

# 关于以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金

## 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

融通基金管理有限公司已于 2020 年 9 月 30 日在融通基金管理有限公司网站（www.rtfund.com）、《证券时报》发布了《关于以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布《关于以通讯方式召开融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。

### 一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等法律法规的规定和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人融通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2020 年 10 月 23 日起至 2020 年 10 月 29 日 17:00 止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）

基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄送达至以下地址的下述收件人。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：融通基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区太平桥大街 84 号丰汇时代大厦东翼 5 层 502-507 房间

邮政编码：100032

联系人：周新欣

联系电话：010-66190961

请在信封表面注明：“融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

- 4、电话投票仅适用于个人投资者，电话投票按本公告规定的方式提交。
- 5、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-883-8088 咨询。

## 二、会议审议事项

《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明及基金合同的修订内容详见《融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）。

## 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 10 月 23 日，即 2020 年 10 月 23 日下午交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

## 四、表决票的填写和寄交方式

### （一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议纸质表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（[www.rtfund.com](http://www.rtfund.com)）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

- （1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；
- （2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(4) 个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(5) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(6) 合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(7) 以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的授权委托书等相关文件在2020年10月23日起，至2020年10月29日17:00止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址的下述收件人：

收件人：融通基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区太平桥大街84号丰汇时代大厦东翼5层502-507房间

邮政编码：100032

联系人：周新欣

联系电话：010-66190961

请在信封表面注明：“融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

**(二) 电话投票（仅适用于个人基金份额持有人）**

1、基金份额持有人可拨打基金管理人的客户服务电话（400-883-8088）后按提示转人工坐席，并在基金管理人客户服务中心以回答提问的方式核实基金份额持有人身份后，在电话中对本次大会议案进行表决。

基金管理人客户服务人员也可通过客户服务电话（400-883-8088）主动与基金份额持有人取得联系，并在以回答提问的方式核实基金份额持有人身份后，由基金份额持有人在电话中对本次大会议案进行表决。

2、通过电话投票方式参与表决的起止时间：自 2020 年 10 月 23 日起，至 2020 年 10 月 29 日 17:00 止，表决时间以本基金管理人电话系统记录为准。

3、为保护基金份额持有人利益，上述整个通话过程将被录音。

（三）投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话（400-883-8088）咨询。

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下于 2020 年 10 月 30 日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额享有一票表决权。

3、纸质表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1) 送达时间不是同一天的, 以最后送达的填写有效的表决票为准, 先送达的表决票视为被撤回;

2) 送达时间为同一天的, 视为在同一表决票上作出了不同表决意见, 视为弃权表决票, 但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数;

3) 送达时间按如下原则确定: 专人送达的以实际递交时间为准, 邮寄的以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准。

4、电话投票方式的效力认定如下:

(1) 基金份额持有人通过电话投票方式参与表决, 能够核实身份且有明确表决意见的, 为有效表决, 有效表决按表决意见计入相应的表决结果, 其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数; 能够核实身份但未发表表决意见、表决意见矛盾或不明的, 视为投弃权表决, 计入有效表决, 并按“弃权”计入对应的表决结果, 其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 基金份额持有人通过电话投票方式参与表决, 若基金管理人客户服务人员无法核实其身份的, 为无效表决; 无效表决不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 基金份额持有人多次通过电话表决方式参与投票的, 以基金管理人在电话表决截止时间前最后一次记录的基金份额持有人表决意见为准, 先前的表决意见视为被撤回。

5、如果同一基金份额同时存在有效的电话投票表决意见和有效的纸质投票表决意见的, 不论表决时间先后, 均以有效的纸质投票表决意见为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的, 有效的融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额各自基金份额不小于在权益登记日对应级别基金总份额的二分之一 (含二分之一), 则本次通讯开会视为有效;

2、《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》应当经参加大会的融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上 (含三分之二) 通过, 则视为表决通过, 形成的大会决议有效;

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项自表决通过之日起生效, 本基金管理人自决议通过之日起五日内报中国证监会备案。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要有效表决票所代表的融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额各自基金份额占权益登记日对应级别基金总份额的二分之一（含二分之一）以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《基金法》的规定，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：融通基金管理有限公司

联系地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

联系电话：0755-26948088

客户服务电话：400-883-8088

网址：[www.rtfund.com](http://www.rtfund.com)

邮政编码：518053

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：北京市中信公证处

地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通金融中心四层

联系方式：010- 81136530

联系人：王雪

邮政编码：100037

4、见证律师事务所：北京兰台律师事务所

## 九、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成对本基金的

整改，取消分级运作机制，将融通军工 A 份额、融通军工 B 份额按照基金份额参考净值折算为融通军工份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、上述基金份额持有人大会有关公告可通过融通基金管理有限公司网站查阅，投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-883-8088 咨询。

