摩根士丹利基金管理 (中国) 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，摩根士丹利基金管理(中国)有限公司(以下简称“基金管理人”)决定自2026年9月22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	摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%	中证医药卫生指数收益率*85%+中债-综合财富(1年以下)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
2	摩根士丹利内需增长混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	沪深300指数收益率*90%+中债-综合财富(1年以下)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
3	摩根士丹利民丰盈和一年持有期混合型证券投资基金	中债综合指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%	中债-综合全价(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
4	摩根士丹利数字经济混合型证券投资基金	中证数字经济主题指数收益率*80%+人民币活期存款利率(税后)*20%	中证数字经济主题指数收益率*90%+中债-综合全价(1年以下)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
5	摩根士丹利ESG量化先行混合型证券投资基金	中证中财沪深100 ESG领先指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证800 ESG基准指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
6	摩根士丹利进取优选股票型证券投资基金	沪深300指数收益率*85%+标普中国债券指数收益率*15%	中证800指数收益率*90%+活期存款基准利率*10%
7	摩根士丹利领先优势混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%	中证800指数收益率*85%+中债-综合全价(1年以下)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
8	摩根士丹利主题优选混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+标普中国债券指数收益率*20%	中证A500指数收益率*90%+中债-综合财富(1年以下)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
9	摩根士丹利卓越成长混合型证券投资基金	沪深300指数*80%+中证综合债券指数*20%	中证A500指数收益率*85%+中债-综合财富(1年以下)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
10	摩根士丹利多因子精选策略混合型证券投资基金	中证500指数*80%+中证综合债券指数*20%	中证小盘500指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
11	摩根士丹利量化多策略股票型证券投资基金	沪深300指数收益率*85%+标普中国债券指数收益率*15%	沪深300指数收益率*90%+活期存款基准利率*10%
12	摩根士丹利双利增强债券型证券投资基金	中债-企业债总全价指数收益率×40%+中证可转债指数收益率×40%+中债国债总全价指数收益率×20%	中债-企业债总全价(总值)指数收益率*70%+中债-国债总全价(总值)指数收益率*20%+中证可转换债券指数收益率*10%
13	摩根士丹利多元收益债券型证券投资基金	标普中国债券指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	沪深300指数收益率*15%+中债-综合财富(总值)指数收益率*75%+中证可转换债券指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
14	摩根士丹利安盈稳固六个月持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率	中债-综合全价(总值)指数收益率*92%+中证可转换债券指数收益率*3%+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基金管理人和基金托管人的基本信息(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、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.morganstanleyfunds.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9月22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：400-8888-668

网址：www.morganstanleyfunds.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。

摩根士丹利基金管理 (中国) 有限公司
2026年8月22日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

业绩比较基准调整原因及合理性说明

一、摩根士丹利健康产业混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

调整后的新业绩比较基准：中证医药卫生指数收益率*85%+中债-综合财富(1年以下)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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%，现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%。

(2)更换业绩比较基准要素：

在股票指数的选取方面，基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于健康产业股票，股票组合的构建主要通过对健康产业子行业的灵活配置及子行业内个股的精选，力争实现基金资产的保值增值。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，以及指数主题界定、市值覆盖、行业与个股分布等，将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证医药卫生指数。调整后的新业绩比较基准中，中证医药卫生指数由中证指数有限公司编制并发布，由中证800指数样本股中的全部医药卫生行业成份股编制而成，综合反映了A股市场的医药卫生行业整体表现，更适合作为股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面，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，债券部分的指数选取中证综合债指数调整为中债-综合财富(1年以下)指数，中债-综合财富(1年以下)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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合财富(1年以下)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征、更好匹配本基金的产品定位和投资风格，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

二、摩根士丹利内需增长混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准：沪深300指数收益率*90%+中债-综合财富(1年以下)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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%，现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%。

(2)更换业绩比较基准要素：

在债券指数的选取方面，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，债券部分的指数选取中证综合债指数调整为中债-综合财富(1年以下)指数，中债-综合财富(1年以下)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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现，本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合财富(1年以下)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征、更好匹配本基金的产品定位和投资风格，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

三、摩根士丹利民丰盈和一年持有期混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债综合指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

调整后的新业绩比较基准：中债-综合全价(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、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。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从10%提高到20%，将基准中的债券资产的基准要素权重从90%降低到75%，将现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%，更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素：股票资产和债券资产的基准要素均不变，仅有规范性修订，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

四、摩根士丹利数字经济混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：中证数字经济主题指数收益率*80%+人民币活期存款利率(税后)*20%

调整后的新业绩比较基准：中证数字经济主题指数收益率*90%+中债-综合全价(1年以下)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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、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。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重由80%调高到90%，将基准中现金资产的基准要素权重从20%降低到5%，将基准中的债券资产的基准要素权重从0%提高到5%。

