

国泰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，国泰基金管理有限公司（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，同时更新相关基金的基金管理人及基金托管人信息，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	国泰事件驱动策略混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%	中证 800 指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*20%
2	国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）	35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数	中证 500 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
3	国泰量化策略收益混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%	沪深 300 指数收益率*80%+中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*10%+中证港股通综合指数（港元）收益率*5%+活期存款基准利率*5%
4	国泰景气优选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×20%	中证 800 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
5	国泰金盛回报混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中债综合指数收益率×20%	中证 800 指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债-综合全价（总值）指数收益率

			*15%+活期存款基准利率*5%
6	国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率	中证综合债指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%
7	国泰安康定期支付混合型证券投资基金	三年期银行定期存款利率（税后）	中债-综合全价（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
8	国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率	中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
9	国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率	中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
10	国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金（FOF）	沪深 300 指数收益率*10%+恒生中国企业指数收益率（估值汇率调整）*5%+中证综合债指数收益率*85%	中证综合债指数收益率*95%+沪深 300 指数收益率*5%
11	国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%	中证综合债指数收益率*55%+沪深 300 指数收益率*40%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%
12	国泰全景多资产配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）	沪深 300 指数收益率*28%+中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整）*2%+中债新综合全价（总值）指数收益率*60%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%	中债-新综合全价（总值）指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*18%+纳斯达克 100 指数（NASDAQ 100 Index）收益率*3%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*4%+活期存款基准利率*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.gtfund.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、基金产品资料概要、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：400-888-8688

网址：www.gtfund.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。

国泰基金管理有限公司

2026年6月27日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 80\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} * 80\% + \text{中债-综合财富(1-3 年) 指数收益率} * 20\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会，在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资。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 A 股股票部分的业绩比较基准要素由沪深 300 指数调整为中证 800 指数。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，以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 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，指数样本量大，行业覆盖面广，更适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

本基金的债券资产采用全市场策略，主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过收益率曲线配置等方法，进行债券投资。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，本基金债券部分的业绩比较基准要素由中证综合债券指数调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。原业绩比较基准中，中证综合债券指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，综合反映境内债券市场整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中债-综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）

（1）当前业绩比较基准： $35\% \times \text{天相中盘成长指数} + 45\% \times \text{天相小盘成长指数} + 20\% \times \text{中证全债指数}$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 500 指数收益率} * 80\% + \text{中证全债指数收益率} * 15\% + \text{活期存款基准利率} * 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象，采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素由天相中盘成长指数、天相小盘成长指数调整为中证 500 指数。原业绩比较基准中，天相中盘成长指数由中等市值、具有成长特征的股票构成，反映 A 股市场中盘成长风格股票的整体表现；天相小盘成长指数由小市值、具有成长特征的股票构成，反映 A 股市场小盘成长风格股票的整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中证 500 指数选取沪深市场中沪深 300 指数样本以外的市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，指数样本量大，行业覆盖面广，更适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

新增现金类资产部分的业绩比较基准，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部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重由 20% 调整为 15%，同时增加 5% 的现金类资产基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰量化策略收益混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 25\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} * 80\% + \text{中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率} * 10\% + \text{中证港股通综合指数（港元）收益率} * 5\% + \text{活期存款基准利率} * 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，以量化多因子模型为基础，结合组合优化策略，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合。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，结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金新增中证港股通综合指数（港元）作为港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。中证港股通综合指数（港元）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。

本基金的债券资产采用全市场策略，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金债券部分的业绩比较基准要素由中证综合债指数调整为中债-新综合财富（1-3 年）指数。原业绩比较基准中，中证综合债指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，综合反映境内债券市场整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中债-新综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

新增现金类资产部分的业绩比较基准，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部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重由 75% 调整为 85%（其中 A

股股票部分所对应的基准要素权重由 75%调整为 80%，增加港股通标的股票部分所对应的基准要素权重为 5%)，债券资产所对应的基准要素权重由 25%调整为 10%，同时增加 5%的现金类资产基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰景气优选混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} * 75\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} * 5\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} * 15\% + \text{活期存款基准利率} * 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，以基本面分析为基础，采用自下而上的分析方法构建投资组合。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 A 股股票部分的业绩比较基准要素由沪深 300 指数调整为中证 800 指数。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 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，指数样本量大，行业覆盖面广，更适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

本基金的债券资产采用全市场策略，主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向、收益率曲线以及信用风险变化分析进行投资管理。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，结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金新增中债-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）指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，综合反映境内债券市场整体表现，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的现金类资产所对应的基准要素权重由 20%调整为 5%，同时新增 15%的债券资产基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰金盛回报混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 10\% + \text{中债综合指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 10\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 15\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，以基本面分析为基础，采用自下而上的分析方法，选择估值合理、安全边际较高的个股进行投资。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 A 股股票部分的业绩比较基准要素由沪深 300 指数调整为中证 800 指数。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，以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 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，指数样本量大，行业覆盖面广，更适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

新增现金类资产部分的业绩比较基准，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部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重由 20%调整为 15%，同时增加 5%的现金类资产基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次调