4、根据基金合同的约定，本次召开基金份额持有人大会的费用（公证费及律师费）将由本基金基金财产支付，具体金额将在基金份额持有人大会决议生效公告中说明。

5、关于本次议案的说明见附件四《融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

6、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额将于基金份额持有人大会计票日（2020 年 10 月 30 日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告发布日上午 10:30 止（如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市起复牌）。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

7、本公告的有关内容由融通基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》

附件二：《融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案说明书》

融通基金管理有限公司

二〇二〇年十月九日

附件一：

## 关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同 有关事项的议案

融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为了更好地满足广大投资者的需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对融通中证军工指数分级证券投资基金实施转型。融通中证军工指数分级证券投资基金实施转型的具体方案详见附件四《融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

为实施融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次融通中证军工指数分级证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定基金转型各项工作的具体时间和方式，并根据现时有效的法律法规的要求、《融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案说明书》的有关内容，对《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》进行修改和补充，并实施转型。

以上议案，请予审议。

融通基金管理有限公司

二〇二〇年九月三十日



附件二：

## 融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额

### 持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名或名称：

基金份额持有人证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：

基金账户号/证券账户号：

受托人（代理人）姓名或名称：

受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：

持有基金份额类别： 融通军工份额     融通军工 A 份额     融通军工 B 份额

审议事项	同意	反对	弃权
关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型 并修改基金合同有关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章

2020 年月日

说明：

- 1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。
- 2、表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”

计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达指定联系地址的,均为无效表决票。

3、同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户/证券账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账户号/证券账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

附件三：

## 授权委托书（样本）

兹全权委托            先生 / 女士或            机构代表本人(或本机构)

参加投票截止日为 2020 年 10 月 29 日的以通讯方式召开的融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自本授权委托书签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

若融通中证军工指数分级证券投资基金在规定时间内重新召开审议相同议案的份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照号或统一社会信用代码：

基金账户号/证券账户号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）身份证件号或营业执照号或统一社会信用代码：

委托日期：2020 年月日

附注：

1、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户/证券账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号/证券账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，以上授权将被视为是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额向受托人（代理人）所做授权。

附件四：

## 融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案说明书

### 一、声明

1、为了更好地满足广大投资者的需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人（融通基金管理有限公司）经与基金托管人（中国建设银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》。

2、《关于融通中证军工指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》应当经参加大会的融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。中国证监会对融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

### 二、融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案概要

融通中证军工指数分级证券投资基金转型方案的主要内容如下：

#### （一）更名

基金名称由“融通中证军工指数分级证券投资基金”更名为“融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）”（以下简称“融通中证云计算与大数据主题指数”）。

#### （二）取消分级运作机制

融通中证军工指数分级证券投资基金取消分级运作机制。在基金份额持有人大会审议通过后，融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额将根据转型方案的约定全部转换为融通中证云计算与大数据主题指数份额，因而也不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制。

#### （三）基金份额的终止上市

本基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持有人大会决

议生效后,按照深圳证券交易所的业务规则申请融通军工 A 份额、融通军工 B 份额终止上市。

#### (四) 转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后,融通中证军工指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于 20 个交易日的选择期,以供基金份额持有人做出选择(如赎回、转换转出或者卖出),具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

基金份额持有人在融通中证军工指数分级证券投资基金正式实施转型前的赎回选择期内,可选择卖出融通军工 A 份额、融通军工 B 份额或赎回、转换转出融通军工份额。

对于在选择期内未作出上述选择的基金份额持有人,其持有的场内融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额将转换为融通中证云计算与大数据主题指数场内份额;场外融通军工份额将转换为融通中证云计算与大数据主题指数场外份额。

在选择期期间,由于需应对赎回、转换转出等情况,基金管理人将提请基金份额持有人大会审议在选择期内豁免融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例等限制,并授权基金管理人据此落实相关事项及可根据实际情况做相应调整,如可暂停融通中证军工指数分级证券投资基金的申购、赎回、日常转换或调整申购、赎回、日常转换的方式及限额等。

#### (五) 基金份额的转换和份额变更登记

基金管理人将于选择期届满后对投资者未赎回或转换转出的融通军工份额以及持有的融通军工 A 份额、融通军工 B 份额进行基金份额转换和份额变更登记,将融通中证军工指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成相应的融通中证云计算与大数据主题指数份额(具体以基金管理人届时公告为准)。

1、在基金份额转换基准日日终,以融通军工份额的基金份额净值为基准,融通军工 A 份额、融通军工 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成融通军工份额的场内份额。融通军工 A 份额(或融通军工 B 份额)基金份额持有人持有的转换后融通军工份额的场内份额数取整计算(最小单位为 1 份),取整后的余额计入基金财产。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基金资产净值减小的风险,对于持有份额数较少的融通军工 A 份额、融通军工 B 份额持有人,将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金财产的风险。

份额转换计算公式如下:

