融通中证军工指数分级证券投资基金之军工股A和军工股B上市交易公告书

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点： 深圳证券交易所
上市时间： 2015年7月13日
公告日期： 2015年7月8日

一、重要声明与提示

《融通中证军工指数分级证券投资基金之军工股A和军工股B上市交易公告书》（以下简称"本公告书"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）和深圳证券交易所（以下简称"深交所"）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在在2015年6月15日的《证券时报》和2015年6月15日的《上海证券报》及融通基金管理有限公司网站（www.rtfund.com）上公告的《融通中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：融通中证军工指数分级证券投资基金

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、本基金的基金份额包括融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：融通军工，基金代码：161628）、融通中证军工指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（场内简称：军工股A，基金代码：150335）、融通中证军工指数分级证券投资基金之积极收益类份额（场内简称：军工股B，基金代码：150336）。其中，军工股A、军工股B的基金份额配比始终保持1：1的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。军工股A与军工股B只上市交易，不接受申购和赎回。

7、融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额的跨系统转托管：通过场内、场外方式认购本基金的基金份额持有人可以通过认购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。

8、份额配对转换是指融通军工份额与军工股A份额、军工股B份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的场内融通军工份额按照2份场内融通军工份额对应1份军工股A份额与1份军工股B份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的军工股A份额与军工股B份额按照1份军工股A份额与1份军工股B份额对应2份场内融通军工份额的比例进行转换的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、定期份额折算

定期折算基准日为本基金存续期内每年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）；若在定期份额折算基准日前30个工作日内（含第30个工作日）因军工股B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下而发生过不定期份额折算，则基金管理人有权根据实际情况决定是否进行定期份额折算。，具体详见基金管理人届时发布的公告。

在基金份额折算前与折算后，军工股A份额与军工股B份额的份额配比保持1:1的比例。在折算基准日，定期份额折算后军工股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军工股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军工股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军工股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。

10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当融通军工份额的基金份额净值高至1.500元或以上；当军工股B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下，由基金管理人确定的基金份额折算日进行不定期份额折算。

当融通军工份额的基金份额净值高至1.500元或以上，本基金将分别对军工股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军工股A份额和军工股B份额的比例为1:1，份额折算后军工股B份额的基金份额参考净值和融通军工份额的基金份额净值超过军工股A份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的融通军工份额。份额折算后融通军工份额的基金份额净值、军工股B份额的基金份额参考净值与折算基准日军工股A份额的基金份额参考净值三者相等。

当军工股B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下，本基金将分别对军工股A份额、军工股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军工股A份额和军工股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、军工股A份额和军工股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、军工股A份额和军工股B份额的份额数将相应缩减。

11、基金份额总额：截止2015年7月6日，本基金的基金份额总额为【370,677,558.08】份，其中，融通军工份额【173,705,634.08】份，军工股A份额为【98,485,962.00】份，军工股B份额为【98,485,962.00】份。

12、基金份额参考净值：截止2015年7月6日，融通军工份额的基金份额净值为【1.000】元，军工股A份额的基金份额参考净值为【1.001】元，军工股B份额的基金份额参考净值为【0.999】元。

13、本次上市交易的基金份额简称：军工股A，基金代码：150335；军工股B，基金代码：150336。

14、本次上市交易的基金份额总额：军工股A【98,485,962.00】份，军工股B【98,485,962.00】份（截止2015 年7月6日）。

15、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

16、上市交易日期：2015年7月13日

17、基金管理人：融通基金管理有限公司

18、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

19、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前的募集

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1151号

2、基金运作方式：契约型

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：自2015年6月18日起至2015年6月24日止

5、发售价格：1.000元人民币

6、发售方式：交易所（场内）和柜台（场外）

7、发售机构：

（1）场外销售机构：

1）直销机构：融通基金管理有限公司直销中心

2）银行销售机构：中国建设银行股份有限公司、上海银行股份有限公司；

3）券商销售机构：国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、新时代证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、上海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司等。

上述排名不分先后。

4）第三方销售机构：天相投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、北京展恒基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司等。

（2）场内销售机构：

场内代销机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

尚未取得基金销售资格，但属于深交所会员的其他机构，可在本基金上市交易后，代理投资人通过深交所交易系统参与本基金的上市交易。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况：本次募集的净认购金额为370,629,296.14元人民币，认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计48,261.94人民币，按照本基金基金合同和招募说明书的约定，折算为基金份额48,261.94份，计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有；

本次募集有效认购总户数为4,430户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计370,677,558.08份，场外认购的基金份额为173,705,634.08份(含募集期利息结转的份额)，场内认购的基金份额为196,971,924.00份(含募集期利息结转的份额)。其中本基金管理人基金从业人员认购持有的基金份额总额为29,875.10份(含募集期利息结转的份额)，占本基金总份额的比例为0.008%；本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人认购本基金份额总量的数量区间为0；本基金基金经理认购本基金份额总量的数量区间为0。

