

# 关于申万菱信深证成指分级证券投资基金 恢复正常情况后申万收益份额(场内简称 “深成指 A”)、申万进取份额(场内简称 “深成指 B”)净值计算方法的公告

2018年5月29日,申万菱信深证成指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)申万进取份额跌破基金合同规定的极端情况阈值0.1000元,根据本基金《基金合同》第三部分“基金份额分级与净值计算原则”的相关规定,本基金已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,申万收益份额与申万进取份额暂时同涨同跌、各负盈亏。

深证成指的回涨,2020年1月13日,本基金申万进取份额按照极端情况

下的基金份额净值计算原则,即各负盈亏原则,计算的基金份额净值为0.1071元,已大于0.1000元,并且超过0.1000元的部分已补足申万收益份额自极端情况发生日(含)以来在正常情况下累计应得的基准收益。根据本基金《基金合同》,自该日起,申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值将恢复按正常情况下的基金份额净值计算原则计算。根据本基金的《基金合同》以及相关业务规定,本基金管理人将相关事项公告如下:

一、当日(即2020年1月13日)申万收益份额与申万进取份额基金份额净值的计算

根据本基金《基金合同》,本基金在极端情况发生后,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各负盈亏。由于深证成指的回涨使得申万进取份额按各负盈亏原则计算的基金份额净值大于0.1000元,则超过0.1000元的部分净值将优先用于弥补申万收益份额,以使申万收益份额的基金份额净值等于申万收益份额在极端情况发生日前一日的基金份额净值加上申万收益份额自极端情况发生日(含该日)以来在正常情况下累计应得的基准收益;若弥补后仍有剩余,则剩余部分归属于申万进取份额;若不足以弥补,则直至补足后,申万进取份额的基金份额净值方可超过0.1000元。在申万进取份额的基金份额净值大于0.1000元后,申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值计算原则又按照正常情况下的份额净值计算原则执行,即申万收益份额每日获得日基准收益,申万收益份额的实际投资盈亏由申万进取份额分享与承担。

根据上述规定,2020年1月13日本基金申万收益份额和申万进取份额的份额净值计算过程如下:

2018年5月29日为最近一次极端情况发生日(T日),该日申万深成份额、申万收益份额和申万进取份额的基金份额净值分别为0.5563元、1.0131元和0.0995元。

2018年5月28日为最近一次极端情况发生前一日(T-1日),该日申万深成份额、申万收益份额和申万进取份额的基金份额净值分别为0.5621元、1.0182元和0.1060元,其中申万收益份额保留至小数点后8位的份额净值为1.01824692元。

2018年1月1日至2018年12月31日,申万收益份额的年基准收益为0.045元,日基准收益为0.00012329元。日基准收益累加后,于2018年12月31日需调整尾差-0.00000085(0.045-0.00012329\*365=-0.00000085)。

2019年1月1日至2019年12月31日,申万收益份额的年基准收益为0.045元,日基准收益为0.00012329元。日基准收益累加后,于2019年12月31日需调整尾差-0.00000085(0.045-0.00012329\*365=-0.00000085)。

2020年1月1日至2020年12月31日,申万收益份额的年基准收益为0.045元,日基准收益为

0.00012295 元。

2020 年 1 月 13 日 (T+594 日)，申万深成份额的基金份额净值为 0.5801 元，T-1 日 (不含) 至 2018 年 12 月 31 日 (含) (共 217 日)，2019 年 1 月 1 日 (含) 至 2019 年 12 月 31 日 (含) (共 365 日)，2020 年 1 月 1 日 (含) 至 2020 年 1 月 13 日 (含) (共 13 日)。因此，申万收益份额的累计基准收益为  $0.00012329 \times 217 + 0.00012329 \times 365 + 0.00012295 \times 13 - 0.000085 \times 2 = 0.07335143$  元。本基金 2020 年定期份额折算时，申万收益份额 2019 年 12 月 31 日份额净值超出本金 1.0000 元的部分 (超出本金 1.0000 元的部分保留至小数点后 8 位为 0.03600000 元)，已折算为场内申万深成份额，故极端情况期间申万收益份额的累计应得基准收益为  $0.07335143 - 0.036 = 0.03735143$  元。同时，本基金 2020 年定期份额折算时，申万深成份额按照申万收益折算金额的二分之一同时进行了份额折算，折算基准日 2020 年 1 月 2 日申万深成份额的份额净值为 0.5785 元，因此申万进取份额按各负盈亏原则计算的基金份额净值

$= 0.0995 \times (0.5785 \div 0.5563) \times [0.5801 \div (0.5785 - 0.036 \div 2)] = 0.1071$  元 > 0.1000 元。因此：

2020 年 1 月 13 日申万收益份额基金份额净值 (四舍五入保留至小数点后 4 位)

$= \min\{1.01824692 + 0.03735143, 2 \times 0.5801 - 0.1000\} = 1.0556$  元

2020 年 1 月 13 日申万进取份额基金份额净值  $= 2 \times 0.5801 - 1.0556 = 0.1046$  元

## 二、风险提示

- 1、本基金恢复正常情况后，申万收益份额将不再与申万进取份额同比例承担基金净值变化，申万收益份额每日获得日基准收益，恢复低风险、收益相对稳定的特征。
- 2、本基金恢复正常情况后，申万进取份额将不再与申万收益份额同比例承担基金净值变化，申万收益份额实际的投资盈亏都由申万进取份额分享与承担，申万进取份额恢复高风险、高收益的特征。
- 3、由于申万收益份额、申万进取份额存在折溢价交易情形，恢复正常情况前后，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。
- 4、持有本基金之基础份额的投资者不受上述净值计算方法变更的影响。
- 5、由于证券市场的波动，本基金在恢复正常情况后，仍有可能再次发生极端情况，从而导致申万收益份额、申万进取份额的基金份额净值计算方法及风险收益特征再次发生变化，届时本基金管理人将按照《基金合同》的规定进行公告，敬请投资者关注。

## 三、重要提示

- 1、本公告是对恢复正常情况后的申万收益份额和申万进取份额基金份额净值计算方法的提示。
- 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) 查阅本基金的《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

2020 年 1 月 14 日