融通军工 A 份额(或融通军工 B 份额)的转换比例=份额转换基准日融通军工 A 份额(或融通军工 B 份额)的基金份额参考净值/份额转换基准日融通军工份额的基金份额净值

融通军工 A 份额（或融通军工 B 份额）基金份额持有人持有的转换后融通军工份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前融通军工 A 份额（或融通军工 B 份额）的份额数×融通军工 A 份额（或融通军工 B 份额）的转换比例

2、本基金管理人将基于上述转换结果，向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请，融通军工份额的场内份额、场外份额分别变更登记为融通中证云计算与大数据主题指数的场内份额、场外份额，变更后的基金份额净值保持不变。原场外份额结转后的基金份额数，保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，原场内份额结转而来的基金份额数保留至整数位，由此产生的计算误差归入基金资产。

#### （六）基金合同的生效

融通中证军工指数分级证券投资基金基金份额转换完成后，《融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

### 三、转型后“融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）”概要

#### （一）基金类别

股票型证券投资基金

#### （二）运作方式

上市契约型开放式

#### （三）存续期限

不定期

#### （四）基金的投资

##### 1、投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证云计算与大数据主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

##### 2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、

同业存单、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资标的指数成份股和备选成份股不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

### 3、投资策略

本基金采用完全复制法进行投资,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为导致成份股的构成及权重发生变化时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,力求降低跟踪误差。

本基金力争将基金份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。

#### (1) 股票投资策略

##### 1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合研究分析,对基金财产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

##### 2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,



本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等变化,对其进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。

#### ①定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

#### ②不定期调整

根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整;

根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

#### (2) 债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

#### (3) 资产支持证券投资策略

基金管理人本着风险可控和优化组合风险收益的原则,投资于资产支持证券,以期获得稳定的收益。坚持价值投资理念,综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素,制定相应的资产支持证券投资计划。根据信用风险、利率风险和流动性风险变化,把握市场交易机会,积极调整投资策略。

#### (4) 权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

#### (5) 金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 4、业绩比较基准

95%×中证云计算与大数据主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)。

#### 5、风险收益特征

本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

#### (五) 收益分配原则

本基金的收益分配应遵循下列原则:

1、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

3、每一基金份额享有同等分配权;如本基金在未来条件成熟时,增减基金份额类别,则同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### (六) 基金的费用

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据

不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。指数许可使用费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年指数许可使用费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 5 万元（大写：伍万元整），计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 4、申购费用

本基金的申购费率由基金管理人决定，基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资人申购本基金份额时，需交纳申购费用，费率按申购金额递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

### （1）场外申购费率

本基金对申购设置级差费率，客户场外申购基金份额的具体费率如下表：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.60%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%
M ≥ 500 万元	单笔 1000 元

基金管理人可以对养老金客户开展申购费率优惠活动，届时将提前公告。

## (2) 场内申购费率

场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

## 5、赎回费用

投资者在场内或场外赎回本基金份额时需交纳赎回费。

本基金的场内赎回费率如下：

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

本基金的场外赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，客户赎回的具体费率如下：

持有期限 (T)	赎回费率
T < 7 日	1.5%
7 日 ≤ T < 1 年	0.50%
1 年 ≤ T < 2 年	0.25%
T ≥ 2 年	0

注：1 年指 365 天

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

对持续持有期限少于 7 日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期限不少于 7 日基金份额持有人，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

基金管理人可以对养老金客户开展赎回费率优惠活动，届时将提前公告。

#### 四、基金转型的可行性

##### 1、基金转型不存在法律障碍

依据《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《基金法》的规定，转换基金运作方式应当经参加大会的融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。按照基金份额持有人大会的决议，并经中国证监会备案，基金可以转换基金运作方式。因此，融通中证军工指数分级证券投资基金转型不存在法律障碍。

##### 2、调整投资目标、投资范围和投资策略的可行性

融通中证军工指数分级证券投资基金转型之后，必须对原有基金合同中的有关内容进行修订，使其在投资目标、投资范围及其投资组合比例限制、投资策略等方面符合法律法规的规定。基金管理人已对基金转型后的运作进行了充分分析，转型后基金采用指数化投资方法，按照跟踪指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。基金管理人在指数投资方面有丰富的经验，投资方面具有较好的可行性。

##### 3、基金转型运作方面的可行性

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人已就基金转型有关的会计处理、登记、系统准备方面进行了深入研究，经与基金托管人的沟通和协作，做好了基金转型的相关准备。本次基金转型不存在技术方面的障碍。

#### 五、基金转型的主要风险及预备措施

##### （一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次份额持有人大会需要本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，有效的融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额各自基金份额不小于在权益登记日对应级别基金总份额的二分之一（含二分之一）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

##### （二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开

时间。

### （三）基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金将尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。

## 六、基金合同修改内容

融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同的具体修改内容请参见本基金管理人网站([www.rtfund.com](http://www.rtfund.com))公布的《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同修订对照表》。