

## 中欧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，中欧基金管理有限公司（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，同时对相关基金托管人信息进行更新（如有），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	中欧启航三年持有期混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%	中证 800 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*15%+中债-综合全价（总值）指数收益率*10%
2	中欧融恒平衡混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*45%+中债综合财富（总值）指数收益率*50%+中证港股通综合指数收益率*5%	中证 800 指数收益率*45%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*15%+中债-综合财富（总值）指数收益率*40%
3	中欧价值回报混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*80%+银行活期存款利率（税后）*15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%	中证 800 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
4	中欧核心价值混合型发	沪深 300 指数收益率*80%+中证港股通综合指数（人民币）	沪深 300 指数收益率*50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率

	起式证券投资基金	收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%	*35%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
5	中欧鑫悦回报一年持有期混合型证券投资基金	中证800指数收益率*55%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+中债综合指数收益率*40%	中证800指数收益率*45%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*15%+中债-综合全价(总值)指数收益率*40%
6	中欧远见两年定期开放混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中债综合指数收益率×40%	沪深300指数收益率*60%+中债-综合全价(总值)指数收益率*30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%
7	中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金	中证500指数收益率×50%+恒生指数收益率×10%+中债综合债券指数收益率×40%	中证800指数收益率*75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*15%+中债-综合全价(总值)指数收益率*10%
8	中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)	沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%	中证800指数收益率*90%+中债-综合全价(总值)指数收益率*10%
9	中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金	金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)	中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
10	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*10%+中债综合指数收益率*85%+银行活期存款利率(税后)*5%	中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证800指数收益率*15%
11	中欧融益稳健一年持有	沪深300指数收益率*17%+中证港股通综合指数(人民币)	中债-综合财富(总值)指数收益率*90%+中证800指数收益率*7%+中

	期混合型证券投资基金	收益率*3%+中债综合财富（总值）指数收益率*80%	证港股通综合指数（人民币）收益率*3%
12	中欧瑾添混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×18%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*2%+中债综合财富(总值)指数收益率×80%	中债-综合财富（总值）指数收益率*70%+中证全指指数收益率*27%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%
13	中欧增强回报债券型证券投资基金 (LOF)	中国债券总指数	中债-1-5 年债券综合全价（总值）指数收益率*90%+中证可转换债券指数收益率*10%
14	中欧稳鑫 180 天持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率	中债-1-5 年债券综合全价（总值）指数收益率*95%+中证可转换债券指数收益率*5%
15	中欧纯债债券型证券投资基金 (LOF)	中债综合（全价）指数收益率	中债-优选投资级信用债全价（总值）指数收益率
16	中欧积极多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (ETF-FOF)	中证 A500 指数收益率×70%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×5%+中债新综合全价（总值）指数收益率×25%	中证 A500 指数收益率*55%+中债-7-10 年政策性金融债全价（总值）指数收益率*25%+MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）收益率*15%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%
17	中欧养老产业混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%	中证养老产业指数收益率*85%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%
18	中欧匠心两年持有期混合型证券投资	沪深 300 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%	沪深 300 指数收益率*50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*35%+中债-综合全价（总值）指数

	资基金		收益率*15%
19	中欧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*10%	中债-1-5年债券综合全价(总值)指数收益率*82%+沪深300指数收益率*18%
20	中欧鼎利债券型证券投资基金	中证800指数收益率*15%+中证可转换债券指数*25%+中债综合财富指数收益率*60%	中债-1-5年债券综合财富(总值)指数收益率*70%+中证可转换债券指数收益率*15%+中证800指数收益率*15%

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、业绩比较基准设定的原因(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等)、业绩比较基准要素的基本信息(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, 同时更新相应基金托管人的基本信息(如有)。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.zofund.com](http://www.zofund.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：021-68609700，400-700-9700

网址：www.zofund.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。

中欧基金管理有限公司

2026年6月27日

## 附：《业绩比较基准调整原因及合理性说明》

### 一、中欧启航三年持有期混合型证券投资基金

本基金在业绩比较基准中增加表征港股通标的股票资产部分的基准要素、更换 A 股股票部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，原业绩比较基准未包含港股通标的股票资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分股票资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 15%，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 60%提高至 75%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 40%调整至 10%。

本基金的股票资产采取自下而上的主动投资管理策略，精选价值被低估的个股。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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数成份股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成份股，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数具有市值覆盖大中小盘结合、行业分布相对更均衡等特征，与基金的投资风格等更匹配。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 二、中欧融恒平衡混合型证券投资基金

