

# 申万菱信基金管理有限公司

## 申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额发售公告

### 重要提示

1、申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)的募集已于2024年12月11日证监许可【2024】1798号文注册。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金为契约型开放式,ETF联接基金。

3、本基金的基金管理人和登记机构均为申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

4、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、本基金自2025年1月6日至2025年1月24日,通过申万菱信基金管理有限公司直销渠道以及各代销机构的代销网点公开发售。

6、本基金的最高募集规模为30亿元人民币(不包括募集期利息),基金首次募集规模不得超过募集目标上限,若募集期投资者的认购规模超过募集规模上限,基金管理人采取比例配售的方式对募集规模进行控制。本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

7、投资者认购本基金份额,应开立申万菱信基金管理有限公司开放式基金账户。募集期内,投资者可通过基金管理人及其他销售机构的营业网点办理开户和认购手续。

8、投资者需开立“基金账户”和“交易账户”才能办理本基金的认购手续,投资者可在不同销售机构开立交易账户,但每个投资者只允许开立一个基金账户。若投资者在不同的销售机构处重复开立基金账户导致认购失败的,本基金管理人员和代销机构不承担认购失败的责任。如果投资者在开立基金账户的销售机构以外的其他销售机构购买本基金基金份额,则需要在该代销网点办理“开立交易账户”,然后再认购本基金基金份额。个人投资者必须本人亲自办理开户和认购手续。投资者在办理完开户和认购手续后,应及时到销售网点查询认购确认结果。

9、在办理基金账户开户的同时可以办理本基金份额的认购申请手续。

10、投资者在其他销售机构首次单笔认购最低金额为人民币1元(含认购费,下同),追加认购的单笔认购最低金额为人民币1元。投资人可在直销中心首次单笔认购最低金额为10元人民币,追加认购的单笔最低金额为10元人民币。

11、基金管理人对募集期间的单个投资人累计认购金额不设上限限制。

投资人认购的基金份额以基金合同生效后登记机构的确认为准。

12、投资人认购基金期间可以多次认购本基金份额,A类基金份额的认购费按每笔A类基金份额的认购申请单独计算,认购申请一经受理不得撤销。

13、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况,调整认购的数额限制,基金管理人最迟应于调整实施前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“信息披露办法”)的有关规定在规定媒介上予以公告。

投资者认购时,须按照销售机构规定的方式备足全额缴纳认购的金额的款项。

14、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使法律法规权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

15、本公司仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读《申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)等相关法律文件。

16、本基金的基金合同、招募说明书、托管协议、基金产品资料概要及本公司将同时发布在本公司网站(www.sswsmu.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund>)。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集的相关事宜。

17、各代销机构代销本基金的营业网点以及开户和认购等事项详见各代销机构的相关业务公告。

18、在募集期内,本基金有可能新增代销机构,敬请留意近期本公司及各代销机构的公示,或拨打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

19、本公司可综合各种情况对本基金募集安排做适当调整,并予以公告。

20、风险提示

本基金投资于证券、期货市场,基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、税负增加风险、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、基金进入清算期的相关风险、启用侧袋机制的风险和其他风险等。

本基金通过投资于目标ETF跟踪沪深300价值指数,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或摘牌等潜在风险,详见本招募说明书“第十七部分 风险揭示”章节。

本基金投资范围包括股票期权、国债期货,若投资可能面临市场风险、流动性风险、交易对手风险和国债期货交割风险等风险。

本基金可投资股票期权,在投资过程中可能存在市场风险、行权风险、流动性风险和时间价值风险等特定风险。

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。

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资和转融通券出借业务,参与融资和转融通券出借业务可能存在市场风险、流动性风险和信用风险等。

本基金的投资范围包括存托凭证,若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

本基金可按照基金合同的约定投资科创板上市股票。上海证券交易所科创板股票相对其他板块股票,将承担因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行约定的程序后,可以按照约定启用侧袋机制,详见基金合同及本招募说明书的“第十六部分 侧袋机制”章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并不得办理侧袋账户的申购赎回,请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金可能面临的主要风险详见本招募说明书“第十七部分 风险揭示”章节。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。投资者根据所持有的份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。本基金致力于目标ETF的联接基金,目标ETF为股票型指数基金,因此本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引起的投资风险,由投资人自行承担。基金的过往业绩并不预示未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

### 第一部分 本次募集的基本情况

#### 一、基金名称

申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金简称:申万菱信沪深300价值ETF联接

A类份额基金代码:023064 C类份额基金代码:023065

#### 二、基金的类别

ETF联接基金

#### 三、基金的运作方式

契约型开放式

#### 四、基金存续期限

不定期

#### 五、目标ETF及标的指数

本基金的目标ETF为申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金,标的指数为沪深300价值指数。

如果未来目标ETF的标的指数发生变更,本基金不变更目标ETF,本基金的标的指数将根据基金合同的约定随之变更。

#### 六、募集规模

本基金的最高募集规模为30亿元人民币(不包括募集期利息),基金首次募集规模不得超过募集目标上限,若募集期投资者的认购规模超过募集规模上限,基金管理人采取比例配售的方式对募集规模进行控制。本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

