

申万菱信中证沪港深数字经济主题指数型发起式证券投资基金（申万菱信中证沪港深数字经济主题指数型发起式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	申万菱信中证沪港深数字经济主题指数型发起式	基金代码	018207
下属基金简称	申万菱信中证沪港深数字经济主题指数型发起式A	下属基金代码	018207
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2023-05-23		
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	廖裕舟	开始担任本基金基金经理的日期	2023-05-23
		证券从业日期	2016-07-01

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九部分了解详细情况。

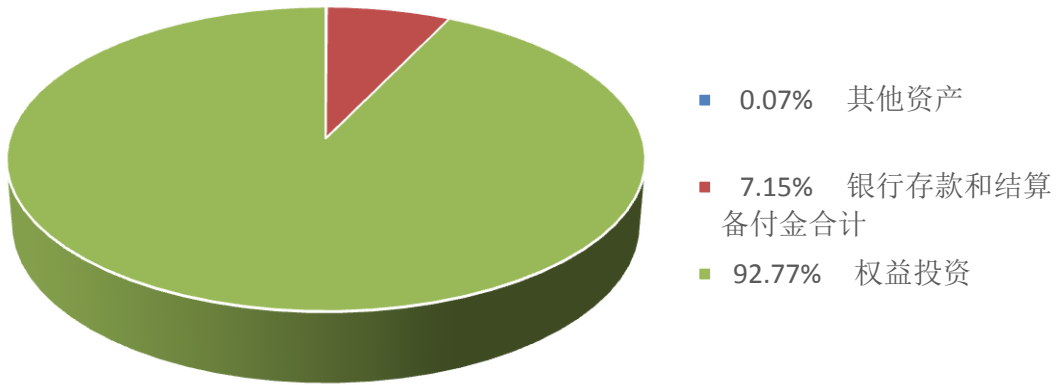
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等）、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

	<p>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。</p> <p>在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。股票期权、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过0.35%，年跟踪误差争取不超过4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证沪港深数字经济主题指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于股票型基金，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。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证沪港深数字经济主题指数，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。</p> <p>本基金除了投资A股以外，还可根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

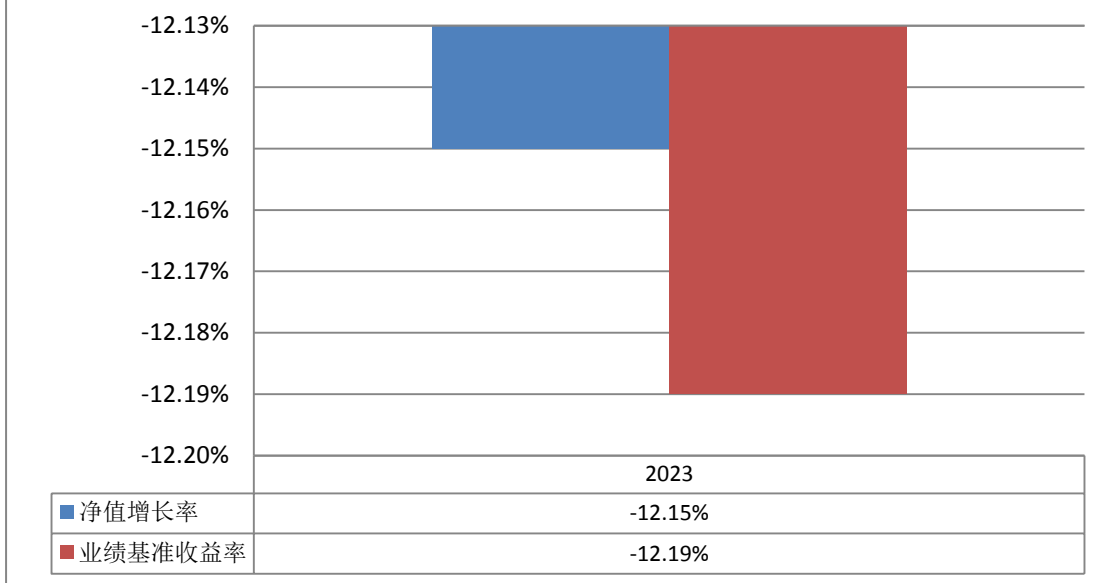
投资组合资产配置图表

数据截止日期：2024-03-31



(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

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 < 300 万元	0.80%	非养老金客户

	300 万元 \leq M < 500 万元	0.50%	非养老金客户
	M \geq 500 万元	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.36%	养老金客户
	100 万元 \leq M < 300 万元	0.24%	养老金客户
	300 万元 \leq M < 500 万元	0.15%	养老金客户
	M \geq 500 万元	300 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 \leq N < 180 天	0.50%	
	180 天 \leq N < 365 天	0.25%	
	N \geq 365 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	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	44,000.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	规定披露报刊
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）
1.01%

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) 本基金采用指数投资，标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数收益率与股票市场平均收益率可能存在偏离。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、退市等各种因素及投资过程中的交易成本、基金管理费用、最低买入股数限制、基金申购和赎回带来的现金变动、指数编制机构指数编制错误等因素，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) 本基金可投资于金融期货，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；国债期货因交割成本提高、临近交割期最便宜可交割券流动性不足或卖方未能在规定时间内如数交付而带来交割风险；

(3) 本基金可投资股票期权，其市值将会受到合约、标的物或市场等多个因素的影响，在极端情况下可能会给基金资产造成不良影响，因而存在一定的市场风险；因未能及时准备好足额的资金或者证券，构成行权资金交收违约或者行权证券交割违约而存在一定的行权风险；因无法及时建立或了结头寸，无法缴足保证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收违约、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。

(5) 本基金可参与融资业务。因融资业务具有杠杆效应，可能放大投资损失，且市场利率的变动、外部监管等均会对融资业务造成影响，因此存在一定的市场风险；因基金不能按照约定的期限清偿债务或不能按照约定的时间追加担保物时将会面临强制平仓，因而存在一定的流动性风险；因对手方证券公司因各种原因而没有或无法履行融资合同义务，可能会给基金资产造成不良影响，因此存在一定的信用风险。

(6) 本基金可投资转融通业务。主要将面临因证券出借而无法及时变现支付赎回款项的流动性风险；因证券出借对手方无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的信用风险；以及因证券出借后可能面临证券出借期无法及时处置证券的市场风险。

(7) 本基金可投资存托凭证。CDR 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并不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。存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，部分变化可能仅以事先通知的方式即对基金生效。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。

(8) 本基金可在港股通机制下投资港股。本基金可将部分基金资产投资于港股。主要风险包括港股价格与海外资金流动表现出高度相关性而导致系统性风险，港股市场实行T+0回转交易机制和不设个股涨跌幅限制导致基金净值波动较大，港股买卖每日结算的换汇操作

导致汇率风险；港股通规则变动、额度限制、投资标的调整导致错失投资机会或基金净值波动；港股的交易日与内地不同导致本基金所持港股组合在资产估值上波动增大；交收制度以及交易日设定的不同，导致投资比例超标或支付赎回款日期相对延后而带来流动性风险；交易所制度的差异，可能导致所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

(9) 本基金可投资北交所。可能面临流动性风险、投资集中风险、经营风险、退市风险、股价大幅波动风险、监管规则变化风险等。

2、其他还包括市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、投资者申购失败风险、基金进入清算期的风险、启用侧袋机制的风险、税负增加风险、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、技术风险、道德风险、合规风险、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，应提交深圳国际仲裁院，按照该机构届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。

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