

## 申万菱信沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 02 月 10 日

送出日期：2026 年 02 月 11 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 ETF	基金代码	560330
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	2023 年 05 月 11 日	上市交易所及上市日 期	上海证券交易所
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	王贊杰	开始担任本基金基金 经理的日期	2023 年 05 月 11 日
基金扩位简称	沪深 300 价值 ETF 申万菱信	证券从业日期	2011 年 07 月 01 日

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

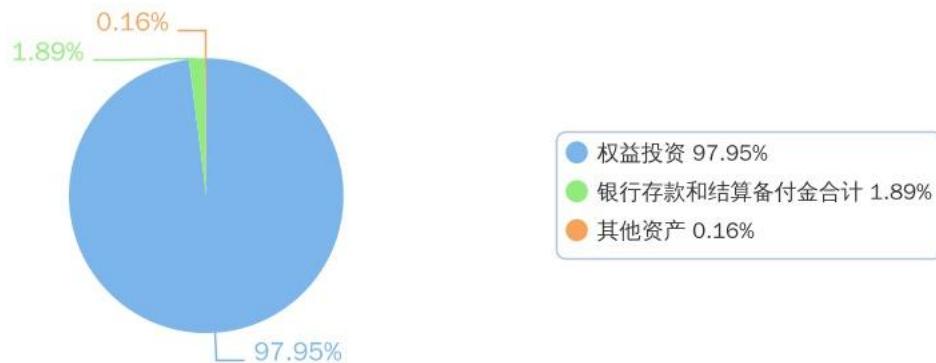
请阅读招募说明书第十一部分了解详细情况。

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。 本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。
投资范围	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）、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。 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。 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，在扣除股指期货、国债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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包

	括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。 如法律法规或中国证监会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。
<b>主要投资策略</b>	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。 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）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 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 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。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。
<b>业绩比较基准</b>	沪深 300 价值指数收益率
<b>风险收益特征</b>	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。 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，跟踪沪深 300 价值指数，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。

## （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（数据截至日期：2025年12月31日）



## （三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2024年12月31日



- 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

##### 申购费：

投资者在申购基金份额时，申购代理券商可以按照不超过 0.5% 的标准收取佣金。

##### 赎回费：

投资者在赎回基金份额时，赎回代理券商可以按照不超过 0.5% 的标准收取佣金。

#### (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%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	33,000.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	规定披露报刊
IOPV 费用	20,000.00	IOPV 计算服务机构
注册登记费	120,000.00	中国证券登记结算有限责任公司
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）

0.91%

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，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) ETF 基金的特定风险，本基金的基金份额参考净值（IOPV）与实时的基金份额净值可能存在差异或计算错误，由此导致投资人的损失需由投资人自行承担；因申购时未能提供申购对价或赎回时持有基金份额或现金不足或组合中不具备组合的赎回对价均可能产生投资者申赎失败的风险；基金份额赎回对价因市场或流动性变化等原因存在变现风险；因申购赎回清单差错，正常申赎将受影响，可能使得投资人利益受损；因证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此存在一定的套利风险；以及因本基金的多项服务委托第三方机构办理，因各种原因导致第三方机构的代理服务、结算制度或方式、第三方机构的违约均可能使投资者利益受损，因此存在第三方机构服务的风险；由于本基金的基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，因此存在折溢价的风险；当本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易，因此存在

退市风险。本基金“非沪市证券交易所成份证券申赎处理规则”可能给申购和赎回投资人带来价格的不确定风险。现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准，由此投资者的利益可能受到影响。

(3) 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；

(4) 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

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 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。

(9) 本基金可投资北交所。可能面临投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险、流动性风险、上市公司经营风险、上市公司退市风险等。

(10) 本基金可投资科创板。上海证券交易所科创板股票相比 A 股其他板块股票，将承担因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有风险。

2、其他还包括市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、基金进入清算期的风险、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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该机构届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

## 六、其他情况说明