#### 七、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

#### 八、认购的确认

投资者按照基金合同的约定提交认购申请并交纳认购基金份额的款项时,基金合同人按照规定办理完基金募集的备案手续并取得

中国证监会书面确认,基金管理人确认后,基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使法律法规权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

#### 九、销售机构

具体名单详见本份额发售公告“第六部分 三、销售机构”。

#### 十、募集时间安排

本基金的募集期为2025年1月6日至2025年1月24日。基金管理人可根据

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

二〇二四年十二月

### 重要提示

1、申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)的募集已于2024年12月11日证监许可【2024】1798号文注册。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金为契约型开放式,ETF联接基金。

3、本基金的基金管理人和登记机构均为申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

4、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、本基金自2025年1月6日至2025年1月24日,通过申万菱信基金管理有限公司直销渠道以及各代销机构的代销网点公开发售。

6、本基金的最高募集规模为30亿元人民币(不包括募集期利息),基金首次募集规模不得超过募集目标上限,若募集期投资者的认购规模超过募集规模上限,基金管理人采取比例配售的方式对募集规模进行控制。本基金的最低募集份额总额为2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

7、投资者认购本基金份额,应开立申万菱信基金管理有限公司开放式基金账户。募集期内,投资者可通过基金管理人及其他销售机构的营业网点办理开户和认购手续。

8、投资者需开立“基金账户”和“交易账户”才能办理本基金的认购手续,投资者可在不同销售机构开立交易账户,但每个投资者只允许开立一个基金账户。若投资者在不同的销售机构处重复开立基金账户导致认购失败的,本基金管理人员和代销机构不承担认购失败的责任。如果投资者在开立基金账户的销售机构以外的其他销售机构购买本基金基金份额,则需要在该代销网点办理“开立交易账户”,然后再认购本基金基金份额。个人投资者必须本人亲自办理开户和认购手续。投资者在办理完开户和认购手续后,应及时到销售网点查询认购确认结果。

9、在办理基金账户开户的同时可以办理本基金份额的认购申请手续。

10、投资人和其他销售机构首次单笔认购最低金额为人民币1元(含认购费,下同),追加认购的单笔认购最低金额为人民币1元。投资人可在直销中心首次单笔认购最低金额为10元人民币,追加认购的单笔最低金额为10元人民币。

11、基金管理人对募集期间的单个投资人累计认购金额不设上限限制。

投资人认购的基金份额以基金合同生效后登记机构的确认为准。

12、投资人认购基金期间可以多次认购本基金份额,A类基金份额的认购费按每笔A类基金份额的认购申请单独计算,认购申请一经受理不得撤销。

13、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况,调整认购的数额限制,基金管理人最迟应于调整实施前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“信息披露办法”)的有关规定在规定媒介上予以公告。

投资者认购时,须按照销售机构规定的方式备足全额缴纳认购的金额的款项。

14、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使法律法规权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

15、本公司仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读《申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)等相关法律文件。

16、本基金的基金合同、招募说明书、托管协议、基金产品资料概要及本公司将同时发布在本公司网站(www.sswsmu.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund>)。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集的相关事宜。

17、各代销机构代销本基金的营业网点以及开户和认购等事项详见各代销机构的相关业务公告。

18、在募集期内,本基金有可能新增代销机构,敬请留意近期本公司及各代销机构的公示,或拨打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

19、本公司可综合各种情况对本基金募集安排做适当调整,并予以公告。

20、风险提示

本基金投资于证券、期货市场,基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、税负增加风险、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、基金进入清算期的相关风险、启用侧袋机制的风险和其他风险等。

本基金通过投资于目标ETF跟踪沪深300价值指数,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或摘牌等潜在风险,详见本招募说明书“第十七部分 风险揭示”章节。

本基金投资范围包括股票期权、国债期货,若投资可能面临市场风险、流动性风险、交易对手风险和国债期货交割风险等风险。

本基金可投资股票期权,在投资过程中可能存在市场风险、行权风险、流动性风险和时间价值风险等特定风险。

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。

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资和转融通券出借业务,参与融资和转融通券出借业务可能存在市场风险、流动性风险和信用风险等。

本基金的投资范围包括存托凭证,若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

本基金可能面临的主要风险详见本招募说明书“第十七部分 风险揭示”章节。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。投资者根据所持有的份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。本基金致力于目标ETF的联接基金,目标ETF为股票型指数基金,因此本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引起的投资风险,由投资人自行承担。基金的过往业绩并不预示未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

### 第一部分 本次募集的基本情况

#### 一、基金名称

申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金简称:申万菱信沪深300价值ETF联接

A类份额基金代码:023064 C类份额基金代码:023065

#### 二、基金的类别

ETF联接基金

#### 三、基金的运作方式

契约型开放式

#### 四、基金存续期限

不定期

#### 五、目标ETF及标的指数

本基金的目标ETF为申万菱信沪深300价值交易型开放式指数证券投资基金,标的指数为沪深300价值指数。

如果未来目标ETF的标的指数发生变更,本基金不变更目标ETF,本基金的标的指数将根据基金合同的约定随之变更。