本基金调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中港股通标的股票部分的基准要素权重从 5%提高至 15%、债券资产所对应的基准要素权重相应从 50%降低至 40%。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无

实质性不利影响。

### 三、中欧价值回报混合型证券投资基金

本基金在业绩比较基准中增加表征债券资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，并可持有一定比例的现金类资产，原业绩比较基准未包含债券资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分资产的基准要素。

基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中 A 股股票部分的基准要素权重从 80%降低至 60%、港股通标的股票部分的基准要素权重从 5%提高至 25%、债券资产所对应的基准要素权重设置为 10%、现金类资产所对应的基准要素权重相应从 15%降低至 5%。

本基金的债券资产采用全市场策略，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，选取中债-国债总全价（1-3 年）指数作为债券资产部分的基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 四、中欧核心价值混合型发起式证券投资基金

本基金在业绩比较基准中增加表征债券资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，并可持有一定比例的现金类资产，原业绩比较基准未包含债券资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分资产的基准要素。

基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中 A 股股票部分的基准要素权重从 80%降低至 50%、港股通标的股票部分的基准要素权重从 10%提高至 35%、债券资产所对应的基准要素权重设置为 10%、现金类资产所对应的基准要素权重相应从 10%降低至 5%。

本基金的债券资产采用全市场策略,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,选取中债-国债总全价(1-3年)指数作为债券资产部分的基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况,调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **五、中欧鑫悦回报一年持有期混合型证券投资基金**

本基金调整业绩比较基准的要素权重,以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于A股股票、港股通标的股票、债券等资产,基于本基金历史持仓,并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢,将业绩比较基准中A股股票部分的基准要素权重从55%降低至45%、港股通标的股票部分的基准要素权重从5%提高至15%。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **六、中欧远见两年定期开放混合型证券投资基金**

本基金更换港股通标的股票部分的基准要素、调整业绩比较基准的要素权重,以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于A股股票、港股通标的股票、债券等资产,基于本基金历史持仓,并结合基金合同约定的投资比例限制以及本基金预期的资产配置比例中枢,将业绩比较基准中A股股票部分的基准要素权重从50%提高至60%、债券资产所对应的基准要素权重相应从40%降低至30%。

本基金将港股通标的股票部分的基准要素由恒生指数更换为中证港股通综合指数(人民币)。中证港股通综合指数(人民币)选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本,以反映港股通范围内上市公司的整体表现。与原基准要素恒生指数相比,该指数代表的是港股通范围内的上市公司,不含在香港上市、但非港股通的公司,与基金的实际可投资范围更加匹配。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况,调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩

比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### **七、中欧创新成长灵活配置混合型证券投资基金**

本基金在业绩比较基准中更换 A 股和港股通标的股票部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 50%提高至 75%，调整后的港股通标的股票资产所对应的要素权重由 10%提高至 15%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 40%调整至 10%。

本基金的股票资产采用全市场选股策略，自下而上精选优质上市公司构建组合。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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由中证 500 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数成份股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成份股，综合反映沪深证券市场上大中小市值公司的整体状况。与原基准要素中证 500 指数相比，该指数具有市值覆盖大中小盘结合、行业分布相对更均衡等特征，与基金的投资风格等更匹配。本基金将港股通标的股票部分的基准要素由恒生指数更换为中证港股通综合指数（人民币）。中证港股通综合指数（人民币）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，以反映港股通范围内上市公司的整体表现。与原基准要素恒生指数相比，该指数代表的是港股通范围内的上市公司，不含在香港上市、但非港股通的公司，与基金的实际可投资范围更加匹配。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### **八、中欧行业成长混合型证券投资基金 (LOF)**

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 75%提高至 90%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 25%调整至 10%。

本基金的股票资产重点配置成长性行业的优势个股。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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数成份股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成份股，综合反映沪深证券市场中大中小市值公司的整体状况。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数具有市值覆盖大中小盘结合、行业分布相对更均衡等特征，与基金的投资风格等更匹配。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 九、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金

本基金调整业绩比较基准的要素，以使新业绩比较基准代表性更强。本基金业绩比较基准由“金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）”调整为“中债-综合全价（总值）指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%”。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、A 股股票等资产，相应选取与之匹配的债券指数、A 股指数作为基准要素。此外，基于本基金近两年各类资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制，将业绩比较基准中的 A 股股票资产所对应的基准要素权重设置为 10%，并将债券资产所对应的基准要素权重设置为 90%，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。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产采用全市场策略，主要通过久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略进行投资管理。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，选取中债-综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-综合全价（总值）指数，由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