(2)增加债券部分的基准要素：在基准指数的选取方面，股票及现金资产的基准要素不变，新增中债-综合全价(1年以下)指数作为债券部分的业绩比较基准。中债-综合全价(1年以下)指数隶属于中债总指数族系，由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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，因此采用中债-综合全价(1年以下)指数，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

五、摩根士丹利ESG量化先行混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：中证中财沪深100 ESG领先指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准：中证800 ESG基准指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%，新增活期存款基准利率作为现金资产部分的基准要素，并设置5%的权重。

(2)更换业绩比较基准要素：在基准指数的选取方面，股票部分的基准指数由中证中财沪深100 ESG领先指数调整为中证800 ESG基准指数，债券部分的基准指数维持不变仍为中证综合债券指数，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

在股票指数的选取方面，基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过大类资产配置和量化优选的方法，精选符合ESG要求的股票进行投资，力争获取超越比较基准的投资回报与长期资本增值。本基金原股票资产的基准指数中证中财沪深100 ESG领先指数的编制存在两方面局限：1)该指数样本空间局限于沪深300指数，选股空间相对过窄，不能较好满足本基金投资运作和风险管理需要；2)本基金开展ESG投资主要使用负面剔除的方法，而原基准的股票指数采用ESG正向纳入方法。中证800 ESG基准指数从中证800样本中剔除中证一级行业内ESG分数最低的20%的上市公司证券，选取剩余证券作为指数样本，为ESG投资提供业绩基准和投资标的，与原基准要素中证中财沪深100 ESG领先指数相比，该指数与基金合同界定的ESG主题更匹配，更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

六、摩根士丹利进取优选股票型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数收益率*85%+标普中国债券指数收益率*15%

调整后的新业绩比较基准：中证800指数收益率*90%+活期存款基准利率*10%

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：本基金为股票型基金，根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从85%提高到90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从15%调整为0%，将基准中的现金资产的基准权重由0%提高到10%。

(2)更换业绩比较基准要素：在基准指数的选取方面，股票部分的基准指数由沪深300指数调整为中证800指数，删除了债券部分的基准指数标普中国债券指数，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

在股票指数的选取方面，基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金在保持较高比例股票仓位和弱化行业配置的基础上，坚持以“自下而上”个股精选策略精选进取优选相关股票，包括1)该企业处于趋势向上的优质行业；2)该企业为所处行业内最优质的公司；3)该企业具有激励充分的一流管理团队。预期投资的股票标的既有大市值公司、也有比例不低的中小市值公司。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。与原基准要素沪深300指数相比，中证800指数与基金界定的进取主题更匹配，更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

删除了债券部分的基准指数，主要原因是产品长期以来保持较高仓位的股票资产，不进行债券部分的交易。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征、更好匹配本基金的产品定位和投资风格，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

七、摩根士丹利领先优势混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%调整后的新业绩比较基准：中证800指数收益率*85%+中债-综合全价(1年以下)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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%调整为10%，将基准中的现金资产的基准权重由0%提高到5%。

(2)更换业绩比较基准要素：在基准指数的选取方面，股票部分的基准指数由沪深300指数调整为中证800指数，债券部分的基准指数由中债综合指数调整为中债-综合全价(1年以下)指数，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

在股票指数的选取方面，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只股票构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。根据过往持仓情况，调整后的中证800指数与基金实际持股风格更为匹配。

在债券指数的选取方面，中债-综合全价(1年以下)指数作为债券部分的业绩比较基准。中债-综合全价(1年以下)指数隶属于中债总指数族系，由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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。根据过往持仓情况，本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合全价(1年以下)指数更适合作为债券部分的业绩比较基准。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

八、摩根士丹利主题优选混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数收益率*80%+标普中国债券指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准：中证A500指数收益率*90%+中债-综合财富(1年以下)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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%，将现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%，更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素：

在股票指数的选取方面，基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金采用自上而下的“主题投资分析框架”，通过主题挖掘、主题配置和主题投资三个步骤，筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。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，以及指数市值覆盖、行业与个股分布等，将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数；该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，覆盖沪深市场各行业龙头，既包含传统行业蓝筹，也涵盖新兴产业代表，反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现，表征性更强，与产品定位更契合。

在债券指数的选取方面，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，将债券部分的指数由标普中国债券指数调整为中债-综合财富(总值)指数及中证可转换债券指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有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，是中债指数应用最广泛指数之一。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。以上两个债券指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

九、摩根士丹利卓越成长混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数*80%+中证综合债券指数*20%

调整后的新业绩比较基准：中证A500指数收益率*85%+中债-综合财富(1年以下)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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%，将现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%，更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素：

