

关于大成景祥分级债券型证券投资基金基金合同到期处理方案的公告

根据《大成景祥分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，大成景祥分级债券型证券投资基金（基金简称：大成景祥分级，基金代码：000440，以下简称“本基金”）存续期限为3年，基金合同到期日为基金合同生效后3年对日的前一日，即2016年11月18日。基金合同到期时，基金管理人有权在不召开本基金份额持有人大会的情况下，将本基金转换为大成债券证券投资基金（以下简称“大成债券基金”）。景祥A和景祥B的基金份额持有人可以选择在基金合同到期日赎回景祥A和景祥B份额或默认到期后自动转换为大成债券基金C类份额。

一、基金合同到期日开放景祥A和景祥B份额赎回的提示

根据《基金合同》的约定，景祥A和景祥B的赎回开放日为基金合同到期日，即2016年11月18日，景祥A和景祥B的基金份额持有人可以选择在该日赎回景祥A和景祥B份额或默认到期后自动转换为大成债券基金C类份额。《关于大成景祥分级债券型证券投资基金之景祥A份额、景祥B份额开放赎回的公告》已于2016年11月9日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及《证券时报》。

二、基金运作周期届满后基金份额的转换

（一）转换基准日

基金份额转换基准日为本基金合同到期日的下一个工作日，即2016年11月21日。

（二）转换对象

基金份额转换基准日登记在册的大成景祥A份额和大成景祥B份额。

（三）转换方式

本基金合同到期日开放基金份额赎回业务后，基金管理人将根据景祥A和景祥B各自的基金份额净值和大成债券基金C类份额的份额净值，将基金份额转换基准日登记在册的所有景祥A和景祥B分别折算成大成债券基金C类份额。

份额折算计算公式：

景祥A（或景祥B）的折算比例

=基金合同到期日景祥A（或景祥B）的基金份额净值/基金份额转换基准日大成

债券基金份额净值（C类份额）

基金管理人对大成景祥分级自基金合同到期日（不含）至基金份额转换基准日（含）期间产生的收益归基金份额转换基准日登记在册的基金份额持有人所有，扣除合同到期日后预估的银行划款手续费，按照基金份额持有人持有份额对应的基金资产净值比例分配，并于转换基准日转换为大成债券 C 类份额。

以上折算比例的计算结果采用四舍五入的方法保留小数点后 8 位，第 9 位四舍五入。

景祥 A（或景祥 B）基金份额持有人持有的转换至大成债券基金 C 类份额的数量 = 基金份额持有人持有的转换前景祥 A（或景祥 B）的份额数 × 景祥 A（或景祥 B）的折算比例

景祥 A（或景祥 B）经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后 2 位，由此产生的误差计入大成债券基金基金财产。

（四）转换费用

本次基金份额转换无需基金份额持有人提出申请，由基金管理人统一办理，基金份额持有人无需支付转换基金份额的费用。

（五）转换后基金份额的注册登记

本基金的注册登记机构将在基金份额转换基准日的下一工作日（2016 年 11 月 22 日）为原景祥 A 和景祥 B 的持有人办理减少转出基金份额（即：景祥 A 或景祥 B 份额）、增加转入基金份额（即：大成债券 C 类份额）的权益登记手续。

份额转换后，基金份额持有人不再持有景祥 A 份额或者景祥 B 份额，而是持有大成债券 C 类份额。一般情况下，投资者自基金份额转换基准日后第 2 个工作日（2016 年 11 月 23 日）起有权按照《大成债券投资基金基金合同》的约定赎回转换后的大成债券 C 类份额。

（六）持有期的计算

由景祥 A 和景祥 B 份额转换而来的大成债券 C 类份额的持有期限自 2016 年 11 月 22 日起计算。

三、基金合同到期的处理

（一）基金资产变现情况

截至 2016 年 11 月 16 日，本基金因持有停牌债券而暂时无法变现的基金资产合计 10,938,622.38 元，占基金资产净值比例约为 0.506%。

（二）到期处理原则

1、如基金合同到期日（2016 年 11 月 18 日），本基金持有的停牌债券均已复牌，且基金资产已全部变现，基金管理人将根据《基金合同》的约定对申请赎回的基

金份额进行赎回确认，对未申请赎回的基金份额实施转换。

2、如基金合同到期日，本基金持有的停牌债券尚未复牌，基金资产无法全部变现，本基金届时的已变现基金资产优先满足景祥 A 份额持有人的赎回款支付及此后的份额转换。在满足景祥 A 份额持有人的赎回款支付及份额转换后，基金管理人将以本基金已变现基金资产为限，进行景祥 B 份额持有人的赎回款支付或份额转换，因持有停牌债券暂时无法变现的基金资产将于变现后进行再次分配。停牌债券复牌变现后，届时实际所得将以现金形式分配给转换基准日登记在册的景祥 B 份额持有人。

投资者欲了解详情，请登录本公司网站：www.dcfund.com.cn 或拨打本公司客服电话：400-888-5558(免长途话费)。

风险提示

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。投资者投资于基金前应认真阅读基金合同和招募说明书等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告

大成基金管理有限公司

2016 年 11 月 17 日