募集资金已于2015年6月29日划入本基金在基金托管人处开立的基金托管专户。

10、本基金募集备案情况：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》等相关法律、法规的规定以及《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"）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，融通基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年7月1日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2015年7月1日

12、基金合同生效日的基金份额总额：【370,677,558.08】份。

（二）基金上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]【337】号

2、上市交易日期：2015年7月13日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基础份额简称及代码：融通军工份额，场内简称：融通军工，基金代码：161628。

上市交易份额简称及代码：军工股A，基金代码：150335；军工股B，基金代码：150336。

5、本次上市交易份额：军工股A【98,485,962.00】份；军工股B【98,485,962.00】份（截止2015 年7月6日）。

6、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统"市盈率Ⅰ"揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

7、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的融通军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为军工股A份额和军工股B份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为军工股A份额和军工股B份额即可上市流通。

8、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015年7月13日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2015年7月6日的场内基金份额持有情况：

截至 2015 年7 月 6 日，融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额的持有人总户数为3,944户，其中场外持有人总户数为3,944户；军工股A持有人总户数为485户，全部为场内持有人；军工股B持有人总户数为485户，全部为场内持有人；融通军工份额平均每户持有的场外基金份额为44,043.01份，军工股A平均每户持有的场内基金份额为 202,646.00份，军工股B平均每户持有的场内基金份额为202,646.00份。

（二）场内基金份额持有人结构

军工股A：场内机构投资者持有的基金份额24,924,502.00份，占比25.3077%；场内个人投资者持有的基金份额73,561,460.00份，占比74.6923%。

军工股B：场内机构投资者持有的基金份额24,924,501.00份，占比25. 3077%；场内个人投资者持有的基金份额73,561,461.00份，占比74.6923%。

（三）截止2015年7月6日，本次上市交易的军工股A份额和军工股B份额前十名持有人情况：

1、基金简称：军工股A 基金代码：150335

序号	持有人名称（全称）	持有军工股A份额	占军工股A份额比(%)
1	蓝帆集团股份有限公司	11,500,447.00	11.68
2	李怡名	10,000,388.00	10.15
3	梁惠荃	10,000,388.00	10.15
4	中国银河证券股份有限公司	3,500,170.00	3.55
5	光大证券股份有限公司	3,000,117.00	3.05
6	淄博九圣化工有限公司	2,860,111.00	2.9
7	白巍	2,500,243.00	2.54
8	富安达基金-海通证券-富安达-东海恒信6期资产管理计划	2,500,097.00	2.54
9	王连复	2,148,583.00	2.18
10	马铁隽	1,500,072.00	1.52
	合计	49,510,616.00	50.27

2、基金简称：军工股B 基金代码：150336

序号	持有人名称（全称）	持有军工股B份额	占军工股B份额比(%)
1	蓝帆集团股份有限公司	11,500,447.00	11.68
2	李怡名	10,000,389.00	10.15
3	梁惠荃	10,000,389.00	10.15
4	中国银河证券股份有限公司	3,500,170.00	3.55
5	光大证券股份有限公司	3,000,116.00	3.05
6	淄博九圣化工有限公司	2,860,111.00	2.9
7	白巍	2,500,243.00	2.54
8	富安达基金-海通证券-富安达-东海恒信6期资产管理计划	2,500,097.00	2.54
9	王连复	2,148,583.00	2.18
10	马铁隽	1,500,073.00	1.52
	合计	49,510,618.00	50.27

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：融通基金管理有限公司

2、法定代表人：田德军

3、总经理：孟朝霞

4、注册资本：1.25亿元人民币

5、注册地址：广东省深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

6、设立批准文号：中国证监会证监基字[2011]8号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301501118251

8、经营范围：发起设立基金；基金管理业务（具体经营业务按证监会颁发的经营许可证办理）

9、成立日期：2001年5月22日

10、股东及其出资比例：新时代证券有限责任公司60%，日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co.，Ltd.）40%。

10、内部组织结构及职能：

公司设立了投资决策委员会和风险管理委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险管理委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

公司目前下设权益投资部、量化投资部、研究部、交易部、机构理财部、固定收益部、国际业务部、风险管理部、市场拓展部、北方营销中心、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心、西部营销中心、电子商务部、财务管理部、信息技术部、产品开发部、监察稽核部、登记清算部、综合管理部。

