

# 申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(申万菱信量化小盘股票(LOF)C)基金产品资料概要更新

编制日期: 2023年7月31日

送出日期: 2023年8月19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    | 申万菱信量化小盘股票(LOF)  | 基金代码           | 163110       |
| 下属基金简称  | 申万菱信量化小盘股票(LOF)C | 下属基金代码         | 013918       |
| 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 | 2011-06-16       |                |              |
| 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 | 2021-03-22   |
|         |                  | 证券从业日期         | 2015-07-01   |

## 二、基金投资与净值表现

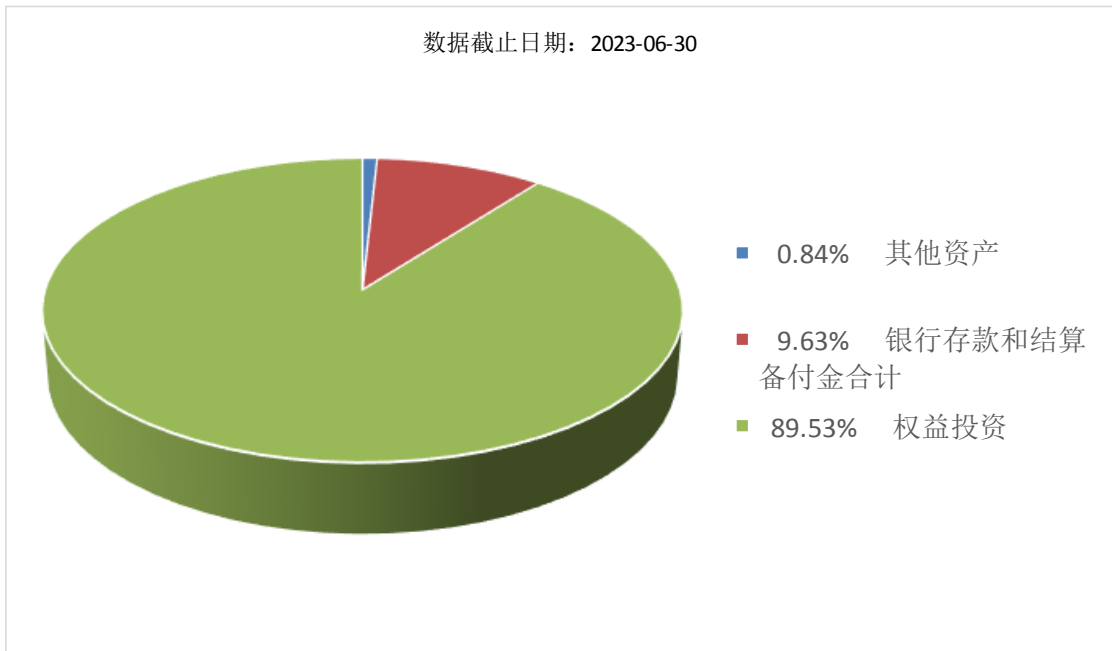
### (一) 投资目标与投资策略

请阅读招募说明书第九部分了解详细情况。

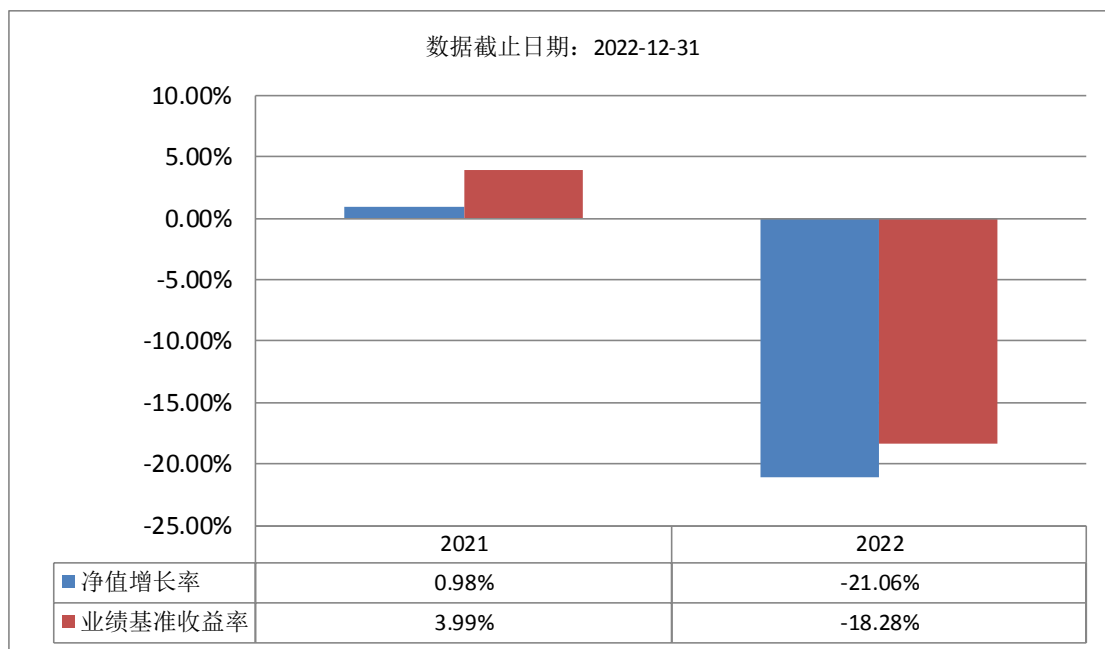
|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用数量化的投资方法精选个股,严格按照纪律执行,力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资范围 | 本基金投资于流动性良好的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。<br>本基金可以参与融资业务。<br>本基金各类资产投资比例为:本基金投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的80%,投资于本基金界定的小盘股及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于80%;每个交易日日终,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。本基金投资股指期货、权证、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。<br>本基金应在基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。 |

|                      |   |
|----------------------|---|
| <p><b>主要投资策略</b></p> | <p>本基金坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资。基金管理人基于对国内股票市场的大量实证研究，专门开发了适合小盘股投资的量化投资模型（简称“量化小盘投资模型”），作为本基金投资的核心。本基金的股票选择行为，都是基于该投资模型而定。这种完全基于模型的量化投资方法能够更加客观、公正而理性的去分析和筛选股票，并且不受外部分析师的影响，极大的减少了投资者情绪的影响，从而能够保持投资策略的一致性与有效性。</p> |
| <p><b>业绩比较基准</b></p> | <p>本基金的业绩比较基准为：90%×中证500指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）</p>   |
| <p><b>风险收益特征</b></p> | <p>本基金是一只量化股票型基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资品种，其风险收益特征从长期平均来看高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</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) 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%   |    |
|      | $7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天 | 0.50%   |    |
|      | $N \geq 30$ 天               | 0.00%   |    |

注：本基金C类份额不收取认、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   | 1.20%    |
| 托管费   | 0.20%    |
| 销售服务费 | 0.40%    |

注：1、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。

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) 本基金采用量化策略进行投资，在建立投资模型过程中，可能由于原数据错误或预处理过程中出现错误而形成数据风险；或由于定量方法的缺陷也会影响基金的表现带来风险。

(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。

(3) 本基金可投资于股指期货，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；

(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) 本基金可投资于资产支持证券，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、购买力风险、上市公司经营风险。

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动资金不足的风险。

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投资者申购失败的风险、基金进入清算期的相关风险。

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核准，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](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