

基金从业科目一《基金法律法规、职业道德与业务规范》公式大全

(一)风险资产投额通常可用下式确定：

①风险资产投额 = 放大倍数 × (投资组合现时净值 - 价值底线) = 放大倍数 × 安全垫

②风险资产投资比例 = 风险资产投资额 / 基金净值

(二)基金认购费用将统一按净额为基础收取，相应的基金认购费用与认购份额的计算公式为：

①净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

②认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

对于适用 固定金额认购费的认购：认购费用 = 固定认购费金额

③认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值

(三)根据中国证监会《关于统一规范证券投资基金认(申)购费用及认(申)购份额计算方法有关问题的通知》规定，申购费用与申购份额的计算公式如下：

①净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

②申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

③申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

④净申购金额 = 申购金额 - 固定金额

⑤申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

(四)赎回金额的计算公式为：

①赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

②赎回总额 = 赎回数量 × 赎回日基金份额净值

③赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

实行后端收费模式的基金，还应扣除后端认购/申购费，剩余的金额才是投资者最终得到的赎回金额。即：

④赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用 - 后端收费金额

(五)ETF 份额折算的方法

①折算比例 = $(X \div Y) \div (I \times 1/1000)$ (以四舍五入法保留小数点后 8 位)

②折算后的份额 = 原持有份额 × 折算比例



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

(六)①可以现金替代：替代金额=替代证券数量 x 该证券最新价格 x(1+ 现金替代溢价比例)

②必须现金替代：替代金额=申购清单和赎回中该证券的数量 x 该证券价格

(七) T 日申购清单和赎回中清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

①T 日预估现金部分 =T -1 日最小申购和赎回单位的基金资产净值-(申购清单和赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+赎回清单和赎回清单中可以用现金替代成分证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和 + 申购清单和赎回中禁止用现金替代成分证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和)

T 日现金差额在 T+1 日的申购清单和赎回中公告。其计算式为：

②T 日现金差额= T 日最小申购和赎回单位的基金资产净值 -(申购清单和赎回申购清单和赎回单中必须用现金替代的固定额+申购清单和赎回清单中可以用现金替代成分证券的数量与 T 日收盘价相乘之和+申购清单和赎回中禁止用现金替代成分证券的数量与 T 日收盘价相乘之和)

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com

233网校
www.233.com



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！