

## 关于申万菱信中证军工指数分级证券投资基金之申万军工 A 份额和申万军工 B 份额终止运作、终止上市的特别风险提示公告

根据 2020 年 12 月 2 日发布的《关于申万菱信中证军工指数分级证券投资基金之申万军工 A 份额和申万军工 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，申万菱信中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，基础份额申万军工份额场内简称：申万军工（163115）；分级基金申万军工 A 份额场内简称 军工 A 级（150186），申万军工 B 份额场内简称 军工 B 级（150187））的终止上市日为 2021 年 1 月 4 日（最后交易日为 2020 年 12 月 31 日），份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。在份额折算基准日日终，以申万军工份额的基金份额净值为基准，申万军工 A 份额、申万军工 B 份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内申万军工份额。

针对本基金之申万军工 A 份额和申万军工 B 份额终止运作的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、折算基准日前（含折算基准日），申万军工 A 份额、申万军工 B 份额仍可正常交易，期间敬请投资者高度关注以下风险：

（1）由于申万军工 A 份额和申万军工 B 份额可能存在折溢价交易情形，本次基金合同修订后，其折溢价率可能发生较大变化，**如果投资者以溢价买入或持有，折算后可能遭受较大损失**（具体折算方式及示例详见风险提示第 4 条及修订后的基金合同条款）。

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军工 A 份额和申万军工 B 份额的基金份额参考净值变化情况（可通过本公司网站查询）。

（2）申万军工 A 份额具有低预期风险、预期收益低的特征，但在份额折算后，申万军工 A 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的申万军工份额，由于申万军工份额为跟踪中证军工指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，**原申万军工 A 份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。**

申万军工 B 份额具有一定的杠杆属性，具有高预期风险、预期收益高的特征，但在份额折算后，申万军工 B 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的申万军工份额，由于申万军工份额为跟踪中证军工指数的基础份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，不会形成杠杆性收益或损失，但原申万军工 B 份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、申万军工 A 份额和申万军工 B 份额折算为申万军工份额前，申万军工 A 份额和申万军工 B 份额的持有人有两种方式退出：

（1）在场内按市价卖出基金份额；

（2）在场内买入等量的对应份额（即申万军工 A 份额持有人买入等量的申万军工 B 份额，或者申万军工 B 份额持有人买入等量的申万军工 A 份额），合并为申万军工份额，按照申万军工份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

3、本次基金合同修订后，由于申万军工 A 份额和申万军工 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场

内流动性不足的情况，**特提请投资者注意流动性风险。**

4、在份额折算基准日日终，以申万军工份额的基金份额净值为准，申万军工 A 份额、申万军工 B 份额按照各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算成场内申万军工份额。申万军工 A 份额和申万军工 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内申万军工份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

**折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。**

**申万军工 A 份额和申万军工 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化，示例如下：**

假设份额折算基准日申万军工份额、申万军工 A 份额和申万军工 B 份额的基金份额（参考）净值的分别为：0.7945 元、1.0032 元、0.5858 元，投资者甲、乙、丙分别持有场内申万军工份额、申万军工 A 份额、申万军工 B 份额各 100,000 份，其所持基金份额的变化如下表所示：

|           | 折算前                   |             | 份额折算比例                            | 折算后           |                       |
|-----------|-----------------------|-------------|-----------------------------------|---------------|-----------------------|
|           | 基金份额<br>(参考)净值<br>(元) | 基金份额<br>(份) |                                   | 基金份额净值<br>(元) | 基金份额                  |
| 场内申万军工份额  | 0.7945                | 100,000     | 无变化                               | 0.7945        | 100,000 份场内<br>申万军工份额 |
| 申万军工 A 份额 | 1.0032                | 100,000     | 1.262680931 (全部<br>折算为申万军工份<br>额) | 0.7945        | 126,268 份场内<br>申万军工份额 |

|           |        |         |                             |        |                  |
|-----------|--------|---------|-----------------------------|--------|------------------|
| 申万军工 B 份额 | 0.5858 | 100,000 | 0.737319069 ( 全部折算为申万军工份额 ) | 0.7945 | 73,731 份场内申万军工份额 |
|-----------|--------|---------|-----------------------------|--------|------------------|

5、申万军工 A 份额和申万军工 B 份额折算为申万军工份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额，也可以在申万军工份额符合条件上市后选择二级市场卖出。对于投资者所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因导致无法直接办理场内赎回的，可先转托管至场外后申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后申请赎回。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，申万军工 A 份额和申万军工 B 份额合并或折算为申万军工份额后，基金份额持有期自申万军工份额确认之日起计算。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书的约定，本基金的赎回费率如下：

( 1 ) 场外赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，具体如下：

| 持有时间 ( T )     | 赎回费率  |
|----------------|-------|
| T < 7 日        | 1.50% |
| 7 日 ≤ T < 6 个月 | 0.50% |
| 6 个月 ≤ T < 1 年 | 0.25% |
| T ≥ 1 年        | 0.00% |

注：月按 30 日计算，年按 365 日计算。

## （2）场内赎回费率

本基金的场内赎回费率为 7 日内 1.50%，7 日及以上 0.50%。

申万军工份额的赎回费用由赎回申万军工份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回申万军工份额时收取，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的投资者，赎回费用不纳入基金财产，用于支付市场推广、销售、登记费和其他必要的手续费。

本公司承诺诚实信用地管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件。

投资者可登陆基金管理人网站（[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)）或拨打客服电话 4008808588（免长途话费）咨询相关信息。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2020 年 12 月 2 日