2026年6月27日 星期六
制作:董春云 电话:010-83251716 E—mail:zqrb9@zqrb.sina.net
证券日报

大成基金管理有限公司
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,大成基金管理有限公司(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	大成均衡增长混合型证券投资基金	中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债综合全价(总值)指数收益率*20%	中证A500指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*20%
2	大成行业先锋混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*70%+中证综合债券指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%	中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总财富(1-3年)指数收益率*20%
3	大成成长领航一年持有期混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×65%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×10%+中债综合指数收益率×25%	中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*20%
4	大成科技消费股票型证券投资基金	中证科技100指数收益率×40%+中证主要消费指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合指数收益率×10%	中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+中证内地消费主题指数收益率*25%+中证港股通科技指数(人民币)收益率*10%+中证港股通消费主题指数(人民币)收益率*5%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*10%
5	大成洞察优势混合型证券投资基金	中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+银行活期存款收益率(税后)*20%	中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*20%
6	大成医药健康股票型证券投资基金	中证医药卫生指数收益率×65%+恒生指数收益率×15%+中证综合债券指数收益率×20%	中证医药卫生指数收益率*80%+中证港股通医药卫生综合指数(人民币)收益率*10%+中债-国债总财富(1-3年)指数收益率*10%
7	大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%	中证800指数收益率*75%+中债-国债总财富(1-3年)指数收益率*25%
8	大成睿浦智选三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	中证800指数收益率*50%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+中债综合指数收益率*45%	中证800指数收益率*50%+恒生指数收益率*5%+上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约价格收益率*5%+中债-综合全价(总值)指数收益率*40%
9	大成可转债增强债券型证券投资基金	中信标普可转债指数*60%+中债综合指数*40%	中证可转换债券指数收益率*80%+中债-综合财富(总值)指数收益率*10%+沪深300指数收益率*10%
10	大成元吉增利债券型证券投资基金	沪深300指数收益率*10%+中债综合全价指数收益率×85%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%	中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
11	大成元瑞诚利债券型证券投资基金	中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%	中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
12	大成元丰多利债券型证券投资基金	沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+中债综合全价指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%	中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
13	大成添鑫债券型证券投资基金	中债-综合全价(总值)指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%	中债-新综合全价(1年以下)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
14	大成元鸿锦利债券型证券投资基金	沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+中债综合全价指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%	中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
15	大成元辰招利债券型证券投资基金	中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%	中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
16	大成景泽中短债债券型证券投资基金	中债综合财富(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*95%+活期存款基准利率*5%
17	大成元享臻利债券型证券投资基金	中债-新综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%	中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+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、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.dcfund.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、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:400-888-5558

网址:www.dcfund.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。

大成基金管理有限公司
2026年6月27日

附件:业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、大成均衡增长混合型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债综合全价(总值)指数收益率*20%"调整为"中证A500指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*20%"。

业绩比较基准要素的A股股票部分方面,本基金的股票资产采用全市场选股策略,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准A股股票部分的基准要素由"中证800指数"调整为"中证A500指数"。原基准A股股票部分的基准要素"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。调整后的A股基准要素"中证A500指数"从各行业选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本,以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的港股股票部分未做调整,仍为"恒生指数"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准债券部分的基准要素由"中债综合全价(总值)指数"调整为"中债-国债总全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"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。调整后的债券基准要素"中债-国债总全价(1-3年)指数"属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置未做调整,A股股票资产、港股股票资产、债券资产所对应的基准要素权重仍为70%、10%、20%

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

2、大成行业先锋混合型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率*70%+中证综合债券指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%"调整为"中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总财富(1-3年)指数收益率*20%"。

业绩比较基准要素的A股股票部分方面,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准A股股票部分的基准要素由"沪深300指数"调整为"中证800指数"。原基准A股股票部分的基准要素"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,以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的A股基准要素"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,具有良好的市场代表性和市场影响力,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的港股股票部分未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的债券部分方面,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准债券部分的基准要素由"中证综合债券指数"调整为"中债-国债总财富(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中证综合债券指数"选取在沪深交易所或银行间市场上市的BBB及以上、且剩余期限1个月及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券,反映全市场债券的整体表现。调整后的债券基准要素"中债-国债总财富(1-3年)指数"隶属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,本基金未调整基准各要素的权重。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

3、大成成长领航一年持有期混合型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率*65%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*10%+中债综合指数收益率*25%"调整为"中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*20%"。

