

关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当申万环保份额(场内简称:申万环保,基金代码:163114)的基金份额净值大于或等于1.5000元时,本基金将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2020年9月1日,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”)之基础份额(申万环保份额)的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值1.5000元,在此提请投资者密切关注申万环保份额近期净值的波动情况。

针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:

一、本基金之申万环保A份额(场内简称:环保A,基金代码:150184)表现为低风险、收益相对稳定的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时,将不改变申万环保A份额的基金份额参考净值及其份额数。

二、本基金之申万环保B份额(场内简称:环保B,基金代码:150185)表现为预期风险高、预期收益高的特征,当发生合同规定的不定期份额折算时,将申万环保B份额的基金份额参考净值超过申万环保A份额的基金份额参考净值的部分,折算成场内的申万环保份额,即原申万环保B份额的持有人在不定期份额折算后将持有申万环保B份额和申万环保份额。因此,持有人的风险收益特征将发生一定的变化,由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。不定期份额折算后申万环保B份额将恢复到初始杠杆水平,其杠杆倍数将比折算前高。

三、申万环保A份额、申万环保B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。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。

四、根据合同规定,折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日申万环保份额的净值可能与触发折算的阈值1.5000元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》,本基金将在2020年底前完成规范整改,请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的公告。

二、若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停申万环保A份额与申万环保B份额的上市交易和申万环保份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅基金合同及《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话：400-880-8588（免长途话费）或021-962299。

三、基金管理人承诺以诚实信用、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书（更新）等相关法律文件。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2020年9月2日