

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 实施转型的公告

申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）以通讯方式召开了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》”）。《议案》于2020年9月11日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本基金管理人已于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》（以下简称“《决议公告》”）。根据《决议公告》，现就转型相关的信息公告如下：

一、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据相关法律法规及《议案》的规定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》、《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同》、《申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此编制《申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]1224号(《关于准予申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金变更注册的批复》)准予变更注册。

二、关于转型方案实施的安排

本基金转型实施前的选择期为自2020年9月14日至2020年10月20日。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。

三、本基金的终止上市

本基金目前上市交易的份额为申万环保A份额以及申万环保B份额,基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则等申请办理申万环保A份额和申万环保B份额的终止上市等相关业务。具体安排详见基金管理人届时发布的本基金终止上市的相关公告。

四、本基金基金份额的转换

本基金的基金份额转换基准日为 2020 年 10 月 21 日。基金管理人在份额转换基准日将本基金各类基金份额转换成基金份额净值为 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 类基金份额。

在份额转换基准日，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统登记在册的场内申万环保份额、申万环保 A 份额和申万环保 B 份额将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 类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统登记在册的场外申万环保份额将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 类基金份额的场外份额。

申万环保 A 份额（或申万环保 B 份额）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 类基金份额的场内基金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存在误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险；对于持有份额数较少的申万环保 A 份额、申万环保 B 份额和申万环保场内份额持有人，将面临因持有的基金份额转换后份额数不足 1 份而被计入基金财产的风险。

由申万环保份额的场内份额或申万环保份额的场外份额转换的申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）之 A 类基金份额的份额数 = 申万环保份额的场内份额或申万环保份额的场外份额数 × 份额转换基准日申万环保份额的基金份额净值 ÷ 1.0000

由申万环保 A 份额转换的申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）之 A 类基金份额的份额数 = 申万环保 A 份额的场内份额数 × 份额转换基准日每份申万环保 A 份额的基金份额参考净值 ÷ 1.0000

由申万环保 B 份额转换的申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金(LOF) 之 A 类基金份额的份额数=申万环保 B 份额的场内份额数×份额转换基准日每份申万环保 B 份额的基金份额参考净值÷1.0000

为尽可能减少因基金份额净值、基金份额参考净值小数保留位数带来的计算误差，以上计算时采用的基金份额净值、基金份额参考净值的小数保留位数可能会多于公布的基金份额净值、基金份额参考净值的小数保留位数。

基金份额转换后，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。经基金份额转换后，申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金(LOF) 之 A 类基金份额的场外份额数采用截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产。

申万环保 A 份额和申万环保 B 份额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 类场内份额的持有期将按照中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的相关规则执行，投资者持有的转换后的场内份额持有期将自份额转换处理日开始计算，若投资者选择赎回，将适用该持有期对应的赎回费率。中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司另有规定的，从其规定。

场外申万环保份额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 类场外份额的基金份额持有期在转换前后连续计算。

五、本基金转型后基金合同的生效

自 2020 年 10 月 23 日起，《申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（ LOF ）基金合同》、《申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（ LOF ）托

管协议》生效，原《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》、《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》同日起失效。

《申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，基金管理人将根据相关规定办理申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）的申购赎回、上市交易等业务。具体情况详见基金管理人届时发布的相关公告。

本基金转型后的申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）新增的C类基金份额向场外投资者销售，详见本基金管理人届时发布的基金合同等法律文件及相关公告。

六、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。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2020 年 10 月 15 日