业绩比较基准要素的A股股票部分方面,本基金的股票资产采用全市场选股策略,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准A股股票部分的基准要素由"沪深300指数"调整为"中证800指数"。原基准A股股票部分的基准要素"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,以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的A股基准要素"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,具有良好的市场代表性和市场影响力,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的港股股票部分未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的债券部分方面,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准债券部分的基准要素由"中债综合指数"调整为"中债-国债总全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合指数"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。调整后的债券基准要素"中债-国债总全价(1-3年)指数"隶属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,对本基金各业绩比较基准要素的权重进行了调整,将基准中股票资产所对应的基准要素权重由75%调整为80%,将基准中债券资产所对应的基准要素权重由25%调整为20%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

4、大成科技消费股票型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中证科技100指数收益率×40%+中证主要消费指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合指数收益率×10%"调整为"中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+中证内地消费主题指数收益率*25%+中证港股通科技指数(人民币)收益率*10%+中证港股通消费主题指数(人民币)收益率*5%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*10%"。

业绩比较基准要素的A股股票部分,本基金重点投资于科技消费相关行业的上市公司股票,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准A股股票科技行业部分的基准要素由"中证科技100指数"调整为"中国战略新兴产业成份指数",消费行业部分的基准要素由"中证主要消费指数"调整为"中证内地消费主题指数"。

原基准要素"中证科技100指数"从科技主题空间中选取100只研发强度较高、盈利能力较强且兼具成长特征的科技龙头上市公司证券作为指数样本,调整后基准要素"中国战略新兴产业成份指数"选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的100只上市公司证券作为指数样本,以反映战略新兴产业上市公司证券的整体表现,更适合作为本基金A股股票科技行业部分的业绩比较基准要素。

原基准要素"中证主要消费指数"从中证800指数样本中选取主要消费行业(中证一级行业)上市公司证券作为指数样本,调整后基准要素"中证内地消费主题指数"成份股包括中证800指数样本股中属于主要消费和可选消费行业的上市公司,可以较好地反映沪深两市消费相关领域上市公司股票的整体表现,更适合作为本基金A股股票消费行业部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的港股股票部分,本基金重点投资于科技消费相关行业的上市公司股票,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准港股股票部分的基准要素由"恒生综合指数"调整为"中证港股通科技指数(人民币)"及"中证港股通消费主题指数(人民币)"组成的复合基准。

原基准要素"恒生综合指数"采用流通市值加权法计算,是反映香港股市价格走势最有影响的股价指数。调整后基准要素"中证港股通科技指数(人民币)"从港股通范围内选取50只市值较大、研发投入较高且营收增速较好的科技龙头上市公司证券作为指数样本,以反映港股通内科技龙头上市公司证券的整体表现,更适合作为本基金港股部分科技行业的基准要素。调整后基准要素"中证港股通消费主题指数(人民币)"从港股通证券范围内选取流动性较好、市值较大的50只消费主题相关证券作为指数样本,以反映港股通内消费类上市公司证券的整体表现,更适合作为本基金港股部分消费行业的基准要素。

业绩比较基准要素的债券部分,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准债券部分的基准要素由"中债综合指数"调整为"中债-国债总全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合指数"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。调整后的债券基准要素"中债-国债总全价(1-3年)指数"隶属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,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A股股票资产所对应的基准要素权重由80%调整为75%,其中A股科技行业基准要素的权重调整为50%,A股消费行业基准要素的权重调整为25%;港股股票资产所对应的基准要素权重由10%调整为15%,其中港股科技行业基准要素的权重为10%,港股消费行业基准要素的权重为5%;债券资产所对应的基准要素权重保持不变,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

5、大成洞察优势混合型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+银行活期存款收益率(税后)*20%"调整为"中证800指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率*20%"。

业绩比较基准要素的A股、港股股票部分的要素及权重设置均未做调整。

业绩比较基准要素的非股票部分,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准非股票部分的基准要素由"银行活期存款收益率(税后)"调整为"中债-国债总全价(1-3年)指数"。调整后的债券基准要素"中债-国债总全价(1-3年)指数"隶属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金非股票部分的业绩比较基准要素。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

6、大成医药健康股票型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中证医药卫生指数收益率×65%+恒生指数收益率×15%+中证综合债券指数收益率×20%"调整为"中证医药卫生指数收益率*80%+中证港股通医药卫生综合指数(人民币)收益率*10%+中债-国债总财富(1-3年)指数收益率*10%"。

