

## 申万菱信基金管理有限公司 关于申万菱信深证成指分级证券投资基金管理 办理定期份额折算业务的公告

根据《申万菱信深证成指分级证券投资基金管理合同》(简称“基金合同”),及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,申万菱信深证成指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)将在2016年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下:

### 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定,定期份额折算基准日为每个会计年度的第一个工作日。本次份额折算为本基金的定期折算,基准日为2016年1月4日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的申万收益份额、申万深成份额(包括场内份额与场外份额)。

本基金的份额包括:申万菱信深证成指分级证券投资基金之基础份额(场内简称“申万深成”,基金代码163109)、申万菱信深证成指分级证券投资基金之收益份额(场内简称“深成指A”,交易代码150022)和申万菱信深证成指分级证券投资基金之进取份额(场内简称“深成指B”,交易代码150023)。其中,申万收益份额、申万进取份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

### 三、基金份额折算方式

申万收益份额和申万进取份额按照《基金合同》规定的净值计算规则进行净值计算,对申万收益份额期末约定应得收益进行定期份额折算,每2份申万深成份额将按1份申万收益份额获得约定应得收益的新增折算份额。

申万收益份额期末约定应得收益,即申万收益份额每个会计年度12月31日份额净值超出本金1.0000元的部分,将折算为场内申万深成份额分配给申万收益份额持有人。申万深成份额持有人的每2份申万深成份额将按1份申万收益份额获得新增申万深成份额的分配。

持有场外申万深成份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外申万深成份额的分配;持有场内申万深成份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内申万深成份额的分配。经过上述份额折算,申万收益份额和申万深成份额的基金份额净值将相应调整。

### 有关计算公式如下:

#### (一)申万收益份额

定期份额折算后申万收益份额的份额数 = 定期份额折算前申万收益份额的份额数。

NAV<sup>1</sup> = 申万深成份额的场内申万深成份额的份额数 / 申万深成份额的份额净值 - 1.0000 × 2

申万收益份额持有人持有的场内申万深成份额的份额数 =

NAV<sup>2</sup> × (申万深成份额的场内申万深成份额的份额数 / 申万深成份额的份额净值)

NAV<sup>2</sup> = 申万深成份额的场内申万深成份额的份额数 / 申万深成份额的份额净值

申万收益份额新增份额折算成申万深成份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

#### (二)申万进取份额

定期份额折算不对申万进取份额进行折算,因此不改变申万进取份额的基金份额净值及其份额数。

#### (三)申万深成份额

NAV<sup>3</sup> = 申万深成份额的场内申万深成份额的份额数 / 申万深成份额的份额净值

定期份额折算后申万深成份额的总份额数 = 定期份额折算前申万深成份额的份额数 + 申万深成份额持有人新增的申万深成份额的份额数 + 申万收益份额持有人新增的场内申万深成份额的份额数

其中:

NAV<sup>1</sup> = 定期份额折算后申万深成份额的基金份额净值

NAV<sup>2</sup> = 定期份额折算前申万深成份额的份额数

NAV<sup>3</sup> = 定期份额折算前申万深成份额的份额数

申万深成份额的场外份额经折算后的份额数,采用截位法保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金财产;申万深成份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金财产。

投资者可在份额折算基准日之后第二个工作日查询经注册登记人及基金管理人确认的折算后份额。

### 四、份额折算期间的业务办理

#### (一)份额折算基准日(即2016年1月4日),本基金暂停办理申购(含定期份额投资,下同)、赎回、转换、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管,下同)、配对转换业务,深成指A正常交易,当日晚间,基金管理人计算当日申万深成份额基金净值和申万收益份额参考净值并进行份额折算。深成指B在整个定期份额折算期间交易正常进行。

(二)份额折算基准日后的第一个工作日(即2016年1月5日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管,下同)、配对转换业务,深成指A将于该日停牌一天,深成指B正常交易。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)份额折算基准日后的第二个工作日(即2016年1月6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、转换、转托管、配对转换业务,深成指A将于该日上午9:30~10:30停牌一小时,并于上午10:30后复牌,深成指B正常交易。

(四)根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2016年1月6日深成指A即刻行情显示的前收盘价为2016年1月5日的基金份额净值(四舍五入至0.001元)。由于深成指A折算前可能存在折溢价交易情形,深成指A折算前的收盘价扣除基准收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异,1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

### 五、重要提示

(一)由于申万收益份额期末约定应得收益折算成场内申万深成份额的份额数和申万深成份额的场内份额经折算后获得的新增份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金财产,故持有较少申万收益份额数或场内申万深成份额数的份额持有人存在无法获得新增场内申万深成份额的可能性。

(二)本基金申万收益份额期末约定应得收益将折算为场内申万深成份额分配给申万收益份额的持有人,而申万深成份额为跟踪深证成指指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此申万收益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)本基金办理份额折算业务的具体事项以本公司规定的事项为准。

(四)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.sswsmu.com或者拨打本公司客服电话:400 880 8588(免长途话费)或021-962299。

### 六、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基本合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2015年12月29日

申万菱信基金管理有限公司

2015年