

中泰证券（上海）资产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，中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自 2026 年 7 月 27 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	中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%	中证 800 价值指数收益率×85%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
2	中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%	中证 800 价值指数收益率×85%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
3	中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%	中证 800 指数收益率×90%+中债-综合全价（总值）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
4	中泰兴为价值精选混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×40%+中债综合指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%	中证 800 价值指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×30%+中债-综合全价（总值）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
5	中泰元和价值精选混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+恒生指数收益率×20%	中证 800 价值指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
6	中泰青月中短债债券型证券投资基金	中债总财富(1-3 年)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%	中债-综合财富(1-3 年)指数收益率×45%+中债-综合财富(1 年以下)指数收益率×45%+一年期定期存款基准利率×10%

7	中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金	中债综合财富(总值)指数收益率×95%+沪深 300 指数收益率×5%	中债-综合财富(1-3 年)指数收益率×97%+沪深 300 指数收益率×3%
8	中泰双利债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×7%+恒生指数收益率×3%	中债-综合全价(1-3 年)指数收益率×95%+沪深 300 指数收益率×5%
9	中泰天择稳健 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)	中债综合指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%	中债-综合全价(总值)指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×7%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率×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.ztzqzg.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（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7月27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

客户服务电话：400-821-0808

网址：www.ztzqzg.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。

中泰证券（上海）资产管理有限公司

2026 年 6 月 27 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金

(1) 基准变更情况

当前业绩比较基准：

中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

调整后新业绩比较基准：

中证 800 价值指数收益率×85%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例等不匹配，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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于境内股票资产，采用自下而上的全市场选股策略。历史数据显示，本基金长期以来呈现显著的价值投资风格。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票资产所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中证 800 价值指数。基于本基金近年来平均股票仓位实际情况，同时考虑到基金合同约定本基金需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，并结合基金合同约定的其他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 60%调高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 40%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产；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，中证 800 指数（指数代码 000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整

体表现；调整后的新业绩比较基准中，中证 800 价值指数（指数代码 H30356）从中证 800 指数样本中，选取价值因子得分最高的 250 只证券作为指数样本，反映中证 800 指数样本中具有价值特征的上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 价值指数与基金实际持股风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。此外，调整后的新业绩比较基准中活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金现金类资产的业绩比较基准要素。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。上述调整不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

2、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金

（1）基准变更情况

当前业绩比较基准：

中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

调整后新业绩比较基准：

中证 800 价值指数收益率×85%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例等不匹配，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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于境内股票资产，采用自下而上的全市场选股策略。历史数据显示，本基金长期以来呈现显著的价值投资风格。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票资产所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中证 800 价值指数。基于本基金近年来平均股票仓位实际情况，同

时考虑到基金合同约定本基金需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，并结合基金合同约定的其他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 60%调高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 40%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产；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，中证 800 指数（指数代码 000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘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 800 价值指数（指数代码 H30356）从中证 800 指数样本中，选取价值因子得分最高的 250 只证券作为指数样本，反映中证 800 指数样本中具有价值特征的上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 价值指数与基金实际持股风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。此外，调整后的新业绩比较基准中活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金现金类资产的业绩比较基准要素。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。上述调整不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

3、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金

（1）基准变更情况

当前业绩比较基准：

中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

调整后新业绩比较基准：

中证 800 指数收益率×90%+中债-综合全价（总值）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际资产配置

比例等不匹配，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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于境内股票资产，采用自下而上的全市场选股策略。基金合同约定本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%。基于本基金近年来平均股票仓位实际情况，同时考虑到基金合同约定本基金需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，并结合基金合同约定的其他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 60%调高至 90%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 40%调低至 5%，同时基准要素增加 5%的现金类资产；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。

调整后的新业绩比较基准中活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金现金类资产的业绩比较基准要素。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。上述调整不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

4、中泰兴为价值精选混合型证券投资基金

(1) 基准变更情况

当前业绩比较基准：

中证 800 指数收益率 $\times$ 40%+中债综合指数收益率 $\times$ 40%+恒生指数收益率 $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准：

中证 800 价值指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 30%+中债-综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 5%+活期存款基准利率 $\times$ 5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例等不匹配，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。

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，股票资产的比例为基金资产的 60-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。本基金历史数据显示，本基金长期以来呈现显著的价值投资风格。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将 A 股资产所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中证 800 价值指数，将港股资产所对应的基准指数从恒生指数调整为中证港股通综合指数(人民币)。此外，基于本基金近年平均股票仓位，同时考虑到基金合同约定本基金需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，并结合基金合同约定的其他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 60%提高至 90%（其中 A 股资产所对应的基准要素权重从 40%提高至 60%，港股资产所对应的基准要素权重从 20%提高至 30%），并将债券资产所对应的基准要素权重从 40%调低至 5%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

