易的定价原则和基础，因此，为了保护上市公司股东利益，公司仍以2016年9月30日为基准日、经备案的评估结果作为本次交易对价。

- 三、补充评估报告的出具机构发生变更的原因（如适用）不适用。
- 四、本次交易行为、交易定价的批准程序和评估报告的核准备案程序的合法合规性  
云南铜业本次非公开发行股票涉及收购迪庆有色50.01%的股权，已履行的交易行为、交易定价批准及评估报告备案程序如下：

- （一）国务院国资委批准程序  
2017年7月17日，国务院国资委作出《关于云南铜业股份有限公司非公开发行A股股份有关问题的批复》（国资产权〔2017〕587号），原则同意发行人本次非公开发行不超过28,327.9760万股股份的方案。

- （二）中铝公司批准及评估备案程序  
1、中铝公司批准程序  
2017年5月24日，中铝公司作出《中国铝业公司关于云南铜业（集团）有限公司资本运作方案调整的通知》（中铝资字〔2017〕290号），同意对本次非公开发行方案进行调整，并同

意云铜集团将所持迪庆有色相关股权转让给云南铜业。

- 2、中铝公司评估备案程序  
2017年5月20日，中铝公司核发《国有资产评估项目备案表》，就本次交易涉及的迪庆有色相关股权转让评估结果予以备案。

- （三）云铜集团批准程序  
2016年10月26日，云铜集团召开第二届董事会第二十九次会议并作出决议，同意以其所持迪庆有色相关股权认购云南铜业非公开发行股票。

- 2017年5月17日，云铜集团召开第二届董事会第三十四次会议并作出决议，同意将所持迪庆有色相关股权转让给云南铜业。

- （四）迪庆州投批准及评估备案程序  
1、迪庆州投批准程序

- 2016年10月26日，迪庆州人民政府作出《迪庆藏族自治州人民政府关于授权股权置换工作的批复》（迪政复〔2016〕47号），批准迪庆州投以其所持迪庆有色股权认购云南铜业本次非公开发行的股票。

- 2017年7月14日，云南省国资委作出《云南省国资委关于迪庆州开发投资集团有限公司参与云南铜业股份有限公司非公开发行股票有关事宜的批复》（云国资投资〔2017〕189号），批准迪庆州投以其所持迪庆有色股权认购云南铜业本次公开发行的股票。

- 2、迪庆州投评估备案程序  
2017年5月8日，迪庆州国资委向迪庆州投核发《国有资产评估项目备案表》，就本次交易涉及的迪庆有色相关股权转让评估结果予以备案。

- （五）云南黄金批复及评估备案程序  
1、云南黄金批准程序

- 2016年10月28日，云南黄金召开2016年第八次临时股东大会并作出决议，批准云南黄金以其所持迪庆有色股权认购云南铜业本次非公开发行的股票。

- 2017年5月12日，云南地矿总公司作出《关于云铜股份收购云南黄金持有的迪庆有色股份方式变更等相关事宜的批复》（云地集团〔2017〕41号），同意云南黄金将持有的迪庆有色8.24%股权转让给云南铜业。

- 2012年6月26日，云南省财政厅作出《云南省财政厅关于省地质矿产勘查开发局下属云南黄金矿业集团股份有限公司国有产权流转有关事项的复函》（云财企〔2012〕179号），明确由云南省地质矿产勘查开发局履行监管职责，负责审批云南黄金下属公司国有资产产权变动事项。就本次非公开发行业目，2017年5月12日，云南省地质矿产勘查开发局作出《云南省地质矿产勘查开发局关于云铜股份收购云南黄金持有的迪庆有色股份方式变更等相关事宜的批复》（云地〔2017〕101号），同意云南黄金将持有的迪庆有色8.24%股权转让给云南铜业。

