

申万菱信基金管理有限公司

关于申万菱信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《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》（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，申万菱信中证军工指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2015 年 7 月 23 日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、 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运作周年的结束日。本基金成立于 2014 年 7 月 24 日，本基金的第一个分级运作周年自 2014 年 7 月 24 日起至 2015 年 7 月 23 日止，2015 年 7 月 23 日为第一个分级运作周年的结束日。本次定期份额折算基准日为 2015 年 7 月 23 日。

二、 份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的申万军工 A 份额、申万军工份额（包括场内份额与场外份额）。

本基金的基金份额包括申万菱信中证军工指数分级证券投资基金之基础份额申万军工份额（场内简称“申万军工”，基金代码：163115）、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金之稳健收益类份额申万军工 A 份额（场内简称“军工 A 级”，基金代码：150186）与申万菱信中证军工指数分级证券投资基金之积极进取类份额申万军工 B 份额（场内简称“军工 B 级”，基金代码：150187）。其中，申万军工 A 份额、申万军工 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

三、 份额折算方式

申万军工 A 份额和申万军工 B 份额按照《基金合同》规定的参考净值计算规则进行基金份额参考净值计算，对申万军工 A 份额的基准收益进行定期份额折算，每两份申万军工份额将按一份申万军工 A 份额获得基准收益的新增折算

份额。

在分级运作期内的每个运作周年，将申万军工 A 份额在运作周年结束日的份额参考净值超出本金 1.0000 元部分，折算为场内申万军工份额分配给申万军工 A 份额持有人。申万军工份额持有人持有的每两份申万军工份额将按一份申万军工 A 份额获得新增申万军工份额的分配。持有场外申万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申万军工份额的分配；持有场内申万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申万军工份额的分配。经过上述份额折算，申万军工 A 份额的基金份额参考净值和申万军工份额的基金份额净值将相应调整。有关计算公式如下：

(1) 申万军工 A 份额

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(A)^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)$$

申万军工 A 份额持有人新增的场内申万军工份额的份额数=

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万军工 A 份额的基金份额数；

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：定期份额折算后申万军工 A 份额的基金份额数；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万军工 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日申万军工 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万军工份额的基金份额净值，即折算基准日申万军工份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后申万军工份额的基金份额净值。

申万军工 A 份额新增份额折算成申万军工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。

(2) 申万军工 B 份额

每次定期份额折算不改变申万军工 B 份额的基金份额参考净值及其基金份额数。

(3) 申万军工份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)$$

原申万军工份额持有人新增的申万军工份额的份额数=

$$0.5 \times NUM^{\text{前}} \times \frac{(NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

定期份额折算后原申万军工份额持有人持有的申万军工份额的份额数
= $NUM^{\text{前}}$ + 原申万军工份额持有人新增的申万军工份额的份额数

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后申万军工份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万军工份额的基金份额净值，即折算基准日申万军工份额的基金份额净值；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万军工 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日申万军工 A 份额的基金份额参考净值；

$NUM^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万军工份额的份额数。

申万军工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，由此误差产生的收益或损失计入基金财产；申万军工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 2015 年 7 月 23 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务，军工 A 级和军工 B 级正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日申万军工份额基金份额净值和申万军工 A 份额、申万军工 B 份额的基金份额参考净值并进行份额折算。

（二）份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 7 月 24 日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，军工 A 级暂停交易，军工 B 级正常交易。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 2015 年 7 月 27 日),基金管理人将公告份额折算确认结果,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,军工 A 级将于该日上午 9:30-10:30 停牌一小时,并于上午 10:30 之后复牌,军工 B 级正常交易。

(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》,2015 年 7 月 27 日军工 A 级的前收盘价为 2015 年 7 月 24 日的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)。由于军工 A 级折算前可能存在折溢价交易情形,军工 A 级折算前的收盘价扣除基准收益后与 2015 年 7 月 27 日的前收盘价可能有较大差异,2015 年 7 月 27 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

(一) 由于申万军工 A 份额期末约定应得收益折算成场内申万军工份额的份额数和申万军工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,故持有较少申万军工 A 份额数或场内申万军工份额数的份额持有人存在无法获得新增场内申万军工份额的可能性。

(二) 本基金办理份额折算业务的具体事项以本公告规定的事项为准。

(三) 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.swsmu.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金合同、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 7 月 20 日