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、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证综合债指数收益率} \times 80\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 20\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重由 50% 调整为 80%，股票资产所对应的基准要素权重由 50% 调整为 20%。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰安康定期支付混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：三年期银行定期存款利率（税后）

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 80\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 15\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

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，主要通过久期策略、期限结构策略和个券选择策略进行投资管理。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，本基金选取中债-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）指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，综合反映境内债券市场整体表现，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，以价值选股、组合投资为原则，通过选择高流动性股票，保证组合的高流动性；通过选择具有高安全边际的股票，保证组合的收益性；通过分散投资、

组合投资，降低个股风险与集中性风险。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，本基金选取沪深 300 指数作为 A 股股票资产的业绩比较基准要素。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。指数样本量大，行业覆盖面广，适合作为本基金 A 股股票资产的业绩比较基准要素。

本基金选取活期存款基准利率作为现金类资产部分的业绩比较基准。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部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重设置为 80%，股票资产所对应的基准要素权重设置为 15%，现金类资产所对应的基准要素权重设置为 5%。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证综合债指数收益率} \times 90\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 10\%$ 。

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重由 50% 调整为 90%，股票资产所对应的基准要素权重由 50% 调整为 10%。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收}$

益率

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 85\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

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，将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金债券部分的业绩比较基准要素由中证综合债指数调整为中债-综合财富（总值）指数。原业绩比较基准中，中证综合债指数选取在沪深交易所或银行间市场上市的国债、金融债、企业债等债券作为成份券。调整后的新业绩比较基准中，中债-综合财富（总值）指数由在境内公开发行且上市流通的主要债券品种组成，综合反映境内债券市场整体表现，更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

新增现金类资产部分的业绩比较基准，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部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重由 50%调整为 85%，A 股股票资产所对应的基准要素权重由 50%调整为 10%，同时增加 5%的现金类资产基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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。

10、国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金（FOF）

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 10\% + \text{恒生中国企业指数收益率（估值汇率调整）} \times 5\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 85\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证综合债指数收益率} \times 95\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金结合对基金经理、基金管理人的定性和定量分析,形成基金风险收益特征定位,构建基金备选库。权益类资产类别内,根据基金备选库中各基金的特点对单个基金打分,优选评分排名较高的基金构成组合;同时本基金运用定性和定量相结合的方法,综合分析上市公司投资价值和成长能力,确定投资标的股票,构建投资组合。结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别,本基金删除港股权益类资产部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制,投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢,将业绩比较基准中的权益类资产所对应的基准要素权重由 15%调整为 5%(其中 A 股权益类资产所对应的基准要素权重由 10%调整为 5%,删除 5%的港股权益类资产基准要素),固定收益类资产所对应的基准要素权重由 85%调整为 95%。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,本次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。

11、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

(1) 当前业绩比较基准: 沪深 300 指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*60%

调整后新业绩比较基准: 中证综合债指数收益率*55%+沪深 300 指数收益率*40%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金可投资于商品基金。综合考虑基准与产品定位和投资风格的匹配度,同时兼顾考虑基准的表征性、认可度,结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别,本基金新增上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格作为商品类资产部分的业绩比较基准要素。上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格为在上海黄金交易所交易、代表黄金资产的现货合约的价格,适合作为本基金商品类资产部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制,投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢,将业绩比较基准中的固定收益类资产所对应的基准要素权重由 60%调整为 55%,

同时增加 5%的商品类资产基准要素。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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。

12、国泰全景多资产配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 28\% + \text{中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整）} \times 2\% + \text{中债新综合全价（总值）指数收益率} \times 60\% + \text{上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率} \times 5\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-新综合全价（总值）指数收益率} \times 70\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 18\% + \text{纳斯达克 100 指数（NASDAQ 100 Index）收益率} \times 3\% + \text{上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率} \times 4\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金采用资产配置策略，对多类资产的市场变化趋势做出判断，并结合每类资产的风险收益特征等，确定和构造合适的资产配置比例，本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，对被动型基金和主动型基金采用不同的筛选策略，筛选出合适的权益类基金；同时本基金主要根据上市公司获利能力、成长能力以及估值水平来进行个股选择，构建投资组合。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，本基金境外权益类资产部分的业绩比较基准要素由中证港股通综合指数调整为纳斯达克 100 指数（NASDAQ 100 Index）。原业绩比较基准中，中证港股通综合指数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。调整后的新业绩比较基准中，纳斯达克 100 指数（NASDAQ 100 Index）由在纳斯达克证券市场上市的、市值最大的 100 只美国国内外非金融行业股票组成，更适合作为本基金境外权益类资产部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资比例限制，投资运作情况以及预期的资产配置比例中枢，将业绩比较基准中的固定收益类资产所对应的基准要素权重由 60%调整为 70%，权益类资产所对应的基准要素权重由 30%调整为 21%（其中境内权益类资产部分所对应的基准要素权重由 28%调整为 18%，境外权益类资产部分所对应的基准要

素权重由 2%调整为 3%)，商品类资产所对应的基准要素权重由 5%调整为 4%。

调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格，本次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。