本基金将适度参与股票等权益类资产的投资。本基金原业绩比较基准未包

含股票资产所对应的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了沪深 300 指数。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，以反映沪深市场上市公司的整体表现，具有良好的市场代表性和市场影响力，与本基金的投资风格等匹配，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **十、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金**

本基金更换业绩比较基准中股票部分的基准要素、并调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 10%提高至 15%，债券资产所对应的权重保持不变，基于本基金过往仓位情况，现金类资产所对应的要素权重相应由 5%调整至 0%。

本基金适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。综合考虑基准指数与投资策略的匹配度，同时兼顾基准指数的表征性、认可度，以及样本覆盖、收益特征等，本基金将股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数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，指数样本量大，行业覆盖面广。与本基金股票资产部分的原基准要素沪深 300 指数相比，中证 800 指数具有成份股数量更多、市值覆盖大中盘结合等特征，与本基金的投资风格等更匹配。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **十一、中欧融益稳健一年持有期混合型证券投资基金**

本基金更换股票部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 17%降低至 7%，港股通标的股票资产所对应的要素权重 3%保持不变，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 80%调整至 90%。

本基金适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。综合考虑基准指数与投资策略的匹配度，同时兼顾基准指数的表征性、认可度，以及样本覆盖、收益特征等，本基金将股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数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，指数样本量大，行业覆盖面广。与本基金股票资产部分的原基准要素沪深 300 指数相比，中证 800 指数具有成份股数量更多、市值覆盖大中盘结合等特征，与本基金的投资风格等更匹配。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 十二、中欧瑾添混合型证券投资基金

本基金调整业绩比较基准的要素权重，更换 A 股股票部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制及本基金预期的资产配置比例中枢，本基金调整基准要素权重，将 A 股股票资产所对应的要素权重由 18%提高至 27%，将港股通标的股票资产所对应的要素权重由 2%提高至 3%，将债券资产所对应的要素权重相应由 80%调整至 70%。

本基金的股票资产采用全市场选股策略，重点关注公司以及所属产业的成长性与商业模式。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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由中证 800 指数更换为中证全指指数。中证全指指数由上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的股票和存托凭证组成样本，具有较高的市场代表性，反映上交所、深交所和北交所市场上市公司的整体表现。本基金将业绩比较基准中的 A 股股票部分基准要素调整为中证全指指数后，基准成份券覆盖率、相关系数等相关指标均得到优化，调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，与基金的投资风格等更匹配，代表性更强。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 十三、中欧增强回报债券型证券投资基金 (LOF)

本基金增加表征可转换债券资产的基准要素, 更换其他债券部分的基准要素, 并相应调整业绩比较基准的要素权重, 以使新业绩比较基准代表性更强。

基于本基金历史持仓, 并结合基金合同约定的投资比例限制及本基金预期的资产配置比例中枢, 本基金调整基准要素权重, 将可转换债券资产所对应的要素权重设定为 10%, 将其他债券部分所对应的要素权重由 100%调整至 90%。

本基金适度投资于可转换债券, 选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。本基金原业绩比较基准未包含可转换债券资产所对应的基准要素, 调整后增加了中证可转换债券指数, 该指数选取沪深证券交易所上市的可转换债券作为样本券, 反映沪深证券交易所可转换债券的整体表现, 适合作为本基金可转换债券资产的业绩比较基准要素。

根据过往债券配置情况, 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, 本基金将其他债券部分的基准要素设为中债-1-5 年债券综合全价 (总值) 指数。中债-1-5 年债券综合全价 (总值) 指数隶属于中债总指数族系, 该指数成分券包括在境内公开发行且上市流通、剩余期限在 1-5 年的国债、地方政府债、政策性银行债券、信用债等, 适合作为本基金其他债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况, 也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 十四、中欧稳鑫 180 天持有期债券型证券投资基金

本基金增加表征可转换债券资产的基准要素, 更换其他债券部分的基准要素, 并相应调整业绩比较基准的要素权重, 以使新业绩比较基准代表性更强。

基于本基金历史持仓, 并结合基金合同约定的投资比例限制及本基金预期的资产配置比例中枢, 本基金调整基准要素权重, 将可转换债券资产所对应的要素权重设定为 5%, 将其他债券部分所对应的要素权重由 100%调整至 95%。

本基金适度投资于可转换债券及可交换债券, 选择具有较高投资价值的可转换债券及可交换债券进行投资。本基金原业绩比较基准未包含可转换债券资产所对应的基准要素, 调整后增加了中证可转换债券指数, 该指数选取沪深证

