

分级基金不定期折算阈值折算什么意？分级基金不定期折算阈值折算什么

基金上折，是基金不定期折算方式之一，本质相当于在母基金实现较大涨幅时，对B份额进行收益分配。现行政策是母基净值在达到1.5或者2元的时候进行上折，及净值重新回到1元，份额增多。在牛市时，母基金净值和杠杆份额的净值均实现大幅上涨，使得B份额的杠杆越来越小，甚至出现“杠杆失灵”的现象。通过向上折算，母基金与A、B份额的净值相等，B份额恢复交易功能，同时也为B份额提供有效的退出机制，从目前已经上折的基金来看，上折后分级基金杠杆份额恢复高杠杆，在二级市场价格出现溢价，带动整体溢价，从而产生套利机会。

分级基金不定期折算阈值折算什么意？分级基金不定期折算阈值折算什么

基金上折，是基金不定期折算方式之一，本质相当于在母基金实现较大涨幅时，对B份额进行收益分配。现行政策是母基净值在达到1.5或者2元的时候进行上折，及净值重新回到1元，份额增多。在牛市时，母基金净值和杠杆份额的净值均实现大幅上涨，使得B份额的杠杆越来越小，甚至出现“杠杆失灵”的现象。通过向上折算，母基金与A、B份额的净值相等，B份额恢复交易功能，同时也为B份额提供有效的退出机制，从目前已经上折的基金来看，上折后分级基金杠杆份额恢复高杠杆，在二级市场价格出现溢价，带动整体溢价，从而产生套利机会。