

申万菱信中小企业100指数证券投资基金(LOF)（申万菱信中小企业100指数(LOF)A）基金产品资料概要更新

编制日期：2023年12月20日

送出日期：2023年12月28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 | 申万菱信中小企业 100 指数(LOF) | 基金代码 | 163111 |
| 下属基金简称 | 申万菱信中小企业 100 指数(LOF)A | 下属基金代码 | 163111 |
| 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 | 2012-05-08 | 上市交易所及上 市日期 | 深圳 证 券 交 易 所 2017-05-26 |
| 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 | 王贇杰 | 开始担任本基金 基金经理的日期 | 2020-07-22 |
| | | 证券从业日期 | 2011-07-01 |

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十二部分了解详细情况。

| | |
|--------|---|
| 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%，实现对中小企业100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（包括其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 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。 本基金投资于中小企业100指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%，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。 在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份 |

股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

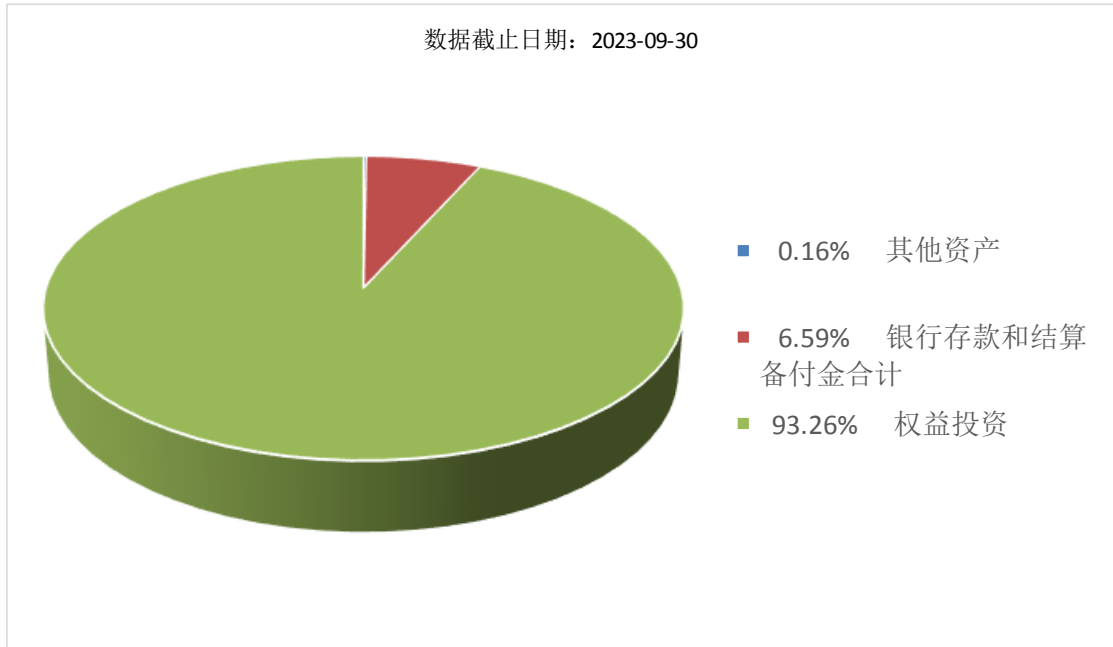
业绩比较基准

95%×中小企业100指数收益率+5%×银行同业存款利率

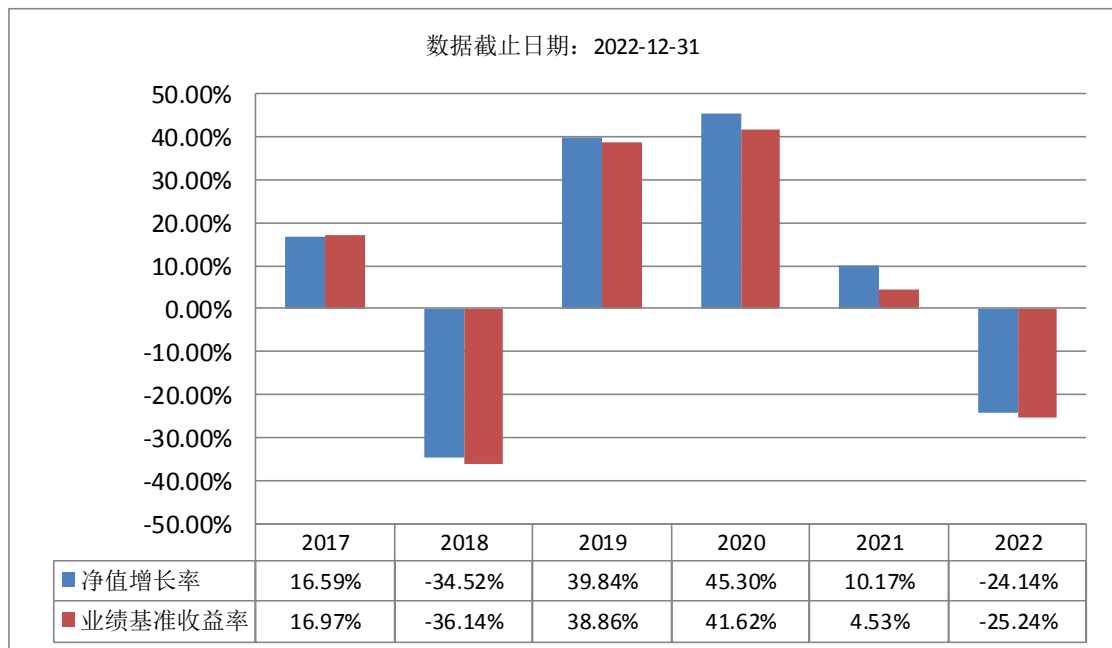
风险收益特征

本基金具有预期风险较高、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。

(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) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

根据基金合同约定，本基金2017年5月8日结束分级运作机制，并于2017年5月9日变更为LOF

基金。

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% | 场外非养老金客户 | |
| | 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.70% | 场外非养老金客户 | |
| | M ≥ 500 万元 | 1000 元/笔 | 场外非养老金客户 | |
