

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收益份额、申万进取份额发生  
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。

2018 年 5 月 29 日,申万进取份额按照正常情况下的原则计算的基金份额净值为 0.0942 元,本基金已经持续发生基金合同约定的极端情况,极端情况发生后,根据《基金合同》有关约定申万进取份额暂时不再保证申万收益份额每日获得日基准收益,申万收益份额开始与申万进取份额按两者基金份额净值的比例共同承担亏损,即申万收益份额与申万进取份额将各负盈亏。截至 2019 年 1 月 17 日,本基金仍处于极端情况,申万进取份额净值为 0.0741 元,特提醒投资者注意以下相关风险。

一、风险提示

申万进取份额的基金份额净值发生极端情况后,申万收益份额、申万进取份额净值的计算方法改变,申万收益份额和申万进取份额的风险收益特征将发生较大影响。本公司敬请投资者关注可能面临的风险:

- 1、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,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,在申万进取份额净值恢复到 0.1000 元以上之前,申万收益份额持有人将承担比原来更多的投资风险,可能面临暂时无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。
- 2、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,申万收益份额将暂时与申万进取份额各负盈亏,在申万进取份额净值恢复到 0.1000 元以上之前,申万进取份额的杠杆特性会暂时消失。
- 3、由于申万收益份额、申万进取份额存在折溢价交易情形,极端情况发生前后,申万收益份额、申万进取份额的折溢价率可能发生较大变化,交易价格可能发生较大波动,敬请投资者注意投资风险。

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。

二、重要提示

- 1、本公告是对极端情况发生日及极端情况发生后的申万收益和申万进取基金份额净值计算方法的提示。在申万进取基金份额净值恢复到 0.1000 元以上时,申万收益和申万进取基金份额净值的计算方法将恢复至正常情况下的计算原则。
- 2、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](http://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。
- 3、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

2019 年 1 月 19 日