对于 A 股资产对应的基准要素，原业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码 000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘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 800 价值指数（指数代码 H30356）从中证 800 指数样本中，选取价值因子得分最高的 250 只证券作为指数样本，反映中证 800 指数样本中具有价值特征的上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 价值指数与基金实际持股风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。对于港股资产对应的基准要素，原业绩比较基准中，恒生指数（指数代码 HSI）包括市值最大及成交最活跃并在香港联合交易所主板上市的公司，但本基金可投港股仅限港股通标的的股票；调整后的新业绩比较基准中，中证港股通综合指数（人民币）（指数代码 930933）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，反映港股通范围内上市公司的整体表现，更适合作为本基金港股通标的的股票部分的业绩比较基准要素。此外，调整后的新业绩比较基准中活期存款基准利率具有较强的权威

性和市场影响力，适合作为本基金现金类资产的业绩比较基准要素。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。上述调整不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

5、中泰元和价值精选混合型证券投资基金

(1) 基准变更情况

当前业绩比较基准：

中证 800 指数收益率 $\times 60\%$ + 中债综合指数收益率 $\times 20\%$ + 恒生指数收益率 $\times 20\%$

调整后新业绩比较基准：

中证 800 价值指数收益率 $\times 60\%$ + 中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times 25\%$ + 中债-综合全价（总值）指数收益率 $\times 10\%$ + 活期存款基准利率 $\times 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例等不匹配，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。

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，股票资产（含存托凭证）的比例为基金资产的 60-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。本基金历史数据显示，本基金长期以来呈现显著的价值投资风格。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将 A 股资产所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中证 800 价值指数，将港股资产所对应的基准指数从恒生指数调整为中证港股通综合指数(人民币)。此外，基于本基金近年来港股通标的股票资产的平均仓位，同时考虑到基金合同约定本基金需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，并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中港股资产所对应的基准要

素权重从 20%提高至 25%，并将债券资产所对应的基准要素权重从 20%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

对于 A 股资产对应的基准要素，原业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码 000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只股票构成，反映沪深市场大中盘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 800 价值指数（指数代码 H30356）从中证 800 指数样本中，选取价值因子得分最高的 250 只证券作为指数样本，反映中证 800 指数样本中具有价值特征的上市公司证券的整体表现，调整后的中证 800 价值指数与基金实际持股风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。对于港股资产对应的基准要素，原业绩比较基准中，恒生指数（指数代码 HSI）包括市值最大及成交最活跃并在香港联合交易所主板上市的公司，但本基金可投港股仅限港股通标的股票；调整后的新业绩比较基准中，中证港股通综合指数（人民币）（指数代码 930933）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，反映港股通范围内上市公司的整体表现，更适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。此外，调整后的新业绩比较基准中活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金现金类资产的业绩比较基准要素。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。上述调整不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

6、中泰青月中短债债券型证券投资基金

（1）基准变更情况

当前业绩比较基准：

中债总财富(1-3 年)指数收益率 $\times$ 80%+一年期定期存款利率(税后) $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准：

中债-综合财富(1-3 年)指数收益率 $\times$ 45%+中债-综合财富(1 年以下)指数收益率 $\times$ 45%+一年期定期存款基准利率 $\times$ 10%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例不匹配，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。

本基金是中短债主题的债券型基金，基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的投资范围包括利率债、信用债等不同类型的债券品种，重点投资于剩余期限在 3 年以内的中短期债券资产，通过久期配置、类属资产配置，使用收益率曲线策略和息差策略进行债券投资管理。综合考虑基准指数与产品定位、投资范围、组合久期的匹配度，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，本基金将基准要素由中债总财富(1-3 年)指数调整为中债-综合财富(1-3 年)指数和中债-综合财富(1 年以下)指数。同时，考虑本基金近年来债券平均仓位实际情况，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重从 80%调高至 90%（中债-综合财富(1-3 年)指数和中债-综合财富(1 年以下)指数各 45%），并将定期存款对应的基准要素权重从 20%调低至 10%。调整后的业绩比较基准与基金在实际投资运作方面更为匹配，能够更好地反映本基金的产品定位。

原业绩比较基准中，中债总财富（1-3 年）指数（指数代码 CBA00321）隶属于中债总指数族，成分券待偿期在 1-3 年（含 1 年），由在境内公开发行且上市流通的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，是一个反映境内中短久期利率类债券整体价格走势情况的分类指数；调整后的新业绩比较基准中，中债-综合财富指数同隶属于中债总指数族，包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外的在境内公开发行且上市流通的债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，其中中债-综合财富(1-3 年)指数（指数代码 CBA00221）成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），中债-综合财富(1 年以下)指数（指数代码 CBA00211）成份券待偿期在 1 年以内，共同反映境内人民币中短久期债券市场表现，能够更好地表征本基金的投资风格。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。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。

