

# 融通中证军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《融通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）关于不定期份额折算的相关规定，当融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称本基金）之融通军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下时，本基金融通军工份额（场内简称：融通军工，基础份额，基金代码：161628）、融通军工 A 份额（场内简称：军工股 A，基金代码：150335）、融通军工 B 份额（场内简称：军工股 B，基金代码：150336）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2017 年 8 月 2 日，军工股 B 的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，因此本基金管理人敬请投资者密切关注军工股 B 近期的基金份额参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

- 一、由于军工股 A、军工股 B 折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，军工股 A、军工股 B 的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。
- 二、军工股 B 表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。
- 三、由于触发折算阈值当日，军工股 B 的基金份额参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日军工股 B 的基金份额参考净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。
- 四、军工股 A 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军工股 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征军工股 A 变为同时持有较低风险收益特征军工股 A 与较高风险收益特征融通军工份额的情况，因此军工股 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

- 一、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，持有极小数量融通军工份额、军工股 A、军工股 B 的份额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。
- 二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停军工股 A 与军工股 B 的上市交易和融通军工份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。  
投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《融通中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称招募说明书)或者拨打本公司客服电话:400-883-8088(免长途话费)。
- 三、本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。

特此公告。

融通基金管理有限公司

2017 年 8 月 3 日