

# 申万菱信基金管理有限公司

## 关于修改申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金名称及基金合同的公告

申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，基金代码：163113）基金合同于2014年3月13日生效，跟踪的标的指数名称为“申银万国证券行业指数”。《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）中对申银万国证券行业指数及指数使用费等信息进行了较为详细的介绍。

鉴于中证指数有限公司与上海申银万国证券研究所有限公司分别于2015年4月1日发布了《关于申银万国证券行业指数更名为中证申万证券行业指数的公告》和《证券（二级）指数暂停发布公告》，申万指数体系中的“申银万国证券行业指数”的名称将自2015年4月16日起变更为“中证申万证券行业指数”（指数代码：399707）。自更名日起，指数将由中证指数有限公司发布、管理及维护，编制方法没有变化。原申银万国证券行业指数从更名日起暂停发布。为保证本基金的正常运行，根据《基金合同》的相关规定以及上述公告相关要求，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，本基金的跟踪标的指数名称将由“申银万国证券行业指数”调整为“中证申万证券行业指数”。本公司拟对基金名称及基金合同中涉及标的指数的相关内容做相应修改，具体修改如下：

### 一、基金名称的调整

基金名称将由“申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金”修改为“申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金”，基金简称和基金代码保持不变。

### 二、《基金合同》“第十六部分 基金的投资”中“五、业绩基准”中指的指数的调整

调整前，“第十六部分 基金的投资”中“五、业绩基准”中的介绍内容如下：

#### “五、业绩比较基准

业绩比较基准为： $95\% \times \text{申银万国证券行业指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利$

率。

本基金以申银万国证券行业指数为标的指数，原则上将不低于 80%的非现金基金资产投资于标的指数成份股和备选成份股，不低于 5%的资产投资于现金类资产，业内现金类资产收益率主要以银行同业存款利率为基准，故选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

申银万国证券行业指数（801193）是申银万国行业股价系列指数旗下一只二级行业价格指数，是中国多层次证券市场的重要指数。该指数以沪深两市从事证券相关行业上市公司的股票作为其成份股，用以表征证券行业的整体股价变化，兼具价值尺度与投资标的的功能。

如果申银万国证券行业指数被停止编制或发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的目标指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。”

调整后，此部分内容修改为：

#### “五、业绩比较基准

业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证申万证券行业指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金以中证申万证券行业指数为标的指数，原则上将不低于 80%的非现金基金资产投资于标的指数成份股和备选成份股，不低于 5%的资产投资于现金类资产，业内现金类资产收益率主要以银行同业存款利率为基准，故选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

如果中证申万证券行业指数被停止编制或发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的目标指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，

更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。”

三、《基金合同》“第十九部分 基金费用与税收”中“二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式”中关于基金合同生效后标的指数许可使用费的调整

调整前，“第十九部分 基金费用与税收”中“二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式”中关于基金合同生效后标的指数许可使用费的介绍内容如下：

### “3、基金合同生效后标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与上海申银万国证券研究所有限公司签署的指数使用许可协议的约定向上海申银万国证券研究所有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年指数使用费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年指数使用费率为 0.02%

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 50,000 元，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每一季度末结束后的 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

除管理费、托管费、标的指数许可使用费之外的前述第一款约定的其他费用由基金管理人及基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入基金费用。”

调整后，此部分内容修改为：

“本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中

所规定的指数许可使用费计提方法，按前一日基金资产净值每日计提标的指数许可使用费，具体计提方法见本基金招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

除管理费、托管费、标的指数许可使用费之外的前述第一款约定的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入基金费用。”

#### 四、《基金合同》其他部分中包含标的指数相关内容的调整

基金合同中所有“申银万国证券行业指数”的文字表述统一调整为“中证申万证券行业指数”。

本基金基金名称及《基金合同》上述变更内容自 2015 年 4 月 16 日起生效。本公司将据此在更新基金招募说明书时，对招募说明书中的上述相关内容进行修订。

投资者可通过本基金管理人网站 [www.swsmu.com](http://www.swsmu.com) 或客户服务电话 400 880 8588（免长途话费）或 021-962299 咨询相关情况。

风险提示：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。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

2015 年 4 月 14 日