业绩比较基准要素的A股股票部分未做调整,仍为"中证医药卫生指数"。

业绩比较基准要素的港股股票部分方面,本基金重点投资于医药健康企业相关的上市公司股票,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准港股股票部分的基准要素由"恒生指数"调整为"中证港股通医药卫生综合指数(人民币)"。原基准港股股票部分的基准要素"恒生指数"采用流通市值加权方式编制,反映香港股票市场主要上市公司的整体表现。调整后的港股基准要素"中证港股通医药卫生综合指数(人民币)"从港股通范围内选取50只流动性好、市值较大的医疗卫生行业上市公司证券作为指数样本,以反映港股通范围内医药卫生上市公司证券的整体表现,更适合作为本基金港股股票部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的债券部分方面,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准债券部分的基准要素由"中证综合债券指数"调整为"中债-国债总财富(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中证综合债券指数"选取在沪深交易所或银行间市场上市的BBB及以上、且剩余期限1个月及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券,反映全市场债券的整体表现。调整后的债券基准要素"中债-国债总财富(1-3年)指数"隶属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,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A股股票资产所对应的基准要素权重由65%调整为80%,港股股票资产所对应的基准要素权重由15%调整为10%,将基准中债券资产所对应的基准要素权重由20%调整为10%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

7、大成盛世精选灵活配置混合型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、股票特征、行业分布特点、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率*55%+中证综合债券指数收益率*45%"调整为"中证800指数收益率*75%+中债-国债总财富(1-3年)指数收益率*25%"。

业绩比较基准要素的A股股票部分方面,本基金的股票资产采用全市场选股策略,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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,本基金基准A股股票部分的基准要素由"沪深300指数"调整为"中证800指数"。原基准A股股票部分的基准要素"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,以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的A股基准要素"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,具有良好的市场代表性和市场影响力,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的债券部分方面,基于基金投资目标、投资范围、投资策略以及过往实际运作情况,本基金的债券资产预期整体偏向于中短久期利率债,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金基准债券部分的基准要素由"中证综合债券指数"调整为"中债-国债总财富(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中证综合债券指数"选取在沪深交易所或银行间市场上市的BBB及以上、且剩余期限1个月及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券,反映全市场债券的整体表现。调整后的债券基准要素"中债-国债总财富(1-3年)指数"隶属于中债-国债总指数,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,对本基金各业绩比较基准要素的权重进行了调整,将基准中股票资产所对应的基准要素权重由55%调整为75%,将基准中债券资产所对应的基准要素权重由45%调整为25%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

8、大成睿浦智选三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例特点等,本基金业绩比较基准由"中证800指数收益率*50%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+中债综合指数收益率 *45%"调整为"中证800指数收益率*50%+恒生指数收益率*5%+上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约价格收益率*5%+中债-综合全价(总值)指数收益率*40%"。

业绩比较基准要素的商品资产部分方面,本基金可能配置各类商品类基金(含商品期货基金和黄金ETF),综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度,以及指数风格特征等,本基金基准增加商品资产部分的基准要素,并选择"上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约"作为商品资产部分的基准要素。"上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约"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商品资产的表现,更适合作为本基金商品资产部分(含商品期货基金和黄金ETF)的业绩比较基准要素。

本基金其他基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,对本基金各业绩比较基准要素的权重进行了调整,将基准中商品资产所对应的基准要素权重设置为5%,将基准中债券资产所对应的基准要素权重由45%调整为40%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

9、大成可转债增强债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中信标普可转债指数*60%+中债综合指数*40%"调整为"中证可转换债券指数收益率*80%+中债-综合财富(总值)指数收益率*10%+沪深300指数收益率*10%"。

业绩比较基准要素的可转换债券部分方面,本基金主要投资于可转债等固定收益类资产,综合考虑基准指数的表征性、认可度,本基金基准可转换债券部分的基准要素由"中信标普可转债指数"调整为"中证可转换债券指数"。原基准可转换债券部分的基准要素"中信标普可转债指数"由中信标普指数公司推出,是国内较早编制的可转债指数。调整后的可转换债券基准要素"中证可转换债券指数"的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成,以反映国内市场可转换债券的总体表现,更适合作为本基金可转换债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的股票部分方面,本基金可以进行适当的股票二级市场投资以强化组合获利能力,提高预期收益水平,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格等的匹配度,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、风格特征等,将"沪深300指数"设置为本基金基准股票部分的基准要素。调整后的股票部分基准要素"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,以反映沪深市场上市公司证券的整体表现,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

