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 11 月 30 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	申万菱信绿色纯债债券型发起式证券投资基金	中国债券综合全价指数收益率	中债-中国绿色债券指数全价(总值)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
2	申万菱信汇元宝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(3-5 年)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
3	申万菱信智华稳进配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	中债新综合财富指数收益率*65%+沪深 300 指数收益率*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*3%+中证商品期货成份指数收益率*2%	中债-新综合财富(总值)指数收益率*60%+沪深 300 指数收益率*29%+恒生指数收益率*3%+中证商品期货成份指数收益率*3%+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 11 月 30 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 10 月 31 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、申万菱信绿色纯债债券型发起式证券投资基金

当前业绩比较基准：中国债券综合全价指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-中国绿色债券指数全价(总值)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综合全价指数调整为中债-中国绿色债券指数全价(总值)指数，权重由100%调整为95%，增加5%的现金类资产基准要素。

调整原因：本基金债券部分主要投资于绿色主题债券，经审慎评估，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，以及基准指数主题界定、券种、久期、信用分布特征等，将债券部分的基准要素调整为中债-中国绿色债券指数全价(总值)指数。中债-中国绿色债券指数全价(总值)指数由中债金融估值中心有限公司和中节能衡准科技服务（北京）有限公司合作编制，指数成份券依据债券发行文件中募集资金用途、发行人所处行业、主营业务及主要产品等信息判断满足《绿色金融支持项目目录（2025 年版）》、《绿色债券原则 GBP，2021》和《气候债券标准》其中一个标准的债券，在绿色债券领域具有广泛的市场代表性，适合作为本基金债券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，将业绩比较基准中债券资产所对应的基准要素权重调整为95%，增加5%的现金类资产基准要素，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、申万菱信汇元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)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(3-5 年)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+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(3-5 年)指数，权重调整为 80%，增加权益类业绩比较基准要素沪深 300 指数，权重设置为 15%,活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素,权重调整为 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(3-5 年)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-综合全价(3-5 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。沪深 300 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。

3、申万菱信智华稳进配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

当前业绩比较基准：中债新综合财富指数收益率*65%+沪深 300 指数收益率*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*3%+中证商品期货成份指数收益率

*2%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富(总值)指数收益率*60%+沪深 300 指数收益率*29%+恒生指数收益率*3%+中证商品期货成份指数收益率*3%+活期存款基准利率*5%

差异：将境内权益类的基准要素权重由 30%调整为 29%；将固定收益类部分的基准要素权重由 65%调整为 60%;将商品类资产的基准要素权重由 2%调整为 3%;增加表征现金类资产的活期存款基准利率作为基准要素，并设置 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，本基金以多元资产配置为核心驱动力，通过优化配置各类资产实现投资组合的风险分散。同时本基金通过精选各类基金并构造分散的基金组合，力求实现投资组合长期稳健收益。综合考虑活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力及本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例限制，本基金增加表征现金类资产的活期存款基准利率作为基准要素。

基于本基金近年来在债券、债券型基金等固收类资产的资产配置结构，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固收类资产所对应的基准要素权重从 65%调整为 60%，将境内权益类资产所对应的基准要素权重从 30%调整为 29%，将商品类资产所对应的基准要素权重从 2%调整为 3%，同时基准要素新增 5%表征现金类资产的活期存款基准利率，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。