| | M < 100 万元 | 0.48% | 场外养老金客户 | |
| | 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.14% | 场外养老金客户 | |
| | M ≥ 500 万元 | 500 元/笔 | 场外养老金客户 | |
| | M < 500 万元 | 0.00% | 场内 | |
| | M ≥ 500 万元 | 1000 元/笔 | 场内 | |
| | 赎回费 | N < 7 天 | 1.50% | 场外 |
| | | 7 天 ≤ N < 365 天 | 0.50% | 场外 |
| 365 天 ≤ N < 730 天 | | 0.25% | 场外 | |
| N ≥ 730 天 | | 0.00% | 场外 | |
| N < 7 天 | | 1.50% | 场内 | |
| N ≥ 7 天 | | 0.50% | 场内 | |

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 | 0.65% |
| 托管费 | 0.12% |

注： 1、本基金年指数使用费率为0.02%。自《基金合同》生效之日所在季度的下一季度起，

指数使用费收取下限为每季度5万元，即不足5万元时按照5万元收取。

2、信息披露费用、会计师费和律师费及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。

3、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）指数投资的相关风险，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。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）本基金可投资存托凭证。CDR属于市场创新产品，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实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能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。存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，部分变化可能仅以事先通知的方式即对基金生效，基金可能无法对此行使表决权，也可能存在失去应有权利的风险。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。

2、市场风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险等。

3、流动性风险，主要包括投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现的风险以及开放式基金由于申购赎回要求而可能导致流资金不足的风险。

4、信用风险，包括金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。

5、管理风险，包括基金管理人的专业、研究或投资水平对基金的投资收益产生影响的风险以及基金管理人的投资管理、风险管理等内部控制制度能否有效防范道德风险和其他合规性风险的风险。

6、本基金运作风险主要包括基金进入清算期的风险、投资者申购失败的风险。

7、其他风险主要包括营运风险、道德风险、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