本基金综合债券指数基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,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100%调整为90%,其中将可转换债券资产所对应的基准要素权重由60%调整为80%,将综合债资产所对应的基准要素权重由40%调整为10%,将基准中A股股票资产所对应的基准要素权重由0调整为10%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

10、大成元吉增利债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率*10%+中债综合全价指数收益率×85%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债综合全价指数"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合全价指数"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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1-3年)指数"同隶属于中债总指数族分类,但主要为反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的中短期债券指数,对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性,能更好地反映本基金过往实际运作情况,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金其他基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的权重设置未做调整,债券资产、A股股票资产和流动性资产所对应的基准要素权重仍为85%、10%和5%。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

11、大成元瑞诚利债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债综合全价指数"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合全价指数"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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1-3年)指数"同隶属于中债总指数族分类,但主要为反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的中短期债券指数,对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性,能更好地反映本基金过往实际运作情况,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金其他基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的权重设置未做调整,债券资产、A股股票资产、港股股票资产和流动性资产所对应的基准要素权重仍为80%、10%、5%和5%。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

12、大成元丰多利债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+中债综合全价指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债综合全价指数"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合全价指数"的指数成分券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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1-3年)指数"是中债-新综合指数细分指数之一,是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的中短期债券指数,对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性,能较好地反映本基金的投资策略,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的流动性资产部分方面,本基金选取活期存款基准利率作为流动性资产部分的基准要素。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

13、大成添鑫债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中债-综合全价(总值)指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%"调整为"中债-新综合全价(1年以下)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债-综合全价(总值)指数"调整为"中债-新综合全价(1年以下)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债-综合全价(总值)指数"的指数成分券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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1年以下)指数"是中债-新综合指数细分指数之一,是综合反映银行间债券市场和交易所债券市场的跨市场短期债券指数,对短期债券价格变动趋势有很强的代表性,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的流动性资产部分方面,本基金选取活期存款基准利率作为流动性资产部分的基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,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90%调整为95%,将基准中流动性资产所对应的基准要素权重由10%调整为5%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

14、大成元鸿锦利债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+中债综合全价指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债综合全价指数"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合全价指数"的指数成分券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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1-3年)指数"是中债-新综合指数细分指数之一,是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的中短期债券指数,对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性,能较好地反映本基金的投资策略,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

业绩比较基准要素的流动性资产部分方面,本基金选取活期存款基准利率作为流动性资产部分的基准要素。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

15、大成元辰招利债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债综合全价指数"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债综合全价指数"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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1-3年)指数"同隶属于中债总指数族分类,但主要为反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的中短期债券指数,对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性,能更好地反映本基金过往实际运作情况,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金其他基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的权重设置未做调整,债券资产、A股股票资产、港股股票资产和流动性资产所对应的基准要素权重仍为80%、10%、5%和5%。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

16、大成景泽中短债债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%"调整为"中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的流动性资产部分方面,考虑到基准要素的权威性和市场影响力,本基金选取活期存款基准利率作为流动性资产部分的基准要素。

业绩比较基准要素的权重设置方面,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,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80%调整为95%,将基准中流动性资产基准要素权重由20%调整为5%,调整后的新要素权重更符合基金所投资的资产类别过往实际运作情况。

本基金其他基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

17、大成元享臻利债券型证券投资基金

(1)业绩比较基准变更原因及差异说明

为了更科学、准确地体现本基金的投资风格,根据本基金的投资目标、投资范围、投资策略及投资比例限制等约定,并结合本基金投资组合历史的资产配置比例、债券投资情况等,本基金业绩比较基准由"中债-新综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%"。

业绩比较基准要素的债券部分方面,本基金基于宏观市场判断和信用环境的变化,重点投资于久期与投资目标相匹配的债券类资产。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"中债-新综合全价指数"调整为"中债-新综合全价(1-3年)指数"。原基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价指数"隶属于中债总指数族,该指数成分券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。调整后基准债券部分的基准要素"中债-新综合全价(1-3年)指数"同隶属于中债总指数族分类,但主要为反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的中短期债券指数,对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性,能更好地反映本基金过往实际运作情况,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金其他基准要素未做实质性调整,仅规范相关基准要素的表述方式。

业绩比较基准要素的权重设置未做调整,债券资产、A股股票资产、港股股票资产和流动性资产所对应的基准要素权重仍为80%、10%、5%和5%。

(2)相关影响说明

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格,未改变基金份额持有人的权利义务,不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征,基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化,仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。