7、中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金

(1) 基准变更情况

当前业绩比较基准:

中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 95%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 5%

调整后新业绩比较基准:

中债-综合财富(1-3 年)指数收益率 $\times$ 97%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 3%

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例不匹配,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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金通过久期配置、类属资产配置,使用收益率曲线策略和息差策略进行债券投资管理,基金合同约定投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%,投资股票资产的比例不高于基金资产的 20% (其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%)。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,以及基准指数券种和久期分布特征等,本基金将债券部分基准要素由中债综合财富(总值)指数调整为中债-综合财富(1-3 年)指数。同时,基于本基金各类资产比例的投资比例限制,结合本基金近年来的资产配置比例情况以及预期的中长期资产配置比例中枢,对本基金各业绩比较基准要素的权重进行了调整,将基准中债券资产所对应的基准要素权重由 95%调高为 97%,并将基准中 A 股股票资产所对应的基准要素权重由 5%调低为 3%,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。

原业绩比较基准中的中债综合财富(总值)指数(指数代码 CBA00201)包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外的在境内公开发行且上市流通的债券,反映境内人民币债券市场整体表现;其覆盖境内人民币债券市场各期限债券,久期较长。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3 年)指数(指数代码 CBA00221)则选取中债-综合财富指数中待偿期在 1-3 年(含 1 年)的债券作为

指数成份券，反映境内人民币中短久期债券市场表现，与基金过往投资组合久期相匹配，能够更好地表征本基金的投资风格。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。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。

8、中泰双利债券型证券投资基金

(1) 基准变更情况

当前业绩比较基准：

中债综合指数收益率 $\times 90\%$ + 沪深 300 指数收益率 $\times 7\%$ + 恒生指数收益率 $\times 3\%$

调整后新业绩比较基准：

中债-综合全价(1-3 年)指数收益率 $\times 95\%$ + 沪深 300 指数收益率 $\times 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例不匹配，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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过久期配置、类属资产配置，使用收益率曲线策略、息差策略、个券精选策略和信用利差策略等进行债券投资管理，基金合同约定投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资股票资产（含存托凭证）、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券的比例不高于基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。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，本基金将债券部分基准要素由中债综合指数调整为中债-综合全价(1-3 年)指数。同时，基于本基金各类资产比例的投资比例限制，结合本基金投资组合历史的资产配置比例情况以及预期的中长期资产配置比例中枢，将基准中债券资产所对应的基准要素权重由 90%调高为 95%，将基准中 A 股股票资产所对

应的基准要素权重由 7%调低为 5%，并删除了港股资产所对应的基准要素，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。

原业绩比较基准中的中债综合指数（全称中债-综合全价(总值)指数，指数代码 CBA00203）由在境内公开发行且上市流通的国债、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、公司债等成份券组成，反映境内人民币债券市场整体表现；其覆盖境内人民币债券市场各期限债券，久期较长。调整后的新业绩比较基准中，中债-综合全价(1-3 年)指数（指数代码 CBA00223）则选取中债-综合全价指数中待偿期在 1-3 年（含 1 年）的债券作为指数成份券，反映境内人民币中短久期债券市场表现，与基金过往投资组合久期相匹配，能够更好地表征本基金的投资风格。

基于以上情况，调整后的业绩比较基准与实际产品定位更为契合。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。

9、中泰天择稳健 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

（1）基准变更情况

当前业绩比较基准：

中债综合指数收益率 $\times 70\%$ + 沪深 300 指数收益率 $\times 30\%$

调整后新业绩比较基准：

中债-综合全价(总值)指数收益率 $\times 70\%$ + 沪深 300 指数收益率 $\times 18\%$ + 中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times 7\%$ + 上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率 $\times 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

本基金的业绩比较基准的调整主要由于现有业绩比较基准与实际投资风格、资产配置比例不匹配，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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过大类资产配置

和精选优质基金构建投资组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金增加表征港股通标的股票的中证港股通综合指数(人民币)作为基准要素，增加表征黄金资产的上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格作为基准要素。此外，基于本基金近年来的资产配置结构，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 A 股资产所对应的基准要素权重从 30%调整为 18%；同时，新增港股资产对应的基准要素权重确定为 7%，新增黄金资产对应的基准要素权重确定为 5%。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。

调整后的新业绩比较基准中，中证港股通综合指数（人民币）（指数代码 930933）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，反映港股通范围内上市公司的整体表现，适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素；上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约（合约代码 Au99.99）为在上海黄金交易所交易，代表黄金资产的现货合约，该黄金现货合约价格能较好的代表黄金资产的表现，适合作为本基金商品类资产部分的业绩比较基准。

综上，调整后的业绩比较基准与基金在实际投资运作方面更为匹配，能够更好地反映本基金的产品定位。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。