

申万菱信基金管理有限公司

关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与各基金托管人协商一致，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自 2026 年 7 月 27 日起调整旗下部分基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。现将相关事宜公告如下：

一、业绩比较基准调整情况

本次调整业绩比较基准的基金及调整前后的业绩比较基准情况如下：

序号	基金全称	原基金合同业绩比较基准	调整后的新业绩比较基准
1	申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金	中证新能源汽车指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%	中证新能源汽车指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*15%
2	申万菱信乐同混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%	中证 800 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*15%+恒生指数收益率*10%
3	申万菱信兴乐优选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*65%+中证全债指数收益率*25%+恒生指数收益率*10%	中证 800 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*15%+恒生指数收益率*10%

4	申万菱信乐成混合型证券投资基金	中证 500 指数收益率*65%+ 中证全债指数收益率*25%+ 恒生指数收益率(经汇率调整后)*10%	中证 800 指数收益率*70%+中证 全债指数收益率*15%+恒生指 数收益率*15%
5	申万菱信乐融一年持有期混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*65%+ 中证全债指数收益率*25%+ 恒生指数收益率*10%	中证 800 指数收益率*60%+中证 全债指数收益率*15%+恒生指 数收益率*25%
6	申万菱信乐道三年持有期混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*65%+ 中证全债指数收益率*25%+ 恒生指数收益率*10%	中证 800 指数收益率*70%+中证 全债指数收益率*20%+恒生指 数收益率*10%
7	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)	中证 500 指数收益率*90%+ 银行同业存款收益率(税 后)*10%	中证 1000 指数收益率*90%+活 期存款基准利率*10%
8	申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金(QDII)	纳斯达克清洁先进绿色能源指数(NASDAQ Clean Edge Green Energy Index)*90%+ 银行人民币活期存款利率 (税后)* 10%	纳斯达克清洁先进绿色能源指数(NASDAQ Clean Edge Green Energy Index)收益率*70%+中 证新能源指数收益率*20%+人 民币活期存款基准利率*10%
9	申万菱信稳益宝债券型证券投资基金	中国债券总指数(全价)	中债-综合全价(1-3 年)指数收 益率*85%+沪深 300 指数收益率 *10%+活期存款基准利率*5%
10	申万菱信合利纯债债券型证券投资基金	中国债券总指数(全价)收 益率*90%+银行活期存款利 率(税后)*10%	中债-综合全价(1-3 年)指数收 益率*95%+活期存款基准利率 *5%

	金		
11	申万菱信可转换债券债券型证券投资基金	天相转债指数收益率*70%+中债总指数(全价)收益率*20%+沪深300指数收益率*10%	中证可转债及可交换债指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
12	申万菱信稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	上证国债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%	中债-新综合财富(总值)指数收益率*70%+沪深300指数收益率*17%+恒生指数收益率*3%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%+活期存款基准利率*5%

上述基金调整业绩比较基准要素的原因、差异及影响详见附件《业绩比较基准调整原因及合理性说明》。

二、基金合同等法律文件修订内容

(一) 基金合同具体修订内容包括：在“基金的投资”章节中的“业绩比较基准”部分列明基金调整后的业绩比较基准、设定原因(包括与基金产品投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制的匹配情况)、基准要素相关信息(包括发布机构、代码、查询途径等)、业绩比较基准的计算方法、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法，以及未来可能变更业绩比较基准的情形和程序。基金管理人将一并修订托管协议(如有)，并更新招募说明书、基金产品资料概要相关内容。

(二) 本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，基金

管理人已履行规定的程序，符合相关法律法规规定和基金合同约定，修订后的基金合同、托管协议（如有）、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）将在基金管理人网站（www.swsmu.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）发布。投资者办理基金交易等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件。

三、上述基金修订后的基金合同、托管协议（如有）自 2026 年 7 月 27 日起生效。

四、其他事项

（一）投资者可通过以下途径咨询有关详情

客户服务中心电话：400-880-8588

网址：www.swsmu.com

（二）基金管理人承诺以诚实信用、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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2026 年 6 月 27 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金

当前业绩比较基准： $50\% \times \text{中证新能源汽车指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证新能源汽车指数收益率} * 85\% + \text{中证综合债指数收益率} * 15\%$

差异：权益部分的基准要素保持不变，权重由 50% 提升至 85%；债券部分的基准要素保持不变，权重由 50% 降低至 15%。

调整原因：基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中权益部分所对应的基准要素权重调整为 85%，并同步将债券部分所对应的基准要素权重调整为 15%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

2、申万菱信乐同混合型证券投资基金

当前业绩比较基准： $70\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} * 75\% + \text{恒生指数收益率} * 10\% + \text{中证全债指数收益率} * 15\%$

差异：A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数调整为中证 800 指数，权重由 70% 调整为 75%，债券部分的基准要素权重由 20% 调整为 15%。

调整原因：本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性分析和定量分析相结合的方法对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘 A 股与港股通范围内的优质公司，进行股票组合的构建。经审慎评估，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。中证 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的