券交易所上市的可转换债券作为样本券，反映沪深证券交易所可转换债券的整体表现，适合作为本基金可转换债券资产的业绩比较基准要素。

根据过往债券配置情况，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，本基金将其他债券部分的基准要素设为中债-1-5年债券综合全价（总值）指数。中债-1-5年债券综合全价（总值）指数隶属于中债总指数族系，该指数成分券包括在境内公开发行且上市流通、剩余期限在1-5年的国债、地方政府债、政策性银行债券、信用债等，适合作为本基金其他债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **十五、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）**

本基金更换基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。根据过往债券配置情况，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，本基金将基准要素由中债综合全价（总值）指数更换为中债-优选投资级信用债全价（总值）指数。中债-优选投资级信用债全价（总值）指数能够反映投资级信用债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **十六、中欧积极多元配置3个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）**

本基金更换业绩比较基准中债券类资产部分的基准要素，加入境外权益类资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制及本基金预期的资产配置比例中枢，本基金调整基准要素权重，将境外权益类资产所对应的要素权重设定为15%，将境内权益类资产所对应的要素权重由70%调整至55%。

对于债券类资产投资，本基金关注全市场范围内的债券类基金。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，以及基准指数样本空间、选样方法等，本基金将债券类资产部分的基准要素设定为中债-7-10年政策性金融债全价（总值）指数。中债-7-10年政策性金融债全价（总值）指数成分券包括国家开发银行、中国进出口银行、中国农业发展银行在境内公开发行业且上市流通的待偿期 6.5 年至 10 年（包含 6.5 年和 10 年）的政策性银行债，与本基金的债券类资产投资风格等更匹配，适合作为本基金债券类资产的业绩比较基准要素。

对于权益类资产投资，本基金关注全市场范围内的权益类基金（含 QDII 基金、香港互认基金等）。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，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金将权益类资产部分的基准要素由中证 A500 指数调整为中证 A500 指数和 MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）的组合。MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）是一只全球性证券市场指数，用以衡量全球成熟市场的股票业绩表现，是全球投资组合经理作为投资基准最为广泛应用的指数之一，适合作为本基金境外权益类资产的业绩比较基准要素。

调整后的新要素及要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### **十七、中欧养老产业混合型证券投资基金**

本基金更换股票部分基准要素并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于股票、债券等资产，调整后的股票资产所对应的要素权重由 75%提高至 85%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 25%降低至 15%。

本基金的股票资产主要投向受益于人口老龄化进程的上市公司股票，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，同时兼顾基准指数的表征性、认可度，以及指数主题界定、市值覆盖、行业与个股分布等，本基金将股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证养老产业指数，即由非主题指数更换为与基金主题匹配的主题指数。调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更匹配基金的主

题界定。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **十八、中欧匠心两年持有期混合型证券投资基金**

本基金在业绩比较基准中增加表征港股通标的股票资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，原业绩比较基准未包含港股通标的股票资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分股票资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 35%，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 60%降低至 50%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 40%降低至 15%。

本基金的股票资产采用全市场选股策略，采取自下而上的主动投资管理策略，精选 A 股与港股通范围内价值被低估的个股。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，本基金选取中证港股通综合指数（人民币）作为港股通标的股票部分的基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **十九、中欧双利债券型证券投资基金**

本基金更换债券资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于股票、债券等资产，调整后的股票资产所对应的要素权重由 10%提升至 18%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 90%降低至 82%。

根据过往债券配置情况，综合考虑债券部分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全价（总值）指数（规范表达为中债-综合全价（总值）指数）更换为中债-1-5 年债券综合全价（总值）指数。中债-1-5 年债券综合全价（总值）指数隶属于中债总指数族系，该指数成分券包括在境内公开发行且上市流通、剩余期限在 1-5 年

的国债、地方政府债、政策性银行债券、信用债等，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## **二十、中欧鼎利债券型证券投资基金**

本基金调整业绩比较基准中可转换债券资产、其他债券部分的要素权重，更换其他债券部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

基于本基金历史持仓，并结合基金合同约定的投资比例限制及本基金预期的资产配置比例中枢，本基金调整基准要素权重，将可转换债券资产所对应的要素权重由 25%降低至 15%，将其他债券部分所对应的要素权重由 60%提高至 70%。

根据过往债券配置情况，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，本基金将其他债券部分的基准要素设为中债-1-5 年债券综合财富（总值）指数。中债-1-5 年债券综合财富（总值）指数隶属于中债总指数族系，该指数成分券包括在境内公开发行且上市流通、剩余期限在 1-5 年的国债、地方政府债、政策性银行债券、信用债等，适合作为本基金其他债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。