天治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，天治基金管理有限公司（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，同时对相关基金管理人信息及基金托管人信息（如有）进行更新，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	调整后的业绩比较基准
1	天治中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金	申银万国制造业指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%	申银万国制造业指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%
2	天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)	富时中国 A 股自由流通全盘指数*75%＋富时中国国债指数*25%	中证 800 指数收益率*85%+中债-国债总财富（总值）指数收益率*15%
3	天治可转债增强债券型证券投资基金	中债综合指数收益率	中证可转换债券指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
4	天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金	中证内地低碳经济主题指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%	中证内地低碳经济主题指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
5	天治新消费灵活配置混合型证券投资基金	申银万国消费品指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%	申银万国消费品指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
6	天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*50%+1 年期定期存款利率(税后)*50%	沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

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。部分基金在“基金合同内容摘要”章节中调整与业绩比较基准相关联表述，部分基金在“基金的基本情况”章节中“基金的投资目标” 部分调整与业绩比较基准相关联表述，在“基金的投资”章节中“投资目标”、“投资策略”部分调整与业绩比较基准相关联表述。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.chinanature.com.cn）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（更新）、基金产品资料概要（更新）、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：4000984800（免长途通话费用） 、(021)60374800

网址：www.chinanature.com.cn

（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。

天治基金管理有限公司

2026 年 10 月 31 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、天治中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金

（1）**当前业绩比较基准：**申银万国制造业指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

调整后新业绩比较基准：申银万国制造业指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%

（2）**新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：**

此次本基金业绩比较基准调整仅涉及基准要素权重调整，不涉及具体指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金近年来股票资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 50%提高至 70%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 50%调低至 30%，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。

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、天治核心成长混合型证券投资基金(LOF)

（1）**当前业绩比较基准：**富时中国 A 股自由流通全盘指数*75% + 富时中国国债指数*25%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*85%+中债-国债总财富（总值）指数收益率*15%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，以“核心－卫星”策略作为股票投资的总体策略。“核心－卫星”策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合，核心组合跟踪沪深 300 指数，控制投资组合相对于市场的风险；卫星组合通过优选股票进行主动投资，追求超越市场平均水平的收益。本基金的债券资产采用全市场策略，在综合考虑宏观经济因素和债券品种特征因素的基础上，运用利率预期、久期管理、收益率利差分析、套利交易等策略进行债券久期配置、类属配置，获取债券市场的长期稳定收益。

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，以及股票指数市值覆盖、行业与个股分布和债券指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金将股票资产所对应的基准指数由富时中国 A 股自由流通全盘指数调整为中证 800 指数，此外，基于本基金近年来股票资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 75%提高至 85%。将债券资产所对应的基准指数由富时中国国债指数调整为中债-国债总财富（总值）指数，并将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重从 25%下调至 15%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。

原业绩比较基准中，富时中国 A 股自由流通全盘指数属于富时中国 A 股全盘指数系列，采用符合国际惯例的方法编制，能够较为全面地反映中国 A 股市场的整体走势。富时中国国债指数涵盖深沪两市挂牌的国债，反映交易所国债市场整体走势。调整后的新业绩比较基准中，中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大、中、小市值公司的股票价格表现；中债-国债总财富（总值）指数隶属于中债-国债总指数，该指数成份券由在境内公开发行且上市流通的记账式国债组成，是一个反映境内记账式国债整体价格走势情况的分类指数。调整后的中证 800 指数、中债-国债总财富（总值）指数与基金实际持券风格更为匹配，能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、天治可转债增强债券型证券投资基金

（1）**当前业绩比较基准：**中债综合指数收益率

调整后新业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

（2）**新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：**

此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于可转债品种，基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环

境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。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，本基金将债券资产所对应的基准指数由中债综合指数调整为中证可转换债券指数、中证全债指数。此外，基于本基金可转债资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和长期产品定位，将业绩比较基准中可转债资产所对应的基准要素权重调整为 80%，将除可转债以外其他债券资产所对应的基准要素权重调整为 20%，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过往实际投资运作相匹配。

原业绩比较基准中，中债综合指数综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，涵盖了银行间市场和交易所市场；调整后的新业绩比较基准中，中证可转换债券指数由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成，以反映沪深交易所可转换债券的总体表现，适合作为本基金可转债部分的业绩比较基准要素；中证全债指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数有限公司编制并发布的首只债券类指数。调整后的中证可转换债券指数、中证全债指数与基金实际持券风格更为匹配，能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、天治低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

（1）**当前业绩比较基准：**中证内地低碳经济主题指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

调整后新业绩比较基准：中证内地低碳经济主题指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%

（2）**新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：**

此次本基金业绩比较基准调整仅涉及基准要素权重调整，不涉及具体指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金近年来股票资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 50%提高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 50%调低至 15%，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。

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、天治新消费灵活配置混合型证券投资基金

（1）**当前业绩比较基准：**申银万国消费品指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

调整后新业绩比较基准：申银万国消费品指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%

（2）**新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：**

此次本基金业绩比较基准调整仅涉及基准要素权重调整，不涉及具体指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金近年来股票资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 50%提高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 50%调低至 15%，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。

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、天治趋势精选灵活配置混合型证券投资基金

（1）**当前业绩比较基准：**沪深 300 指数收益率*50%+1 年期定期存款利率(税后)*50%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%（2）**新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：**

此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投资于受益于人口趋势的优势行业中的领先企业，采用全市场选股策略，通过分析中国和全球人口在总量、结构、分布等方面的变化趋势，选择受益于重大人口趋势主题的优势行业进行重点配置；再对上市公司的行业领先度、市场领先度、长期驱动因素和事件驱动因素进行全面考察，主要从优势行业中精选领先公司进行重点投资。本基金的债券资产综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、类属券种配

置策略、套利交易策略等，在综合考虑宏观经济因素和债券品种特征因素的基础上，获取债券市场的长期稳定收益。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，以及股票指数主题界定、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等和债券指数券种、久期、信用等级分布，本基金保持股票部分所对应的基准指数不变，此外，基于本基金近年来股票资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 50%提高至 80%，新增中证全债指数作为债券部分的业绩比较基准要素，并将债券资产所对应的基准要素权重设置为 20%，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。

原业绩比较基准中，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。调整后的新业绩比较基准中，中证全债指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数有限公司编制并发布的首只债券类指数。调整后的沪深 300 指数、中证全债指数与基金实际持券风格更为匹配，能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。