

关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

实施转型的提示性公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》、《申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》等规定，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）旗下管理的申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，基础份额申万环保份额场内简称：申万环保（163114）/分级份额申万环保A份额场内简称：环保A（150184），申万环保B份额场内简称：环保B（150185））以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自2020年8月14日至2020年9月10日17:00止，审议《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。本次《议案》于2020年9月11日获表决通过，基金份额持有人大会决议自该日起生效。本公司于2020年9月12日在证券日报、本公司网站（www.swsmu.com）发布了《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。上述具体安排详见基金管理人发布的相关公告。

本基金转型实施前的选择期自2020年9月14日起，至2020

年 10 月 20 日止。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择卖出申万环保 A 份额、申万环保 B 份额或赎回申万环保份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的申万环保份额、申万环保 A 份额与申万环保 B 份额将在份额转换基准日，即 2020 年 10 月 21 日进行转换，最终转换为申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）之 A 类基金份额。在选择期内，基金管理人可根据实际情况对本基金申购、赎回等业务进行调整，具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回的，适用申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

本基金转型重要提示：

1、在选择期期间，由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免本基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款，并自本次基金份额持有人大会议案被表决通过之日起豁免进行基金份额折算业务。

2、基金份额转换基准日前，申万环保 A 份额和申万环保 B 份额仍可在二级市场正常交易。期间，申万环保 A 份额和申万环保 B 份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

基金份额转换基准日日终，申万环保 A 份额和申万环保 B 份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为基金份额净值为 1.0000 元的申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）之 A 类场内份额，如果投资者在转型前以溢价买入或持有，

转型后可能遭受因溢价消失带来的较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注申万环保 A 份额和申万环保 B 份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司官方网站（www.swsmu.com）等方式进行查询。

3、基金份额转换基准日后，申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）之 A 类基金份额的场内份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险。

4、由于基金转型后运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征，转型前申万环保 A 份额具有预期风险低，预期收益低的特征；申万环保 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。转型后基金的风险收益特征为，申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，该基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证环保产业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

同时，不同的销售机构采用的风险评价方法也不同，因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。提示投资者关注。

申万菱信基金管理有限公司

2020年10月15日