

关于申万菱信沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金投资重大关联方证券的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《关于同意完全按照指数构成比例投资的基金品种按照〈基金法〉规定从事关联交易的复函》的有关规定，在基金管理人履行相关程序后，允许完全按照有关指数构成比例进行证券投资的基金品种投资基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券。申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”)管理的申万菱信沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金(场内简称:300 价值 E,基金代码:560330)主要采用完全复制法进行投资,按照成份股在沪深 300 价值指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合。其中,沪深 300 价值指数成份股工商银行(601398)为基金托管人发行的股票,申万宏源(000166)为基金管理人控股股东发行的股票。

为最大限度地降低上述各基金投资的跟踪误差,保护基金份额持有人的合法权益,本基金管理人已按规定履行相关程序,有关制度和控制措施已准备,现将基金托管人及基金管理人控股股东发行的股票纳入基金的投资标的,并将严格按法律、法规和本基金合同的规定进行日常投资管理。相关投资情况将按规定在基金的定期报告中进行披露。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用

基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于上述基金时应认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2023年5月13日