

# 申万菱信国证2000指数增强型发起式证券投资基金 (申万菱信国证2000指数增强型发起式A)基金产品资 料概要

编制日期：2022年6月13日

送出日期：2022年6月15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	申万菱信国证2000指数增强型发起式	基金代码	015921
下属基金简称	申万菱信国证2000指数增强型发起式A	下属基金代码	015921
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	基金托管人	北京银行股份有限公司
基金合同生效日	-		
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	王剑	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2015-07-01

## 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	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金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0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
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（包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、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。 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。

主要投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化, 在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下, 力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	国证2000指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为增强型指数基金, 其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金除了投资A股以外, 还可以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。

## (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

无。

### (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

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
认购费	M < 100 万元	1.00%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.60%	非养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.30%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.18%	养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.09%	养老金客户
	M ≥ 500 万元	300 元/笔	养老金客户
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 ≤ M < 500 万元	0.50%	非养老金客户
	M ≥ 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	0.00%	

#### 认购费:

养老金客户特定认购费率仅适用于通过基金管理人直销中心认购的养老金客户。

#### 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
管理费	1.00%
托管费	0.15%

注: 1、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金资产中列支的其他费用。

2、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。

## 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) 本基金采用指数增强投资策略, 本基金的标的指数为国证 2000 指数, 其成份股票反映 A 股市场小型股票的价格变动趋势, 但并不能完全代表整个股票市场, 标的指数的收益率与整个股票市场的平均收益率可能存在偏离; 本基金的标的指数成份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份股、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; 根据本基金的投资策略, 为了获得稳定适度的超额收益, 可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整, 最终结果仍然存在一定的不确定性, 其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。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, 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；因市况急剧走向极端或不能如愿处理资产，或因无法缴足保证金而存在一定的流动性风险等；国债期货因交割成本提高、可交割券流动性不足或卖方未能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) 本基金可参与转融通业务。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上市股票，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。

2、其他风险还包括市场风险、信用风险、管理风险、发起式基金自动终止的风险、税负增加的风险、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、流动性风险、投资者申购失败的风险、基金进入清算期的风险、启用侧袋机制的风险、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](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