

# 申万菱信沪深300价值指数证券投资基金（申万菱信 沪深300价值指数A）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月17日

送出日期：2024年6月25日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	申万菱信沪深300价值指数	基金代码	310398
下属基金简称	申万菱信沪深300价值指数	下属基金代码	310398
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2010-02-11		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	赵兵	开始担任本基金基金经理的日期	2022-03-15
		证券从业日期	2007-02-01

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

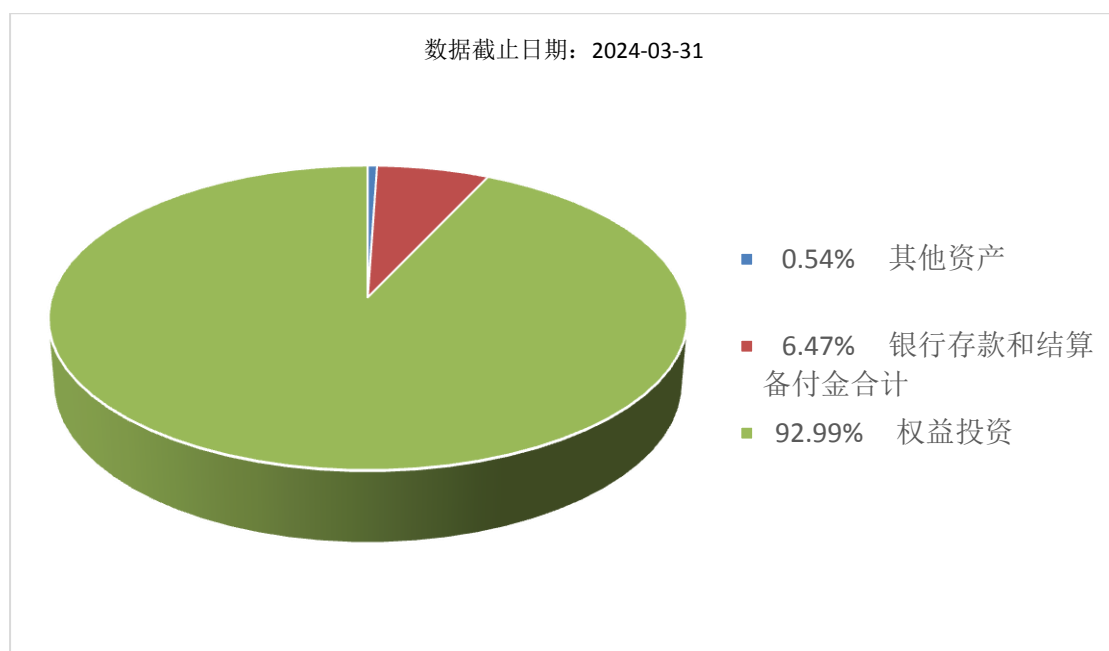
请阅读招募说明书第七部分了解详细情况。

投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对沪深300价值指数的有效跟踪。
投资范围	本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深300价值指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深300价值指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金原则上将不低于90%的基金资产净值投资于沪深300价值指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于15%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效

	跟踪。
<b>主要投资策略</b>	本基金主要采取完全复制法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
<b>业绩比较基准</b>	沪深300价值指数收益率 × 95% + 银行同业存款利率 × 5%。
<b>风险收益特征</b>	本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

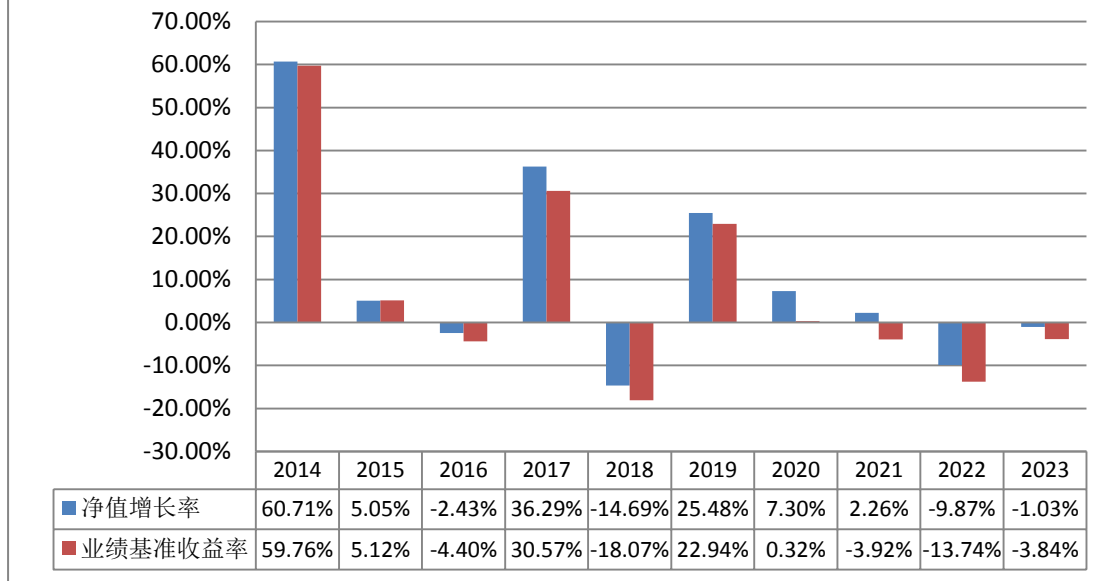
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表