权益投资部、量化投资部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。机构理财部主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。固定收益部负责公司受托资产固定收益证券的研究和投资工作。国际业务部负责海外市场研究、投资。风险管理部负责对公司受托资产的投资运作进行全面的风险管理。市场拓展部、北方营销中心、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心及西部营销中心负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。电子商务部负责电子商务直销平台的搭建及维护，电子商务渠道的开发等。财务管理部财务制度制定、实施和运转。信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发。产品开发部负责境内外理财产品的跟踪研究以及新产品的创新、开发。监察稽核部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。登记清算部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。综合管理部负责公司财务管理、企业文化建设、文字档案、相关后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

11、人员情况：

截至2015年6月30日，我公司共有187名员工，其中博士学位7人、硕士学位98人和学士学位68人。

12、信息披露负责人：涂卫东

咨询电话：0755-26948666

13、本基金基金经理

何天翔先生，厦门大学经济学硕士，7年证券、基金从业经验。2008年7月至2010年3月任职于联合证券研究所金融工程部，任金融工程研究员，2008年、2009年"新财富"金融工程团队第一名成员。2010年3月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员投资经理。现任融通深证100指数证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身"中国人民建设银行"于1954年成立，1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2014年12月31日，中国建设银行资产总额167,441.30 亿元，较上年增长8.99%；客户贷款和垫款总额94,745.23 亿元，增长10.30%；客户存款总额128,986.75 亿元，增长5.53%。营业收入5,704.70 亿元，较上年增长12.16%；其中，利息净收入增长12.28% ，净利息收益率（ NIM ）2.80% ；手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%；成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86 亿元，较上年增长6.89%；净利润2,282.47 亿元，增长6.10%。资本充足率14.87%，不良贷款率1.19%，拨备覆盖率222.33%。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,856 个，服务于348 万公司客户、3.14 亿个人客户，与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系；在香港、澳门、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡、布里斯班、多伦多设有海外分行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建行新西兰、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、建信期货、中德住房储蓄银行等多家子公司。

2014年，中国建设银行的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可，先后荣获国内外知名机构授予的100 余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014 年"世界银行1000 强排名"中，以一级资本总额位列全球第2；在英国《金融时报》全球500 强排名第29位，新兴市场500 强排名第3 位；在美国《福布斯》杂志2014 年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500 强排名第38 位。此外，中国建设银行还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息科技等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务。赵观甫先生长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005 年及自2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行"，在2007 年及2008 年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖，并获和讯网2011 年度和2012 年度中国"最佳资产托管银行"奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度"最佳基金托管银行"奖。

（三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：010-50938856

传真：010-50938907

联系人：崔巍

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）

注册地址：上海市陆家嘴环路1318 号星展银行大厦6 楼

办公地址：上海市陆家嘴环路1318 号星展银行大厦6 楼

邮编：200120

法人代表：杨绍信

联系人：刘莉

电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：王灵、汪棣

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

融通中证军工指数分级证券投资基金2015年7月6日资产负债表如下：

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年7月6日
资 产：	
银行存款	20,669,109.36
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	350,053,447.01
应收利息	52,307.04
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	8,448.72
资产总计	370,783,312.13
负债和所有者权益	本期末 2015年7月6日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	50,780.53
应付托管费	11,171.71
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	5,580.83
负债合计	67,533.07
所有者权益：	
实收基金	370,677,558.08
未分配利润	38,220.98
所有者权益合计	370,715,779.06
负债和所有者权益总计	370,783,312.13

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2015年7月6日，融通中证军工指数分级证券投资基金的投资组合如下：

1、基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	20,669,109.36	5.57
7	其他资产	350,114,202.77	94.43
8	合计	370,783,312.13	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票投资组合

截至2015年7月6日，本基金未持有指数投资的股票。

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

截至2015年7月6日，本基金未持有积极投资的股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

截至2015年7月6日，本基金未持有指数投资的股票。

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

截至2015年7月6日，本基金未持有积极投资的股票。

持有积极投资的股票。

（四）按券种分类的债券投资组合

截至2015年7月6日，本基金未持有债券。

（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至2015年7月6日，本基金未持有债券。

（六）按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截至2015年7月6日，本基金未持有资产支持证券。

（七）按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截至2015年7月6日，本基金未持有权证。

（八）本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

（九）本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（十一）投资组合报告附注

1、截至2015年7月6日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	350,053,447.01
3	应收股利	-
4	应收利息	52,307.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	8,448.72
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	350,114,202.77

4、截至2015年7月6日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至2015年7月6日，本基金指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明。

截至2015年7月6日，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

6、截至2015年7月6日，本基金积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至2015年7月6日，本基金未持有积极投资的股票。

7、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准融通中证军工指数分级证券投资基金募集的文件；

（二）《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》；

（三）《融通中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》；

（四）《融通中证军工指数分级证券投资基金托管协议》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

融通基金管理有限公司
2015年7月8日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值、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，确定融通军工份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件。

（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期