

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 9 月 21 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	申万菱信新经济混合型证券投资基金	沪深 300 指数*85%+金融同业存款利率*15%	沪深 300 指数收益率*90%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
2	申万菱信双利混合型证券投资基金	中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%	中债-综合全价（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
3	申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%	沪深 300 指数收益率*65%+中证综合债指数收益率*35%

4	申万菱信乐享混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%	沪深 300 指数收益率*90%+中证全债指数收益率*10%
5	申万菱信行业精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(经汇率调整后)*10%	沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*15%+恒生指数收益率*10%
6	申万菱信行业轮动股票型证券投资基金	中证 800 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*15%
7	申万菱信宁通六个月持有期混合型证券投资基金	中债综合全价(总值)指数收益率*80%+中证红利指数收益率*15%+中证港股通综合指数收益率(经汇率调整后)*5%	中债综合全价(总值)指数收益率*80%+中证全指指数收益率*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%
8	申万菱信安泰丰利债券型证券投资基金	中国债券总指数(全价)收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%	中债-综合全价(3-5 年)指数收益率*85%+中证可转债及可交换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
9	申万菱信季季瑞三个月持有期纯债债券型证券投资基金	中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+一年定期存款基准利率(税后)*10%	中债-综合全价(1-3 年)指数收益率*95%+一年期定期存款基准利率*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 9 月 21 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8月22日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、申万菱信新经济混合型证券投资基金

当前业绩比较基准：沪深 300 指数*85%+金融同业存款利率*15%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*90%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%

差异：股票部分的基准要素权重由 85%调整为 90%，增加中债-综合全价（总值）指数作为债券部分的基准要素，权重为 5%，调整现金类资产基准要素表达规范，并将权重由 15%调整为 5%。

调整原因：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，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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，新增中债-综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素，并规范现金类资产基准要素的表达方式。中债-综合全价（总值）指数是由中债金融估值中心有限公司编制，指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外的在境内公开发行且上市流通的债券，具体包括国债、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，反映境内人民币债券市场整体表现，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，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重调整为 90%，债券部分对应的基准要素权重设为 5%，现金类资产对应的基准要素权重调整为 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。

2、申万菱信双利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*10%+恒生指数收益率*5%+中债综合指数收益率*85%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%

差异：A 股股票部分的基准要素权重由 10%调整为 15%；增加表征现金类资产的活期

存款基准利率作为基准要素，设置 5% 的权重；债券部分的基准要素权重相应由 85% 调整为 75%，同时规范债券部分的基准要素表述。

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 A 股股票部分的基准要素权重由 10% 调整为 15%；增加表征现金类资产的活期存款基准利率作为基准要素，设置 5% 的权重；债券部分的基准要素权重由 85% 调整为 75%，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。同时按照要求规范债券部分的基准要素表述，不涉及基准指数调整。

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、申万菱信多策略灵活配置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*50%+中证综合债指数收益率*50%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*65%+中证综合债指数收益率*35%

差异：股票部分的基准要素权重由 50% 调整为 65%，债券部分的基准要素权重由 50% 调整为 35%。

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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准要素权重调整为 65%，并将债券部分的基准要素权重调整为 35%，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、申万菱信乐享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*75%+中证全债指数收益率*25%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*90%+中证全债指数收益率*10%

差异：股票部分的基准要素权重由 75% 提升至 90%；债券部分的基准要素权重由 25% 降低至 10%。

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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准要素权重调整为 90%，并同步将债券部分所对应的基准要素权重调整为 10%，

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、申万菱信行业精选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(经汇率调整后)*10%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中证全债指数收益率*15%

差异：A 股股票部分的基准要素权重由 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：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 股股票部分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。

6、申万菱信行业轮动股票型证券投资基金

当前业绩比较基准：中证 800 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*15%

差异：股票部分的基准要素权重由 80%提升至 85%；债券部分的基准要素权重由 20%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，将业绩比较基准中股票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。

7、申万菱信宁通六个月持有期混合型证券投资基金

当前业绩比较基准：中债综合全价(总值)指数收益率*80%+中证红利指数收益率*15%+中证港股通综合指数收益率(经汇率调整)*5%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+中证全指指数收益率*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%

差异：A股股票部分的基准要素由中证红利指数调整为中证全指指数。

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，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，选取中证全指指数作为A股股票部分的业绩比较基准要素，中证全指指数由上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的股票和存托凭证组成样本，具有较高的市场代表性，反映上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场上市公司的整体表现，适合作为本基金A股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。

8、申万菱信安泰丰利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*80%+银行活期存款利率(税后)*20%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价(3-5年)指数收益率*85%+中证可转债及可交换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%

差异：纯债部分基准要素由中国债券总指数(全价)调整为中债-综合全价(3-5年)指数，权重由80%调整为85%，同时增加表征可转债资产的中证可转债及可交换债券指数作为基准要素，并设置10%的权重，相应地现金资产基准要素权重由20%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，本基金的纯债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，将纯债资产的基准要素由中国债券总指数(全价)调整为中债-综合全价(3-5年)指数。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金投资可转债及可交换债券，将根据不同市场环境下可转债自身的股性特征、债性特征、流动性等基本要素，判断其股

性和债性的相对价值，把握其价值走向，精选个券进行投资管理。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，新增中证可转债及可交换债券指数作为本基金可转债部分的业绩比较基准要素。

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，在基准要素的权重设置方面，将纯债资产部分基准权重由80%调整为85%，将表征可转债资产的中证可转债及可交换债券指数权重设置为10%，相应地现金资产基准要素权重由20%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。

9、申万菱信季季瑞三个月持有期纯债债券型证券投资基金

当前业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率*90%+一年定期存款基准利率（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%+一年期定期存款基准利率*5%

差异：债券部分基准要素由中债-综合全价（总值）指数调整为中债-综合全价（1-3年）指数，权重由90%调整为95%，相应地现金资产基准要素权重由10%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，将债券资产的基准要素由中债-综合全价（总值）指数调整为中债-综合全价（1-3年）指数。

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，将债券部分基准权重由90%调整为95%，相应地现金资产基准要素权重由10%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。