

申万菱信中证军工指数分级证券投资基金（军工A级）

基金产品资料概要

编制日期：2020年8月25日

送出日期：2020年8月26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	申万菱信中证军工指数分级	基金代码	163115
下属基金简称	军工A级	下属基金代码	150186
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2014-07-24	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2014-08-11
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	龚丽丽	开始担任本基金基金经理的日期	2019-11-27
		证券从业日期	2011-05-01

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

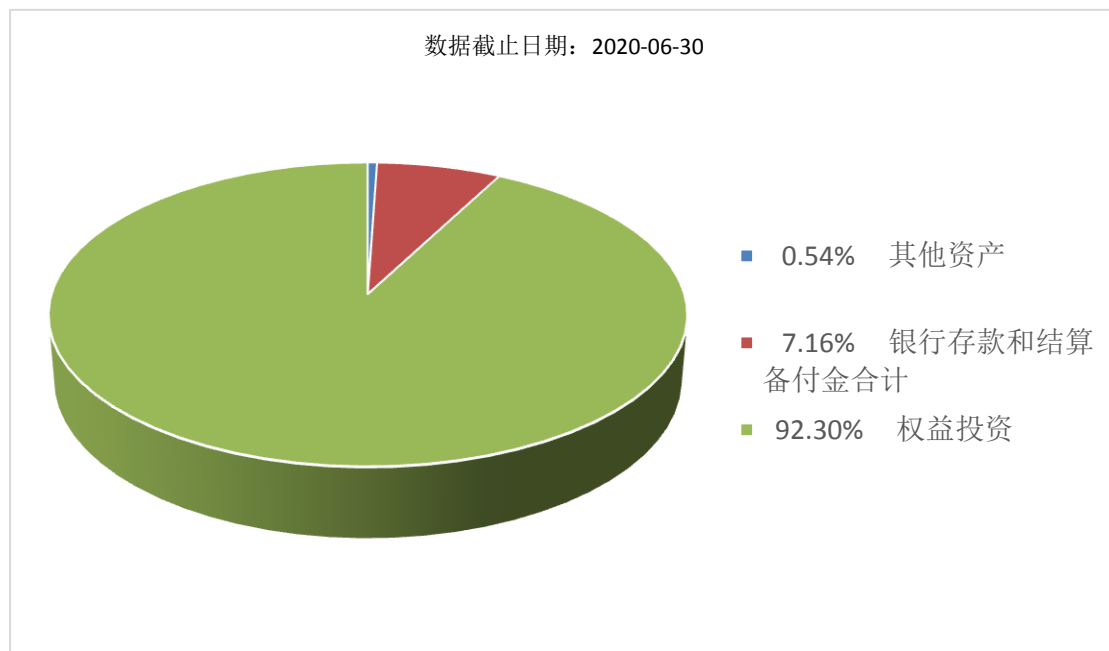
请阅读《招募说明书（更新）》第十三部分了解详细情况。

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均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证军工指数的有效跟踪。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。
主要投资策略	本基金主要采用完全复制的方法进行投资，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。

业绩比较基准	95%×中证军工指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万军工份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；申万军工A份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；申万军工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。

(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) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

无。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

(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
管理费	1.00%
托管费	0.22%

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) 本基金采用被动指数投资，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。

(2) 分级基金运作的相关风险：

本基金作为分级基金，申万军工 A 份额与申万军工 B 份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金。对申万军工 A 份额的持有人，如果约定年基准收益率发生调整，那么申万军工 A 份额的约定收益率将出现变化，申万军工 A 份额的持有人将面临申万军工 A 份额价格出现较大波动的风险。另外，本基金的主要风险来自于基金份额的折溢价交易及份额折算机制。受投资者预期、市场情绪、供求关系和价格涨跌幅限制等方面的影响，申万军工 A 份额和申万军工 B 份额市场价格可能会偏离其基金份额参考净值，交易时可能存在较高的折溢价，此外，由于份额配对转换下套利机制的影响，申万军工 A 份额与申万军工 B 份额的交易价格可能会互相影响。在份额折算时，可能面临由于尾差处理而给投资者带来损失、因二级市场做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，因而在份额折算后新增份额面临无法赎回的情形，以及不定期折算基准日基金份额净值/基金份额参考净值与折算阈值不同等风险。在实施基金份额折算后，申万军工 A 份额持有人或申万军工 B 份额持有人将会获得一定比例的申万军工份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

(3) 本基金可投资于股指期货，投资过程中因采取保证金交易，风险较现货市场更高，极端情况下期货市场波动可能对基金资产造成不良影响，因而存在一定的市场风险；因市况急剧走向某个极端或进行了某种特殊交易但不能如愿处理资产，或因无法缴足保证金的资金而存在一定的流动性风险等。

(4) 本基金可投资资产支持证券，在投资过程中可能存在因债务人的违约或交割违约、资产支持证券信用质量降低而产生的信用风险，因利率变化等原因债务人进行提前偿付而导致的提前偿付风险，因市场交易不活跃而导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

2、市场风险，主要包括经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险、期货市场波动风险、国际竞争风险、政策风险、再投资风险等。

3、其他还包括流动性风险、信用风险、管理风险、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、税负增加风险、投资者申购失败的风险、基金进入清算期的风险、道德风险、营运风险、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注册，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, 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