800 只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 指数与基金实际持股风格更为匹配，适合作为本基金 A 股股票资产的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中 A 股股票资产所对应的基准要素权重调整为 75%，债券部分的基准要素权重调整为 15%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

3、申万菱信兴乐优选混合型证券投资基金

当前业绩比较基准： $65\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率} + 25\% \times \text{中证全债指数收益率}$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} * 75\% + \text{恒生指数收益率} * 10\% + \text{中证全债指数收益率} * 15\%$

差异：A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数调整为中证 800 指数，权重由 65% 调整为 75%，债券部分的基准要素权重由 25% 调整为 15%。

调整原因：本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性分析和定量分析相结合的方法对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘 A 股与港股通范围内的优质公司，进行股票组合的构建。经审慎评估，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。中证 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 指数与基金实际持股风格更为匹配，适合作为本基金 A 股股票资产的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中 A 股股票资产所对应的基准要素权重调整为 75%，债券部分的基准要素权重调整为

15%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

4、申万菱信乐成混合型证券投资基金

当前业绩比较基准：中证 500 指数收益率*65%+中证全债指数收益率*25%+恒生指数收益率(经汇率调整后)*10%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*15%+恒生指数收益率*15%

差异：A 股股票部分的基准要素由中证 500 指数调整为中证 800 指数。A 股部分的基准要素权重由 65%调整为 70%，港股部分的基准要素权重由 10%调整为 15%，债券部分的基准要素权重由 25%调整为 15%。

调整原因：本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性分析和定量分析相结合的方法对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘 A 股与港股通范围内的优质公司，进行股票组合的构建。经审慎评估，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分所对应的基准指数从中证 500 指数调整为中证 800 指数。中证 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 指数与基金实际持股风格更为匹配，适合作为本基金 A 股股票资产的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中 A 股资产所对应的基准要素权重调整为 70%，港股资产所对应的基准要素权重调整为 15%，并将债券部分的基准要素权重调整为 15%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

5、申万菱信乐融一年持有期混合型证券投资基金

当前业绩比较基准：65%×沪深 300 指数收益率+10%×恒生指数收益率+

25%×中证全债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*15%+恒生指数收益率*25%

差异：A 股股票部分所对应的基准要素从沪深 300 指数调整为中证 800 指数，并将权重由 65%调整为 60%，港股通标的股票部分所对应的基准要素不变，权重由 10%调整为 25%；债券部分的基准要素保持不变，权重由 25%下调至 15%。

调整原因：本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性分析和定量分析相结合的方法对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘 A 股与港股通范围内的优质公司，进行股票组合的构建。经审慎评估，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。中证 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 指数与基金实际持股风格更为匹配，适合作为本基金 A 股股票资产的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中 A 股资产对应的基准要素权重调整为 60%，港股通标的股票对应的基准要素权重调整为 25%，同时将债券部分基准要素权重调整为 15%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

6、申万菱信乐道三年持有期混合型证券投资基金

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*65%+中证全债指数收益率*25%+恒生指数收益率*10%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%

差异：A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数调整为中证 800 指数。A 股股票部分的基准要素权重由 65%调整为 70%，债券部分的基准要素权重由 25%调

整为 20%。

调整原因：本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性分析和定量分析相结合的方法对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘 A 股与港股通范围内的优质公司，进行股票组合的构建。经审慎评估，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。中证 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 指数与基金实际持股风格更为匹配，适合作为本基金 A 股股票资产的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中 A 股资产所对应的基准要素权重调整为 70%，并将债券部分的基准要素权重调整为 20%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

7、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）

当前业绩比较基准： $90\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 10\% \times \text{银行同业存款收益率}$ （税后）

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 1000 指数收益率} * 90\% + \text{活期存款基准利率} * 10\%$

差异：股票部分的基准要素由中证 500 指数调整为中证 1000 指数，现金类资产的基准要素由银行同业存款收益率调整为活期存款基准利率。

调整原因：本基金的股票资产坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资，通过专门开发的“量化小盘投资模型”分析和筛选小盘股构建股票投资组合。经审慎评估，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数盘别/市值覆盖、行业与个股分布等，将股票资产中的 A 股股票部分所对应的基准指数从中证 500 指数调整为中证 1000 指数。中证 1000 指数选取中证 800 指数样本以外的规模偏小且流动性好的 1000 只证券作为指数样本，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表

现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素，从而使新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。现金类资产的基准要素未做实质性调整，仅规范表达方式。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

8、申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）

当前业绩比较基准：纳斯达克清洁先进绿色能源指数（NASDAQ Clean Edge Green Energy Index）*90% + 银行人民币活期存款利率（税后）* 10%

调整后新业绩比较基准：纳斯达克清洁先进绿色能源指数（NASDAQ Clean Edge Green Energy Index）收益率*70%+中证新能源指数收益率*20%+人民币活期存款基准利率*10%

差异：权益部分增加中证新能源指数作为 A 股股票基准要素并设置 20%权重，同时将境外股票基准要素权重调整为 70%，整体权益基准要素比例保持不变。

调整原因：基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产重点投资于全球新能源主题相关上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格与主题库的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数主题界定、市值覆盖、行业与个股分布等，本基金新增中证新能源指数作为 A 股股票部分的基准要素。

