

关于申万菱信中证军工指数分级证券投资基金不定期份额折算结果 及恢复交易的公告

根据《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》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,申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”)以 2015 年 7 月 9 日为基准日,对申万菱信中证军工指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)实施不定期份额折算,现将相关事项公告如下:

一、份额折算结果

2015 年 7 月 9 日,申万军工份额(场内简称:申万军工,基金代码:163115)的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位,尾差部分计入基金财产;申万军工份额的场内份额和申万军工 A 份额(场内简称:军工 A 级,基金代码:150186)、申万军工 B 份额(场内简称:军工 B 级,基金代码:150187)经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份)。基金份额折算比例精确到小数点后第 9 位,如下表所示:

基金份额名称	折算前基金份额 (单位:份)	折算比例	折算后基金份额(单位: 份)	折算后基金 份额净值 (单位:元)
申万军工场外 份额	3,927,377,965.11	0.660727334	2,594,927,186.86	1.0000
申万军工场内 份额	347,696,922.00	0.660727334	229,732,860.00	1.0000
申万军工 A 份 额	2,601,033,572.00	0.263756038	686,038,309.00	1.0000
		0.793942592	2,065,071,336.00(注)	1.0000
申万军工 B 份 额	2,601,033,572.00	0.263756038	686,038,309.00	1.0000

注:该“折算后基金份额”为申万军工 A 份额经折算后产生的新增申万军工场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自 2015 年 7 月 13 日起,本基金恢复办理申购(含定期定额投资)、赎回、转换、转托管(包括系统内转托管和跨系统转托管)和配对转换业务,军工 A 级、军工 B 级将于 2015 年 7 月 13 日上午 9:30-10:30 停牌一小时后复牌。

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》,2015 年 7 月 13 日复牌首日军工 A 级即时行情显示的前收盘价将调整为 2015 年 7 月 10 日申万军工 A 份额的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元),即 1.000 元;军工 B 级即时行情显示的前收盘价将调整为 2015 年 7 月 10 日申万军工 B 份额的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元),即 1.118 元。2015 年 7 月 13 日当日军工 A 级和军工 B 级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。

三、重要提示

1、申万军工 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后申万军工 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申万军工 A 份额变为同时持有较低风险收益特征申万军工 A 份额与较高风险收益特征申万军工份额

的情况，因此申万军工 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

2、申万军工 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

3、由于申万军工 A 份额和申万军工 B 份额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较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意投资风险。

4、申万军工 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申万军工分拆为申万军工 A 份额和申万军工 B 份额。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量申万军工份额、申万军工 A 份额和申万军工 B 份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、本基金管理人承诺以诚实信用、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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，决策须谨慎。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一五年七月十三日