

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之申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告

根据《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》(以下简称“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”)申万进取份额的基金份额净值按照正常情况下的原则计算跌破 0.1000 元的当日为极端情况发生日,本基金将在极端情况发生日及之后采用极端情况下的基金份额净值计算原则对申万收益份额(场内简称“深成指 A”,交易代码:150022)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。

一、风险提示

由于近期 A 股市场波动较大,截止 2015 年 9 月 30 日,申万进取份额的基金份额净值接近极端情况发生时的阈值,本公司提请场内持有申万收益份额及申万进取份额的投资者可能面临的下跌风险:

- 1、在申万进取份额的基金份额净值大幅下跌至 0.1000 元阈值的过程中,申万进取份额杠杆逐渐增大。当申万进取份额净值跌至 0.1000 元附近时,最高净值杠杆率可能达到 11 倍左右,其二级市场交易价格可能发生较大波动,参与二级市场交易的投资人面临一定风险。
- 2、本基金申万收益份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在本基金发生极端情况后(即申万进取份额净值下跌至 0.1000 元以下时),申万收益份额将暂时与申万进取份额同比例承担基金净值变化,各负盈亏,申万收益份额持有人将承担比原来更多的投资风险,可能暂时面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。
- 3、本基金申万进取份额表现为高风险、高收益的特征,但在本基金发生极端情况后,申万进取份额将与申万收益份额各负盈亏,申万进取份额的杠杆特性会暂时消失。
- 4、由于申万收益份额、申万进取份额极端情况发生前可能存在折溢价交易情形,极端情况发生后,申万收益份额、万进取份额的折溢价率可能发生较大变化。

对于场外持有本基金之基础份额的投资者不受极端情况的影响。

若本基金发生上述极端情况情形,本基金管理人将根据本基金基金合同的相关规定办理相关业务。敬请投资者予以关注。

二、重要提示

1、投资者若希望了解本基金申万收益份额与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.swsmu.com 查阅本基金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。

2、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。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2015 年 10 月 8 日