

# 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 8 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。本次修订将自 2021 年 6 月 29 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
申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金	163118
申万菱信深证成份指数型证券投资基金	163109
申万菱信稳益宝债券型证券投资基金	310508
申万菱信可转换债券债券型证券投资基金	310518
申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金	163113
申万菱信中证军工指数型证券投资基金	163115
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)	010735
申万菱信宜选混合型证券投资基金	011484

### 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，以申万菱信中证申万医药生物指数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。以申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金为例，将“投资范围”修订为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市

的股票及存托凭证、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

……

基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票及存托凭证市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；……”

2、在股票投资策略部分增加存托凭证投资策略，以申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金为例，相关描述如下：

“存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。”

3、在“投资限制”中增加存托凭证投资限制描述如下：

“本基金所持有的股票及存托凭证市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的 85%，……

……

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”，以申万菱信中证申万医药生物指数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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、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。

#### 四、重要提示

1、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，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开份额持有人大会。本次修订自 2021 年 6 月 29 日起正式生效。

2、投资者可登陆本基金管理人网站（[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

2021 年 6 月 29 日