## (三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

数据截止日期：2023-12-31



注：1、基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。  
2、基金的过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.20%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	非养老金客户
	500 万元 ≤ M < 1,000 万元	0.20%	非养老金客户
	M ≥ 1,000 万元	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.48%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%	养老金客户
	500 万元 ≤ M < 1,000 万元	0.02%	养老金客户
	M ≥ 1,000 万元	500 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 365 天	0.50%	
	365 天 ≤ N < 730 天	0.25%	
	N ≥ 730 天	0.00%	

### 申购费：

养老金客户特定申购费率仅适用于通过基金管理人直销中心申购的养老金客户。

## （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.65%	基金管理人、销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
审计费用	60,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
指数许可使用费	0.0200%	指数编制公司
其他费用	基金合同生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
0.83%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的招募说明书等销售文件。

本基金面临的主要风险有：

#### 1、本基金特有的风险

（1）指数投资的相关风险，本基金的标的指数成分股的价格可能受到各种因素的影响而波动，从而可能使得基金收益水平发生变化，产生风险；本基金的跟踪标的可能因调整成分股、变更编制方法、配股、增发、派发红利、停牌摘牌等各种因素使得本基金在投资过程中产生基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险。另外，本基金可能出现变更标的指数的情形，调整后本基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。本基金因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差控制未达约定目标的风险；本基金因可能面临因指数编制机构停止服务而导致投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同、指数表现与相关市场表现存在差异等风险；本基金可能因成份股停牌而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大、影响投

投资者的投资损益或基金可能无法及时卖出成份股以支付投资人的赎回申请。

(2) 本基金可投资存托凭证。CDR 属于市场创新产品, 交易价格存在大幅波动的风险。本基金作为存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当, 但并不能等同于直接持有境外基础证券。本基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。存托凭证存续期间, 存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化, 对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形, 部分变化可能仅以事先通知的方式即对基金生效, 基金可能无法对此行使表决权, 也可能存在失去应有权利的风险。存托凭证如退市, 本基金可能面临存托人无法卖出基础证券、存托凭证无法公开交易或转让的风险。此外, 存托人可能向本基金收取存托凭证相关费用。

2、市场风险, 主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险等。

3、流动性风险, 主要包括投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现的风险以及开放式基金由于申购赎回要求而可能导致流动资金不足的风险。

4、信用风险, 包括金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。

5、管理风险, 包括基金管理人的专业、研究或投资水平对基金的投资收益产生影响的风险以及基金管理人的投资管理、风险管理等内部控制制度能否有效防范道德风险和其他合规性风险的风险。

6、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。由于不同销售机构采用的评价方法的不同, 因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同, 投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

7、本基金运作风险主要包括基金进入清算期的风险、投资者申购失败的风险、税负增加风险。

8、其他风险主要包括营运风险、道德风险、不可抗力风险等。

## **(二) 重要提示**

1、中国证监会对本基金募集的核准, 并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。

2、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则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。

3、基金投资者自依基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

4、基金产品资料概要信息发生重大变更的, 基金管理人将在三个工作日内更新, 其他信息发生变更的, 基金管理人每年更新一次。因此, 本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后, 如需及时、准确获取基金的相关信息, 敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

5、因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为北京市。

## **五、其他资料查询方式**

以下资料详见基金管理人网站: [www.swsmu.com](http://www.swsmu.com), 客服电话: 400-880-8588(免长途话费) 或 021-962299

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告, 包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料