

# 申万菱信基金管理有限公司

## 关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）对旗下 31 只公募基金参与存托凭证投资修订基金合同、托管协议等法律文件，包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订将自 2020 年 11 月 27 日起正式生效。现将基金合同修订情况公告如下：

### 一、 修订基金范围

基金名称	基金主代码
申万菱信盛利精选证券投资基金	310308
申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金	310318
申万菱信新动力混合型证券投资基金	310328
申万菱信新经济混合型证券投资基金	310358
申万菱信消费增长混合型证券投资基金	310388
申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金	310398
申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）	163110
申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金	002510
申万菱信量化成长混合型证券投资基金	004135
申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金	510600
申万菱信中证申万电子行业投资指数型证券投资基金（LOF）	163116
申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金	001148
申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金	001201
申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金	003493
申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金	003601
申万菱信价值优利混合型证券投资基金	004951
申万菱信安鑫慧选混合型证券投资基金	008991
申万菱信竞争优势混合型证券投资基金	310368
申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）	163111
申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）	163114
申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金	001156
申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金	003986
申万菱信行业轮动股票型证券投资基金	005009

申万菱信价值优先混合型证券投资基金	004769
申万菱信量化驱动混合型证券投资基金	005418
申万菱信智能驱动股票型证券投资基金	005825
申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金	515200
申万菱信量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金	008895
申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	007983
申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金	009557
申万菱信医药先锋股票型证券投资基金	005433

## 二、对基金合同和托管协议的修订

### （一）对“基金合同”的前言部分的主要修订

新增关于存托凭证的风险提示内容，以申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金为例，新增以下内容：

“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。”

### （二）对“基金的投资”部分的主要修订

1、明确“投资范围”中包含存托凭证。以申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金为例，将“投资范围”修订为：

“本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票及存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

……

本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于创业板上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；……”

2、在股票投资策略部分增加存托凭证投资策略，以申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金为例，相关描述如下：

“存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。”

3、在“投资限制”中增加存托凭证投资限制描述如下：“本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，存托凭证与境内上市交易的股票合并计算；”

（三）在“基金资产估值”部分的主要修订：

1、新增存托凭证为“估值对象”，以申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金为例，其估值对象修订为：

“基金所拥有的股票、存托凭证、债券、衍生品种合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

2、“估值方法”中增加存托凭证估值方法描述如下：

“本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。”

（四）各基金的托管协议涉及上述基金合同修订内容的必要修订。

（五）因上述修订导致的序号变化顺序调整。

三、 根据上述变更，本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定对以上基金的招募说明书和基金产品资料概要中的相关内容进行更新。

上述基金的基金合同均已明确约定基金可投资境内上市交易的股票，且本次修订系根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》而作出。本次修订已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定和各基金基金合同的约定。本次修订自2020年11月27日起生效。

投资者可登录本基金管理人网站（[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)）查阅修订后的基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要等信息披露文件，也可拨打本基金管理人客户服务电话（400-880-8588）了解相关信息。

风险提示：本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。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同和招募说明书等基金法律文件，全面了解基金产品的风险收益特征，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。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2020年11月26日