

## 融通中证军工指数分级证券投资基金不定期份额折算公告

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，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2017 年 12 月 5 日，本基金融通军工 B 份额的基金份额参考净值为 0.243 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2017 年 12 月 6 日为基金份额折算基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2017 年 12 月 6 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的融通军工份额（基金简称：融通军工分级，场内简称：融通军工，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）。

### 三、基金份额折算方式

融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额按照《基金合同》第二十一部分基金份额折算约定的规则进行不定期份额折算。

当融通军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对融通军工 A 份额、融通军工 B 份额和融通军工份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通军工份额的基金份额净值、融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。融通军工份额、融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的份额数将相应缩减。

#### （1）融通军工 B 份额

份额折算前后融通军工 B 份额所对应的基金资产净值不变，即

- ：折算前融通军工 B 份额的份额数；
- ：折算前融通军工 B 份额的基金份额参考净值；
- ：折算后融通军工 B 份额的份额数。

#### （2）融通军工 A 份额

份额折算后融通军工 A 份额与融通军工 B 份额的份额配比保持 1:1 不变，即

- ：折算后融通军工 A 份额的份额数；
- ：折算后融通军工 B 份额的份额数。

份额折算前融通军工 A 份额持有人在份额折算后将持有融通军工 A 份额与新增场内融通军工份额，且对应的基金资产净值不变。

融通军工 A 份额持有人新增的场内融通军工份额的份额数为：

=

- ：折算前融通军工 A 份额的份额数；
- ：折算后融通军工 A 份额的份额数；
- ：折算前融通军工 A 份额的基金份额参考净值；
- ：折算后融通军工 A 份额持有人新增的场内融通军工份额的份额数。

#### （3）融通军工份额

融通军工份额持有人份额折算前后所持有的融通军工份额的资产净值不变。

- ：折算前融通军工份额的基金份额净值；
- ：折算前融通军工份额的份额数；
- ：折算后融通军工份额的份额数；

折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

#### 四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，融通军工份额的基金份额净值、融通军工 A 份额与融通军工 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，融通军工份额的基金份额净值、融通军工 A 份额与融通军工 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

基金份额 折算前 折算后

份额净值/份额参考净值 份额数 份额净值/份额参考净值 份额数

融通军工份额 0.626 元 10,000 份 1.000 元 6,260 份融通军工份额

融通军工 A 份额 1.011 元 10,000 份 1.000 元 2,410 份融通军工 A 份额+7,700 份融通军工份额

融通军工 B 份额 0.241 元 10,000 份 1.000 元 2,410 份融通军工 B 份额

#### 五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2017 年 12 月 6 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管，下同）及配对转换业务。军工股 A、军工股 B 将于 2017 年 12 月 6 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2017 年 12 月 6 日上午 10:30 复牌。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。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2017 年 12 月 7 日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管及配对转换业务，军工股 A、军工股 B 暂停交易。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。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2017 年 12 月 8 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，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管及配对转换业务，军工股 A、军工股 B 正常交易。

4、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》，2017 年 12 月 8 日军工股 A、军工股 B 即时行情显示的前收盘价为 2017 年 12 月 7 日的融通军工 A 份额、融通军工 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），2017 年 12 月 8 日当日军工股 A 和军工股 B 均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、军工股 A、军工股 B 将于 2017 年 12 月 6 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2017 年 12 月 6 日上午 10:30 复牌。军工股 A、军工股 B 将于 2017 年 12 月 7 日全天停牌，2017 年 12 月 8 日上午开市复牌。

2、2017 年 12 月 5 日，军工股 B 份额的基金份额参考净值已低至 0.250 元以下，而折算基准日为 2017 年 12 月 6 日，因此折算基准日军工股 B 的基金份额参考净值与折算条件 0.250 元可能有一定差异。

3、特别提示：近日军工股 B 二级市场交易价格溢价较大，在不定期份额折算后，军工股 B 的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军工股 B 高溢价交易所带来的风险。

4、军工股 A 表现为低风险、预期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的军工股 A 变为同时持有较低风险收益特征的军工股 A 与较高风险收益特征的融通军工份额，因此原军工股 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，融通军工份额为跟踪中证军工价格指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原军工股 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、军工股 B 表现为较高风险、较高收益预期的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，恢复到初始的 2 倍杠杆水平，相应地，军工股 B 份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、原军工股 A 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内融通军工份额分拆为军工股 A、军工股 B。

7、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则，军工股 A、军

工股 B、融通军工份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产；融通军工份额的场外份额折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。因此，在不定期份额折算过程中，由于尾差处理，可能使持有人的资产净值出现微小误差，但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

8、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买军工股 A，在不定期份额折算后，则折算新增的融通军工份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将军工股 A 卖出，或者在折算后将新增的融通军工份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请登陆本公司网站：[www.rtfund.com](http://www.rtfund.com) 或者拨打本公司客服电话：400-883-8088（免长途电话费）、0755-26848088。

#### 七、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资有风险，敬请投资者在投资基金前认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

融通基金管理有限公司

二〇一七年十二月六日