

融通基金管理有限公司

关于融通中证军工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《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”）的约定，融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）将以 2019 年 12 月 13 日为基金份额折算基准日办理融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的约定，基金份额折算基准日为每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日）。本次定期份额折算基准日为 2019 年 12 月 13 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 A 份额（基金代码：150335，基金场内简称：军工股 A）和融通军工份额（基金代码：161628，基金场内简称：融通军工）。

三、基金份额折算方式

根据基金合同的规定，在折算基准日，定期份额折算后融通军工 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前融通军工 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为融通军工份额的场内份额分配给融通军工 A 份额持有人。融通军工份额持有人持有的每两份融通军工份额将按一份融通军工 A 份额获得新增融通军工份额的分配，经过上述份额折算后，融通军工份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，融通军工 A 份额和融通军工 B 份额（基金代码：150336，基金场内简称：军工股 B）的份额配比保持 1:1 的比例。

有关计算公式如下：

（1）融通军工份额

$$NAV_{后} = \frac{\text{折算前融通军工份额的资产净值} - 0.5 \times (NAV_A^{前} - 1.000) \times NUM_{前}}{NUM_{前}}$$

$$\text{融通军工份额持有人新增的融通军工份额} = \frac{NUM_{前}}{2} \times \frac{NAV_A^{前} - 1.000}{NAV_{后}}$$

其中：

NUM_前：折算前融通军工份额的份额数，下同

NAV_前：折算前融通军工份额的基金份额净值，下同

NAV_后：折算后融通军工份额的基金份额净值，下同

NAV_{A前}：折算前融通军工 A 份额的基金份额参考净值，下同

持有场外融通军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外融通军工份额的分配；持有场内融通军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内融通军工份额的分配。

(2) 融通军工 A 份额

定期份额折算后融通军工 A 份额的基金份额参考净值= 1.000 元

定期份额折算后融通军工 A 份额的份额数=定期份额折算前融通军工 A 份额的份额数

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

$$= \frac{NUM_A^{前} \times (NAV_A^{前} - 1.000)}{NAV_{后}}$$

其中：

NUM_{A前}：折算前融通军工 A 份额的份额数，下同

(3) 融通军工 B 份额

定期份额折算不改变融通军工 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(4) 折算后的融通军工份额总份额数

折算后融通军工份额的总份额数=折算前融通军工份额的份额数+融通军工份额持有人新增的融通军工份额的份额数+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。

四、折算份额数的处理方式

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。

五、份额折算期间的业务办理

（一）定期份额折算基准日（即 2019 年 12 月 13 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管，下同）及配对转换业务；融通军工 A 份额正常交易。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。融通军工 B 份额在整个折算期间交易正常进行。

（二）定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2019 年 12 月 16 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务，融通军工 A 份额暂停交易。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。

（三）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2019 年 12 月 17 日），基金管理人将公告份额折算结果，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、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管（场内转场外））及配对转换业务，融通军工 A 份额自 2019 年 12 月 17 日上午开市起恢复交易。

六、重要提示

（一）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》，2019 年 12 月 17 日融通军工 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2019 年 12 月 16 日的融通军工 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于融通军工 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除约定收益后与 2019 年 12 月 17 日的前收盘价可能有较大差异，因此 2019 年 12 月 17 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）本金融通军工 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内融通军工份额分配给融通军工 A 份额的持有人，而融通军工份额为跟踪中证军工指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此融通军工 A 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遭受损失的风险。

（三）由于融通军工 A 份额经折算产生的新增场内融通军工份额数和场内融通军工份额经折算后的新增场内融通军工份额数将取整计算（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 A 份额或场内融通军工份额的持有人存在无法获得新增场内融通军工份额的可能性。

（四）投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：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

二〇一九年十二月十日