- 2017年5月15日，云南黄金召开2017年第二次临时股东大会并作出决议，批准云南黄金以其所持迪庆有色8.24%股权转让给云南铜业。

- 2、云南黄金评估备案程序  
2017年5月12日，云南地矿总公司作出《关于云铜股份收购云南黄金持有的迪庆有色股份方式变更等相关事宜的批复》（云地集团〔2017〕41号），同意由中铝公司完成对迪庆有色资产评估备案，履行相关批准程序。2017年5月12日，云南省地质矿产勘查开发局作出《云南省地质矿产勘查开发局关于云铜股份收购云南黄金持有的迪庆有色股份方式变更等相关事宜的批复》（云地〔2017〕101号），同意由中铝公司完成对迪庆有色资产评估备案，履行相关批准程序。

- （六）迪庆有色批准程序  
2016年10月28日，迪庆有色召开股东会，审议通过关于云铜集团、云南黄金、迪庆州投将其持有的迪庆有色股权转让给云南铜业的决议。

云南铜业本次非公开发行股票涉及收购迪庆有色50.01%股权已经公司董事会、股东大会审议通过，相关定价已由交易双方通过协议进行约定，并经国有资产主管部门批准，审批程序合法、有效；本次非公开发行推进过程中，云南铜业的股东大会决议及国资主管部门的批准文件均在有效执行过程中。鉴于中同华评估以2016年9月30日为基准日出具的评估报告有效期届满，公司委托中同华评估以2017年9月30日为评估基准日对标的资产进行了补充评估，评估值为289,025.69万元，该评估结果较以2016年9月30日为基准日的评估结果287,803.04万元增值1,222.65万元，增值率0.42%，未发生不利于上市公司及其股东的变化。经公司第七届董事会第十九次会议审议通过，鉴于本次以2017年9月30日为基准日的评估结果对拟收购的迪庆有色50.01%股权的价值予以验证，不改变本次交易的定价原则和基础，因此，为了保护上市公司股东利益，公司仍以2016年9月30日为基准日、经国资备案的评估结果作为本次交易对价，符合经公司股东大会审议通过并经有权国资管理部门批准的非公开发行方案，不存在损害云南铜业及其中小股东利益的情形。

- 五、中介机构的核查意见  
保荐机构中信建投证券股份有限公司认为：

补充评估报告与原评估报告相比，评估方法未发生变化，关键评估参数变化具有合理性，评估结果未发生不利于上市公司的重大变化，根据交易双方签署的协议及上市公司董事会决议，补充评估报告与原评估报告的评估结果存在一定差异不影响本次交易定价。本次非公开发行股票涉及收购迪庆有色50.01%股权已履行了必要的授权、批准和备案程序，程序合法、合规，不存在损害中小股东利益的情形；本次收购资产的定价已经履行了必要的批准和备案程序，相关程序合法、有效；评估机构对标的资产进行了补充评估验证，评估验证结果未发生重大不利变化，不会对本次发行产生重大不利影响。

发行人律师国浩律师（北京）事务所认为：本次非公开发行股票涉及收购迪庆有色50.01%股权已履行了必要的授权、批准和备案程序，程序合法、合规，不存在损害中小股东利益的情形；本次收购资产的定价已经履行了必要的批准和备案程序，相关程序合法、有效；评估机构对标的资产进行了补充评估验证，评估验证结果未发生重大不利变化，不会对本次发行产生重大不利影响。

特此公告。

附件：中同华评报字〔2017〕第1130号《资产评估报告书》

云南铜业股份有限公司董事会  
2017年12月11日

## 方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金 办理定期份额折算业务的公告

根据《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金合同》（简称“基金合同”）的相关规定，方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将以 2017年12月15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个会计年度的12月15日（遇节假日顺延）。本次定期份额折算基准日为2017年12月15日。

- 二、基金份额折算对象  
基金份额折算基准日登记在册的方正富邦中证保险A份额（场内简称：保险 A，基金代码：150329）、方正富邦中证保险份额（方正富邦中证保险份额的场外份额和场内份额的合计，基金代码：167301）。