基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，新增 A 股股票部分的基准要素，将业绩比较基准中境外股票、A 股股票所对应的基准要素权重分别设置为 70%、20%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

9、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金

当前业绩比较基准：中国债券总指数（全价）

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（1-3 年）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%

差异：债券部分的基准要素由中国债券总指数（全价）调整为中债-综合全

价(1-3年)指数,权重调整为85%,增加权益类业绩比较基准要素沪深300指数,权重设置为10%,并增加活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素,权重设置为5%。

调整原因:本基金为混合债券型二级基金,基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别,本基金主要投资于债券、A股股票与现金等资产,相应选取与之匹配的债券指数、A股指数与活期存款基准利率作为基准要素。基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金的债券资产采用全市场策略,主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度,以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等,选取中债-综合全价(1-3年)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-综合全价(1-3年)指数选取除资产支持证券、美元债券、可转债以及流通受限债券(如私募债、定向募集债券等)之外,在境内债券市场公开发行的债券,主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等,包含二级资本债券、无固定期限资本债券、总损失吸收能力非资本债券等,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金的股票资产采用全市场选股策略,通过定性分析和定量分析相结合的方法对公司基本面进行持续跟踪分析,挖掘A股优质公司,从而在控制风险的基础上追求超越业绩比较基准的投资回报。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金选取沪深300指数作为股票部分的基准要素。沪深300指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的300只证券组成,反映沪深市场上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

影响:上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

10、申万菱信合利纯债债券型证券投资基金

当前业绩比较基准:中国债券总指数(全价)收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%

调整后新业绩比较基准:中债-综合全价(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%

差异：债券部分的基准要素由中国债券总指数(全价)调整为中债-综合全价(1-3年)指数，权重调整为95%，活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素比例调整为5%。

调整原因：基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产采用全市场策略，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，选取中债-综合全价(1-3年)指数作为债券部分的业绩比较基准要素，中债-综合全价(1-3年)指数选取除资产支持证券、美元债券、可转债以及流通受限债券（如私募债、定向募集债券等）之外，在境内债券市场公开发行的债券，主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等，包含二级资本债券、无固定期限资本债券、总损失吸收能力非资本债券等，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中债券资产所对应的基准要素权重调整为95%，活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素比例调整为5%，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

11、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金

当前业绩比较基准：天相转债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×10%+中债总指数（全价）收益率×20%

调整后新业绩比较基准：中证可转债及可交换债指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%

差异：债券部分的基准要素由天相转债指数与中债总指数（全价）调整为中证可转债及可交换债指数，权重调整为85%，增加5%的活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素，股票部分的基准要素与权重保持不变。

调整原因：本基金债券部分主要投资于可转债品种，且原业绩比较基准中的

天相转债指数已不再对外公开发布数据，不再适合作为本基金的业绩比较基准，调整后的中证可转债及可交换债指数样本券由沪深交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券组成，指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换公司债券和可交换公司债券的整体表现，适合作为本基金可转债部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，在基准要素的权重设置方面，将业绩比较基准中可转债资产所对应的基准要素权重调整为 85%，股票部分的基准要素权重保持不变，并在基准要素中增加 5%的现金类资产，从而使得新业绩比较基准中各大类资产类别所对应的基准要素权重与基金实际投资运作相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。

12、申万菱信稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富(总值)指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*17%+恒生指数收益率*3%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%+活期存款基准利率*5%

差异：权益部分增加恒生指数作为香港权益类资产的基准要素并设置 3%权重，同时将境内权益类的基准要素权重调整为 17%，权益部分基准要素整体权重保持不变；固定收益类部分将基准要素由上证国债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数，并将权重调整为 70%；增加表征商品类资产的上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格、表征现金类资产的活期存款基准利率作为基准要素，并均设置 5%的权重。

调整原因：基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金采用目标风险策略投资，通过控制各类资产的投资比例及基准配置比例将风险等级限制在稳健级，并力争在此约束下实现长期稳健增值，满足养老资金的理财需求。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等，本基金增加表征香港权益类资产的恒生指数、表征商品类资产的上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格、表征现金类资产的活期存款基准利率作

为基准要素。

本基金的债券、债券型基金等固定收益类资产采用全市场策略，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，将固定收益类资产的基准要素由表征上证国债表现的上证国债指数调整为反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势的中债-新综合财富(总值)指数。

此外，基于本基金近年来的资产配置结构，并结合基金合同约定的投资比例限制和长期产品定位，将业绩比较基准中的境内权益类资产所对应的基准要素权重从20%调整为17%，将固定收益类资产所对应的基准要素权重从80%调整为70%，同时基准要素新增3%的香港权益类资产、5%的商品类资产和5%的现金类资产，从而使得新业绩比较基准中各大资产类别所对应的基准要素权重与基金过往实际投资运作等相匹配。

影响：上述调整对本基金投资运作、基金份额持有人利益无实质性不利影响。