

## 申万菱信基金管理有限公司 关于调整旗下申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)申购金额、赎回份额下限及最低持有份额下限的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求,申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自2017年6月1日起,调整旗下申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)的申购金额、赎回份额下限及最低持有份额下限。详情如下:

### 一、适用基金

基金名称:	申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)	基金代码:	163111
-------	----------------------	-------	--------

### 二、申购金额、赎回份额下限及最低持有份额下限调整

自2017年6月1日起,投资人办理上述基金申万中小板份额申购时,单笔最低申购金额调整为10万元人民币(含申购费)。同时,上述基金最低赎回份额调整为10份,最低持有份额调整为0份。

三、重要提示

1、本公司对恢复正常情况后的申万收益份额和申万进取份额基金份额净值计算方法的提示。

2、投资者若希望了解本基金申万收益份额和申万进取份额基金份额净值计算详情,请登陆本公司网站:www.swwsmu.com 查阅本基金的《基金合同》及《招募说明书》或者拨打本公司客服电话:400-880-8588(免长途话费)或021-962299。

3、本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等相关文件。

4、公告的解释权归本公司所有。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

申万菱信基金管理有限公司

客服电话:400-880-8588(免长途话费)或021-962299

网站:www.swwsmu.com

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资前应认真阅读本基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2017年5月26日

## 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 恢复正常情况后申万收益份额场内简称 “深成指A”,申万进取份额场内简称 “深成指B”净值计算方法的公告

2017年5月23日,申万菱信深证成指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)申万进取份额跌破合同规定的极端净值线0.1000元,根据本基金《基金合同》第三部分“基金份额分级与净值计算原则”的相关规定,本基金已采用极端情况下的基金份额净值计算规则对申万收益份额(场内简称“深成指A”,交易代码:160022)与申万进取份额(场内简称“深成指B”,交易代码:150023)的基金份额净值进行计算,申万收益份额与申万进取份额的合同约定净值为0.1000元。

由于深成指A的回撤,2017年5月25日,本基金申万进取份额按照极端情况下基金的基金份额净值原则,计算的基金份额净值为0.1000大于0.1000元,并且超过0.1000元的部分已补足申万收益份额自极端情况发生日(含)以来在正常情况下累计应得的基本收益。根据本基金《基金合同》,自该日,申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值将被恢复至正常情况下的基金份额净值计算原则。根据本基金的《基金合同》及相关业务规定,本基金管理人将就相关事项公告如下:

一、(即2017年5月25日)申万收益份额与申万进取份额基金份额净值的计算

根据本基金《基金合同》,本基金在极端情况发生后,申万进取份额将不再保证申万收益份额每日获得日基准收益,申万收益份额将与申万进取份额按两者基金份额净值的比例共同承担亏损,即申万收益份额与申万进取份额各自负盈亏。由于深成指A的回撤使得申万进取份额将补足亏损原则计算的基金份额净值大于1.000元,则超过1.000元的部分将优先于补足申万收益份额,以使申万进取份额的基金份额净值等于申万收益份额在极端情况发生日(即该日)前一日的基金份额净值加上申万收益份额自极端情况发生日(含该日)以来在正常情况下累计应得的基本收益;若弥补后仍有剩余,则剩余部分仍归属于申万进取份额;若不足以弥补,则直至补足后,申万进取份额的基金份额净值方可低于1.000元。在申万进取份额的基金份额净值大于1.000元后,申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值计算原则将按照行业惯例重新计算。

二、(即2017年5月25日)申万收益份额与申万进取份额的合同约定净值

本基金之申万传媒B份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,当发生合同规定的不定期份额折算时,份额折算后申万传媒A份额与申万传媒B份额的基金份额净值始终保持1:1配比;份额折算前申万传媒A份额持有人的资产与份额折算后其持有的申万传媒A份额的资产及其持有的新增场内申万传媒份额的资产和相等;份额折算前申万传媒A份额的持有人在份额折算后将持有申万传媒A份额与新增场内申万传媒份额,因此持有人的份额折算后将发生一定的变化,由持有单一的低风险收益特征份额变更为同时持有低风险收益特征份额和高风险收益特征份额的情况。

三、(即2017年5月25日)申万传媒A份额与申万传媒B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

四、由于触发折算阀值当日,申万传媒B份额的基本份额参考净值可能已低于阀值,但根据基金合同规定,折算基准日在触发阀值后仍不能确定,因此折算基准日申万传媒B份额的净值可能与触发折算的阀值0.2500元有一定差异。

五、基金管理人在此特别提醒投资者注意以下事项:

1、若本基金发生上述不定期份额折算情形,为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证监会核算有限责任公司的相关业务规定暂停申万传媒A份额与申万传媒B份额的上市交易和申万传媒份额的申购及赎回等相关业务。

2、本基金之申万传媒B份额表现为预期风险高、预期收益高的特征,当发生合同规定的不定期份额折算时,份额折算后申万传媒B份额的资产与份额折算后申万传媒B份额的资产相等。因此,持有人的风险收益特征将不会发生变化,仍为持有单一的高风险收益特征份额。不定期份额折算后,申万传媒B份额杠杆将恢复至初始杠杆水平,敬请投资者注意投资风险。

3、申万传媒A份额、申万传媒B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

4、由于触发折算阀值当日,申万传媒B份额的基本份额参考净值可能已低于阀值,但根据基金合同规定,折算基准日在触发阀值后仍不能确定,因此折算基准日申万传媒B份额的净值可能与触发折算的阀值0.2500元有一定差异。

5、基金管理人在此特别提醒投资者注意以下事项:

1、若本基金发生上述不定期份额折算情形,为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证监会核算有限责任公司的相关业务规定暂停申万传媒A份额与申万传媒B份额的上市交易和申万传媒份额的申购及赎回等相关业务。

2、本基金之申万传媒B份额表现为预期风险高、预期收益高的特征,当发生合同规定的不定期份额折算时,份额折算后申万传媒B份额的资产与份额折算后申万传媒B份额的资产相等。因此,持有人的风险收益特征将不会发生变化,仍为持有单一的高风险收益特征份额。不定期份额折算后,申万传媒B份额杠杆将恢复至初始杠杆水平,敬请投资者注意投资风险。

3、申万传媒A份额、申万传媒B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

4、由于触发折算阀值当日,申万传媒B份额的基本份额参考净值可能已低于阀值,但根据基金合同规定,折算基准日在触发阀值后仍不能确定,因此折算基准日申万传媒B份额的净值可能与触发折算的阀值0.2500元有一定差异。

5、基金管理人在此特别提醒投资者注意以下事项: