

# 申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)(申万菱信中证环保产业指数(LOF)C)基金产品资料概要

## 更新

编制日期：2022年12月7日

送出日期：2022年12月27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    | 申万菱信中证环保产业指数(LOF)               | 基金代码           | 163114       |
| 下属基金简称  | 申万菱信中证环保产业指数(LOF)C              | 下属基金代码         | 010419       |
| 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 | 2020-10-23                      |                |              |
| 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    | 王贇杰                             | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-10-23   |
|         |                                 | 证券从业日期         | 2011-07-01   |
| 其他      | 本基金由申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金变更注册而来。 |                |              |

### 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。

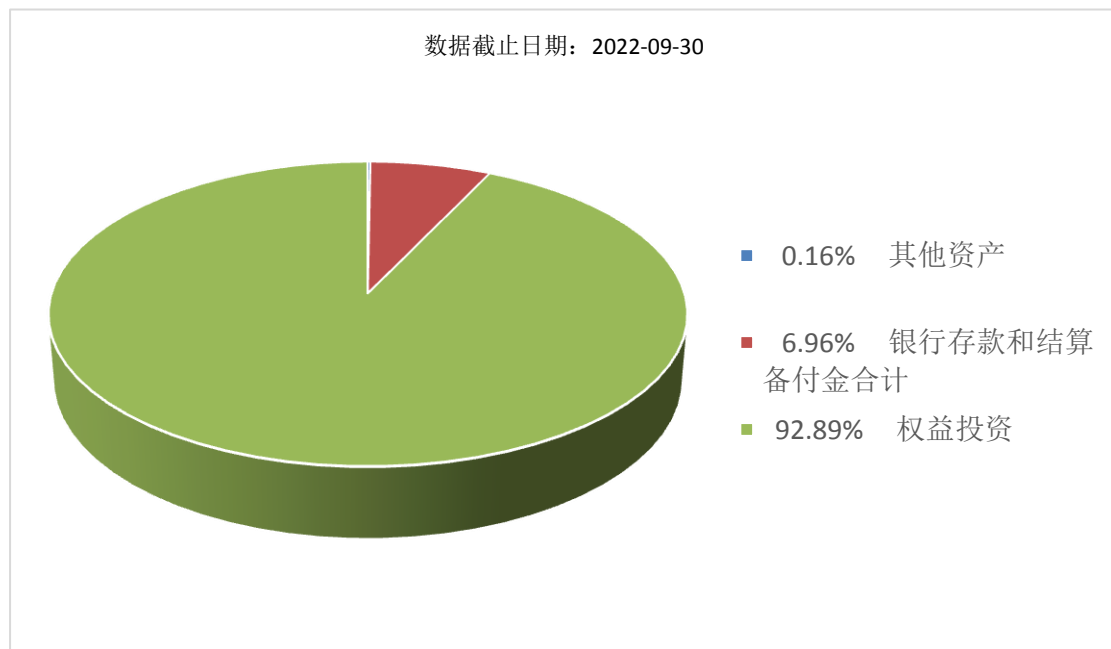
**投资目标** 本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对标的指数的有效跟踪。

**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、中小板、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其

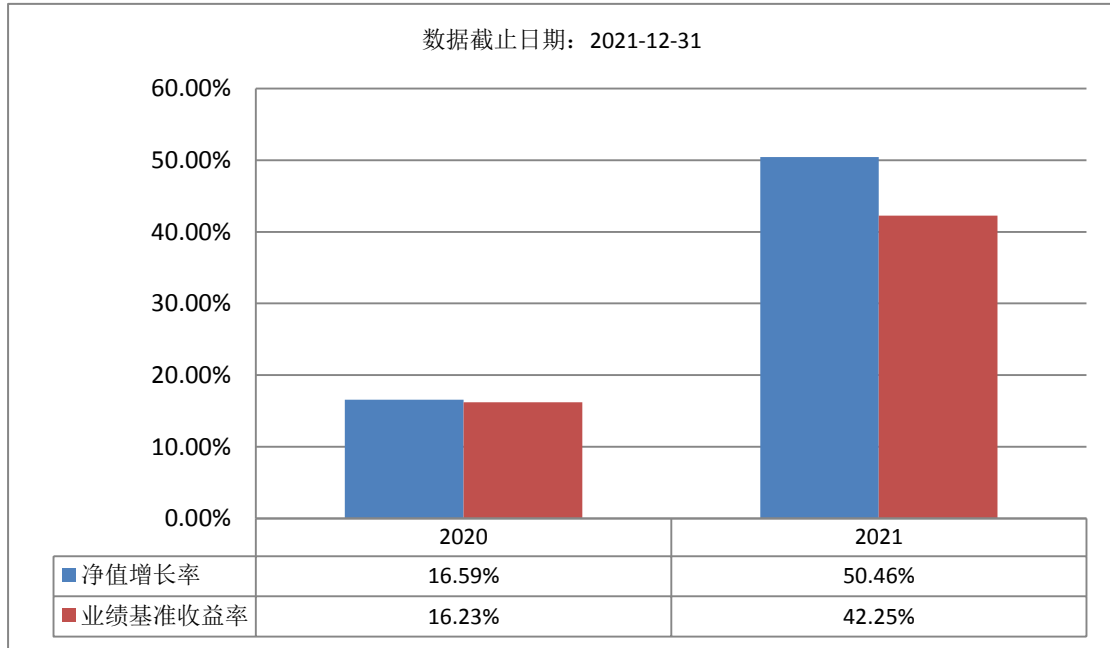
|        |   |
|--------|---|
|        | <p>纳入投资范围。</p> <p>本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</p>                  |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要采用完全复制的方法进行投资，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。</p> <p>本基金可以投资于债券和资产支持证券等固定收益类工具，固定收益类资产投资的目的是有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本基金的业绩比较基准为中证环保产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p>  |
| 风险收益特征 | <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，跟踪中证环保产业指数，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>  |

## (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) 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



注：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)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|------|-----------------------------|---------|----|
| 赎回费  | N < 7 天                     | 1.50%   |    |
|      | N ≥ 7 天                     | 0.00%   |    |

注：本基金C类份额不收取申购费。

#### （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   | 1.0%     |
| 托管费   | 0.22%    |
| 销售服务费 | 0.30%    |
| 指数使用费 | 0.02%    |

注：1、指数许可使用费按前一日的基金资产净值的万分之二（贰个基点）的年费率计提。标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元（伍万元），计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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) 本基金采用被动指数投资，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；本基金的标的指数为中证环保产业指数，并不能完全代表整个股票市场，因此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的风险；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) 本基金份额可在二级市场交易，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；其次，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。

(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；因市场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) 本基金可参与转融通证券出借业务。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融券费用的信用风险；以及因证券出街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 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、其他还包括市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、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、税负增加的风险、投资者申购失败的风险、基金进入清算期的风险、其他风险主要包括技术风险、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