

# 申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期与基金转换的第一次提示性公告

《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2012年5月8日生效，基金合同生效之日起五个运作周年内，申万菱信中小板指数分级证券投资基金（基金简称“申万中小板分级”，基金代码163111，以下简称“本基金”）的基金份额划分为申万菱信中小板指数分级证券投资基金之中小板A份额（基金份额简称：中小板A份额；场内简称：中小板A；基金代码：150085）、申万菱信中小板指数分级证券投资基金之中小板B份额（基金份额简称：中小板B份额；场内简称：中小板B；基金代码：150086）两级份额。

根据《基金合同》的相关规定，本基金分级运作期共包含五个运作周年。本基金分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”。

根据《基金合同》和《申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的相关规定，本基金分级运作期到期日为2017年5月8日。

本基金管理人已于2017年3月23日在《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.cn）和申万菱信基金管理有限公司网站（www.swsmu.com）上发布了《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期与基金转换的公告》。为保证本基金份额持有人的利益，现发布本基金分级运作期到期与基金转换的第一次提示性公告。

## 一、分级运作期到期日的提示

根据本基金《基金合同》及《招募说明书》的规定，分级运作期到期日指第五个运作周年的结束日，第五个运作周年的结束日为基金合同生效之日至满五周年的最后一日（简称为“五周年日”），若五周年日为非工作日，则第五个运作周年的结束日顺延至五周年日之后的第一个工作日。

本基金成立于2012年5月8日，本基金的五周年日为2017年5月7日，因2017年5月7日为非工作日，则第五个运作周年的结束日顺延至2017年5月7日之后的第一个工作日，即2017年5月8日。本基金分级运作期到期日为2017年5月8日。

## 二、分级运作期到期后基金的存续形式

本基金分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”。中小板A份额、中小板B份额将按相关规则折算成场内申万中小板份额。

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，场内申万中小板份额将在深圳证券交易所上市交易，并办理申万中小板份额的申购与赎回业务。

### 三、分级运作期到期基金份额的折算

#### 1、基金份额到期折算基准日

分级运作期到期日，即第五个运作周年的结束日。

本基金的基金份额到期折算基准日为 2017 年 5 月 8 日。

#### 2、基金份额到期折算方式

中小板 A 份额、中小板 B 份额按照各自的基金份额参考净值，以申万中小板份额的基金份额净值为基准，折算成场内申万中小板份额。

中小板 A 份额（或中小板 B 份额）基金份额持有人持有的折算后申万中小板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。

到期折算的计算公式：

中小板 A 份额（或中小板 B 份额）的折算比率=到期折算基准日中小板 A 份额（或中小板 B 份额）的基金份额参考净值/到期折算基准日申万中小板份额的基金份额净值。

中小板 A 份额（或中小板 B 份额）基金份额持有人持有的折算后的场内申万中小板份额=基金份额持有人持有的折算前中小板 A 份额（或中小板 B 份额）的份额数×中小板 A 份额（或中小板 B 份额）的折算比率。

#### 3、基金份额到期折算后的基金运作

基金管理人将在中小板 A 份额与中小板 B 份额全部折算为场内申万中小板份额之日起 30 个工作日内开始办理本基金场外与场内申购和赎回业务。

基金管理人将在中小板 A 份额与中小板 B 份额全部折算为场内申万中小板份额之日起 30 个工作日内，在满足上市条件的情况下，向深圳证券交易所申请本基金的上市交易。

到期折算后本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。中小板 A 份额与中小板 B 份额到期折算后，原分级运作期内基金份额的定期折算和不定期折算将取消。

#### 4、基金份额到期折算的相关公告

(1) 本基金分级运作期到期时，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案。

(2) 在本基金分级运作期到期日前 30 个工作日，基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告。

(3) 中小板 A 份额、中小板 B 份额到期折算后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

#### 四、基金转换后基金的投资管理

分级运作期到期，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

#### 五、重要提示

1、为保证本基金转换的平稳运作，自本基金的基金份额到期折算基准日起，基金管理人根据中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则暂停办理本基金申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管）、配对转换业务，届时请详见基金管理人发布的相关公告。

2、本基金分级运作期到期后，中小板 A、中小板 B 将终止在深圳证券交易所上市交易，届时请详见基金管理人发布的相关公告。

3、基金转换完成后，本基金将更名为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”。

4、在基金份额到期折算时，所有中小板 A 份额、中小板 B 份额将自动转入本基金份额到期折算后的上市开放式基金（LOF）份额。原有中小板 A、中小板 B 的基金份额持有人持有的转换后的上市开放式基金（LOF）份额，可能会因其业务办理所在证券公司的业务资格等方面的原因，不能顺利赎回。此时，投资者可选择卖出或者通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

5、在申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资人将无法办理基金赎回，在申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）上市交易之前，投资人将无法进行基金份额的交易，存在一定的流动性风险。

投资者若希望了解详情，请登陆本公司网站：[www.swsmu.com](http://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。

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

2017年4月7日