

## 申万菱信基金管理有限公司

# 关于申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 办理不定期份额折算业务的公告

根据《申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的相关规定，当申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之申万医药份额的基金份额参考净值大于或等于 1.5000 元时，申万医药份额、申万医药 B 份额将进行不定期份额折算。

截至2020年7月23日，申万医药份额的基金份额参考净值为 1.5252元，达到上述办理不定期份额折算业务的条件。根据基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2020年7月24日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2020年7月24日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的本基金之基础份额（申万医药场外份额和场内份额的合计，基金代码：163118，场内简称：医药生物）和申万医药B份额（场内简称：SW医药B，基金代码：150284）。

### 三、基金份额折算方式

当申万医药份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，申万

医药 B 份额和申万医药份额按照如下公式进行份额折算：

1) 申万医药 A 份额

此类不定期份额折算不改变申万医药 A 份额的基金份额参考净值及其份额数。

2) 申万医药 B 份额

份额折算原则：

①份额折算后申万医药 B 份额与申万医药 A 份额的份额数保持 1:1 配比；

②将申万医药 B 份额的基金份额参考净值超过申万医药 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的申万医药份额；

③份额折算后申万医药份额的基金份额净值、申万医药 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日申万医药 A 份额的基金份额参考净值三者相等；

④份额折算前申万医药 B 份额的持有人在份额折算后将持有申万医药 B 份额与新增场内申万医药份额。

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

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

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

申万医药 B 份额持有人新增的场内申万医药份额的份额数 =

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

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算前申万医药 B 份额的基金份额数；

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算后申万医药 B 份额的基金份额数；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算前申万医药 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日申万医药 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算后申万医药 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算前申万医药 B 份额的基金份额参考净值，即折算基准日申万医药 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算后申万医药 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算后申万医药份额的基金份额净值；

经折算后申万医药 B 份额持有人新增的场内申万医药份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

### 3) 申万医药份额

场外申万医药份额持有人份额折算后获得新增场外申万医药份额，场内申万医药份额持有人份额折算后获得新增场内申万医药份额。

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

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算前原申万医药份额持有人持有的申万医药份额的基金份额数；

$NUM^{\text{后}}$ ：份额折算后原申万医药份额持有人持有的申万医药份额的基金份额数；

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算前申万医药份额的基金份额净值，即折算基准

日申万医药份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算后申万医药份额的基金份额净值；

申万医药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2位，由此误差产生的收益或损失计入基金财产；申万医药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。

#### 四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即2020年7月24日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务；SW医药A、SW医药B正常交易；基准日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2020年7月27日），本基金将暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务；SW医药A正常交易，SW医药B于该日停牌一天；本基金注册登记人及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2020年7月28日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；SW医药B将于2020年7月28日上午开市起恢复交易；自该日起，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2020年3月21日发布的《申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金暂停场内申购业务的公告》）、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（但仍需遵循基金管理人2020年3月24日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于旗下分级基金暂停场内份额分拆业务的公告》）。

4、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7月28日SW医药B即时行情显示的前收盘价为2020年7月27日的SW医药B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。2020年7月28日当日SW医药B份额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。

## 五、重要提示

1、申万医药A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，不定期份额折算后，将不改变申万医药A份额的基金份额参考净值及其份额数。

2、申万医药B份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

3、由于申万医药B份额折算前存在溢价交易情形，不定期份额折算后，申万医药B份额溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意申万医药B份额高溢价所带来的投资风险。

4、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，持有极小数量申万医药份额、申万医药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。

5、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，折算基准

日的申万医药份额参考净值与折算阈值1.5000元可能有一定差异。

6、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知晓基金投资的“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。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2020年7月24日