- 三、基金份额折算方式  
根据基金合同的规定，方正富邦中证保险A份额和方正富邦中证保险 B 份额按照本基金基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算，对方正富邦中证保险A份额的约定应得收益进行定期份额折算，每2份方正富邦中证保险份额将按1份方正富邦中证保险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，方正富邦中证保险A份额和方正富邦中证保险B份额的份额配比保持 1:1 的比例。

对于方正富邦中证保险A份额期末的约定应得收益，即方正富邦中证保险 A 份额每个会计年度基金份额折算基准日的份额净值超出1.000元部分，将折算为场内方正富邦中证保险份额分配给持有人。场内方正富邦中证保险份额持有人持有的每2份方正富邦中证保险份额将按1份方正富邦中证保险A份额获得新增场内方正富邦中证保险份额的分配。场外方正富邦中证保险份额的基金份额持有人持有的每2份方正富邦中证保险份额将按1份方正富邦中证保险A份额获得新增场外方正富邦中证保险份额的分配。经上述份额折算，方正富邦中证保险A份额的参考净值和方正富邦中证保险份额的基金份额净值将相应调整。

方正富邦中证保险A份额本年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

1.方正富邦中证保险A份额  
定期份额折算后方正富邦中证保险A份额的份额数 = 定期份额折算前方正富邦中证保险A份额的份额数

$N_{A1} = \frac{N_{A0} \times (1 + \frac{R_{A0}}{N_{A0}})}{N_{A0} + \frac{R_{A0}}{N_{A0}}}$
$N_{B1} = \frac{N_{B0} \times (1 + \frac{R_{A0}}{N_{A0}})}{N_{B0} + \frac{R_{A0}}{N_{A0}}}$
$R_{A0} = (N_{A0} - 2) \times (N_{A0} - 1)$
$R_{B0} = (N_{B0} - 2) \times (N_{B0} - 1)$
$N_{A0}$ 为方正富邦中证保险A份额折算前的份额数
$N_{B0}$ 为方正富邦中证保险B份额折算前的份额数
$R_{A0}$ 为方正富邦中证保险A份额折算前的约定应得收益
$R_{B0}$ 为方正富邦中证保险B份额折算前的约定应得收益
$N_{A1}$ 为方正富邦中证保险A份额折算后的份额数
$N_{B1}$ 为方正富邦中证保险B份额折算后的份额数

## 关于增加国海证券股份有限公司为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告

根据宝盈基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与国海证券股份有限公司（以下简称“国海证券”）签署的销售服务协议，自公告之日起，本公司增加国海证券为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：宝盈消费主题混合，基金代码：003715）的代销机构，投资人可在国海证券办理本公司基金开户业务及上述基金的申购等业务，进行相关信息查询并享受相应的售后服务。投资人在国海证券办理上述业务应遵循其具体规定。

- 投资人可通过以下途径咨询有关详情：  
1、宝盈基金管理有限公司  
网站：www.bytunds.com  
客户服务热线：400—8888—300（免长途话费）

- 2、国海证券股份有限公司  
网站：www.ghzq.com.cn  
客户服务热线：95563  
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。投资人投资于本公司旗下开放式基金前应认真阅读相关基金合同、招募说明书。敬请投资人注意投资风险。本公司保留对该公告的最终解释权。  
特此公告。

宝盈基金管理有限公司  
2017年12月12日

注册地址：北京市西城区金融大街5号、5号A6 层5号 601、15号7 层5号 701、15号8 层5号 801、15号9 层5号 901  
办公地址：北京市西城区金融大街5号 国新大厦A座 6—9 层  
法定代表人：刘希涛  
联系人：郭希华  
电话：010—66565218  
传真：010—66563111  
客户服务热线：400—811—9999  
网站：www.igobos.com.cn  
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，购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读该基金的基金合同、更新的招募说明书等法律文件，并选择适合自身风险承受能力投资品种进行投资。

工银瑞信基金管理有限公司  
2017年12月2日