

# 关于南方中证互联网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《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》（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，南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）以 2020 年 2 月 25 日为基准日，对南方中证互联网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，南方互联网份额（场内简称：互联基金，基金代码：160137）的场外份额经折算后的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；南方互联网份额的场内份额、互联网 A 份额（场内简称：互联 A 级，基金代码：150297）、互联网 B 份额（场内简称：互联 B 级，基金代码：150298）经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额部分计入基金资产。基金份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位，如下表所示：

基金份额名称	折算前基金份额 (份)	折算前基金份 额净值/参考 净值(元)	份额折算比例	折算后基金份额 (份)	折算后基金 份额净值/ 参考净值 (元)
南方互联网场外份额	124,176,478.93	1.518136744	1.518136744	188,516,875.40	1.0000
南方互联网场内份额	1,910,348.00	1.518136744	1.518136744	5,231,792.00 (注 1)	1.0000
互联网 A 份额	2,250,008.00	1.012808219	1	2,250,008.00	1.0000
			0.012808219	28,818.00 (注 2)	
互联网 B 份额	2,250,008.00	2.023465269	1	2,250,008.00	1.0000
			1.023465269	2,302,805.00 (注 3)	

注 1：该“折算后基金份额数”包括互联网 A 份额和互联网 B 份额经折算后产生的新增南方互联网场内份额数

注 2：该“折算后基金份额数”为互联网 A 份额经折算后产生的新增南方互联网场内份额数

注 3：该“折算后基金份额数”为互联网 B 份额经折算后产生的新增南方互联网场内份额数

投资人自公告之日起可查询经登记机构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（含定投，下同）、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；但仍需遵循基金管理人 2019 年 2 月 27 日发布的《南方中证互联网指数分级证券投资基金限制大额申购和定投业务的公告》及 2019 年 11 月 25 日发布的《南方中证互联网指数分级证券投资基金调整场外大额申购和定投业务限额并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》中的相关限制，相关限制如有调整，以基金管理人届时最新公告为准。互联 A 级和互联 B 级于 2020 年 2 月 27 日开市起恢复正常交易。

根据《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 日互联 A 级、互联 B 级即时行情显示的前收盘价为 2020 年 2 月 26 日的互联 A 级、互联 B 级的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），分别是 1.000 元和 0.915 元。2020 年 2 月 27 日当日互联 A 级、互联 B 级均可能出现交易价格较大幅波动的情形。敬请投资人注意投资风险。

## 三、其他需要提示的事项

1、本基金互联网 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后互联网 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的互联网 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的互联网 A 份额与较高风险收益特征的南方互联网份额，因此原互联网 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，南方互联网份额为跟踪中证互联网指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原互联网 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、本基金互联网 B 份额表现为高风险、高收益的特征，但在不定期份额折算后，原互联网 B 份额持有人将同时持有高风险收益特征的互联网 B 份额与较高风险收益特征的南方互联网份额，风险收益特征将发生较大变化，且折算后其杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到初始的 2 倍杠杆水平。此外，互联网 B 份额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会大幅增加。

3、由于互联 A 级、互联 B 级份额折算前存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，互联 A 级、互联 B 级的折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人注意折溢价所带来的风险。

4、本次因折算新增的场内南方互联网份额可通过办理配对转换业务分拆为互联网 A 份额、互联网 B 份额。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，互联网 A 份额、互联网 B 份额、南方互联网

份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为 1 份),舍去部分计入基金财产,持有极小数量互联网 A 份额、互联网 B 份额、南方互联网份额的持有人,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、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买互联网 A 份额或互联网 B 份额,在不定期份额折算后,则折算新增的南方互联网份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将互联网 A 份额或互联网 B 份额卖出,或者在折算后将新增的南方互联网份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

7、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。投资人投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资人注意投资风险。

8、投资人可访问本公司网站([www.nffund.com](http://www.nffund.com))或拨打全国免长途话费的客户服务电话(400—889—8899)咨询相关情况。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2020 年 2 月 27 日