

# 申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信中证申万电子行业投资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《申万菱信中证申万电子行业投资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2020年2月25日为基准日，对申万菱信中证申万电子行业投资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

2020年2月25日，申万电子份额（场内简称：申万电子，基金代码：163116）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；申万电子份额的场内份额和申万电子B份额（场内简称：电子B，基金代码：150232）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：

折算前 折算后

基金份额名称 基金份额净值

（元） 基金份额（份） 新增份额折算比例 基金份额净值

（元） 基金份额（份）

申万电子份额

（场外份额） 1.5875 226,579,221.75 0.533520093 1.0352 347,463,789.20

申万电子份额

（场内份额） 1.5875 7,218,771.00 0.533520093 1.0352 28,761,679.00

申万电子B份额 2.1398 16,580,022.00 1.067040185 1.0352 16,580,022.00

注：申万电子A份额（场内简称：电子A，基金代码：150231）不参与本次不定期折算。申万电子场内份额经份额折算后产生新增的申万电子场内份额；申万电子场外份额经份额折算后产生新增的申万电子场外份额；申万电子B份额经份额折算后产生新增的申万电子场内份额；申万电子场内份额折算后份额包括申万电子B份额经份额折算后产生的新增申万电子场内份额。投资者自公告之日起即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2020年2月27日起，本基金恢复办理申购（含定期定额投资，但仍需遵循基金管理人2019年2月27日发布的《申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告》、2019年3月4日发布的《申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告》、2019年3月7日发布的《申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金调整代销机构场外大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告》）、赎回、转换、转托管（但仍需遵循基金管理人2019年2月22日发布的《关于旗下部分基金暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》）、配对转换业务。申万电子B份额将于2020年2月27日上午开市起复牌。

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》，2020年2月27日复牌首日电子B即时行情显示的前收盘价为2020年2月26日的电子B的份额参考净值，为0.896元（四舍五入至0.001元），2020年2月27日当日电子B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、本基金之电子 A 表现为低风险、收益相对稳定的特征。在不定期份额折算后，将不改变电子 A 的基金份额参考净值及其份额数。
- 2、本基金之电子 B 表现为高风险、高收益的特征，但在不定期份额折算后，原电子 B 持有人的风险收益特征将发生变化，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征电子 B 与较高风险收益特征的申万电子。折算后的杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到约 2 倍杠杆水平，电子 B 的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也将相应增加。
- 3、由于电子 A 和电子 B 折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，其折溢价率可能随之发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。
- 4、此次通过折算所新增的场内申万电子可通过办理配对转换业务分拆为电子 A 和电子 B。
- 5、折算后，本基金申万电子份额数量会增加。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，持有极小数量申万电子份额、申万电子 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

2020 年 2 月 27 日