在股票指数的选取方面，基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金采取自下而上精选个股的投资策略，主要投资于具备持续成长能力并有一定估值优势的上市公司，即有形或无形资产持续增长的企业、市场占有率不断提升的企业、所处市场发展空间广阔的企业、技术或服务水平超越同行的企业、突破瓶颈进入成长发展轨道的企业等等。综合考虑基准指数与产品定位、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、行业与个股分布等，将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数；该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，反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现，表征性更强，与产品定位更契合。

在债券指数的选取方面，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，将债券部分的指数由中证综合债券指数调整为中债-综合财富(1年以下)指数；该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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合财富(1年以下)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十、摩根士丹利多因子精选策略混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准：中证500指数*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准：中证小盘500指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%，现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%。

(2)更换业绩比较基准要素：

在股票指数的选取方面，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，将债券部分的指数由中证综合债券指数调整为中债-综合财富(1年以下)指数；该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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合财富(1年以下)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十一、摩根士丹利量化多策略股票型证券投资基金

1、原业绩比较基准：沪深300指数收益率*85%+标普中国债券指数收益率*15%

调整后的新业绩比较基准：沪深300指数收益率*90%+活期存款基准利率*10%

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从85%提高到90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从15%降低到0%，将现金类资产的基准要素权重从0%提高到10%，更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素：在基准指数的选取方面，股票部分的基准指数由沪深300指数调整为中证A500指数；该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，成份券待偿期在1年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现。本基金对债券的配置以流动性管理为主，整体组合久期主要为短久期，中债-综合财富(1年以下)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十二、摩根士丹利双利增强债券型证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债企业债总全价指数收益率×40%+中证可转债指数收益率×40%+中债国债总全价指数收益率×20%

调整后的新业绩比较基准：中债-企业债总全价(总值)指数收益率*70%+中债-国债总全价(总值)指数收益率*20%+中证可转换债券指数收益率*10%

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

本基金业绩比较基准的调整涉及基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

根据过往仓位情况，将基准中的企业债的基准要素权重从40%提高到70%，将基准中的可转债基准要素权重从40%降低到10%。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十三、摩根士丹利多元收益债券型证券投资基金

1、原业绩比较基准：标普中国债券指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

调整后的新业绩比较基准：沪深300指数收益率*15%+中债-综合财富(总值)指数收益率*75%+中证可转换债券指数收益率*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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：根据过往仓位情况，将基准中的股票资产的基准要素权重从10%提高到15%，将基准中的债券资产的基准要素权重从90%降低到80%，其中，将债券资产中的利率债及信用债的基准要素权重设置为75%，增加5%的可转债的基准要素权重，并增加5%的现金类资产基准。

(2)更换业绩比较基准要素：

在债券指数的选取方面，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，将债券部分的指数由标普中国债券指数调整为中债-综合财富(总值)指数及中证可转换债券指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有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，是中债指数应用最广泛指数之一。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。以上两个债券指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

另外，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十四、摩根士丹利安盈稳固六个月持有期债券型证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债综合指数收益率

调整后的新业绩比较基准：中债-综合全价(总值)指数收益率*92%+中证可转换债券指数收益率*3%+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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、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。

(1)调整业绩比较基准的要素权重：将基准中的债券资产的基准要素权重从100%降低到95%，其中，将债券资产中的利率债及信用债的基准要素权重降低为92%，将债券资产中的可转债的基准要素权重从0%提高到3%，增加5%的现金类资产基准，更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素：

根据本基金近年来可转换债券的仓位情况，债券资产基准要素新增中证可转换债券指数。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，新增该指数更能准确反映基金实际投资组合的收益来源，更加贴合基金实际投资操作，适合作为本基金可转换债券部分的业绩比较基准要素。

另外，并新增活期存款基准利率代表法规要求的现金仓位。

基于以上情况，本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，更加清晰反映基金的风险收益特征，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

国寿安保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比较基准的可比性，经与各基金托管人协商一致，国寿安保基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)决定自2026年9月21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。

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	国寿安保稳弘混合型证券投资基金	中债综合指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%	中债-综合财富(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
2	国寿安保品质消费股票型发起式证券投资基金	中证可选消费指数收益率*40%+中证主要消费指数收益率*35%+中证全债指数收益率*20%+中证港股通大消费主题指数收益率*5%	中证主要消费指数收益率*80%+中证港股通大消费主题指数(人民币)收益率*10%+中证全债指数收益率*10%
3	国寿安保稳泉灵活配置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(全价)*40%	中证800指数收益率*85%+中债-综合全价(总值)指数收益率*15%
4	国寿安保农业产业股票型发起式证券投资基金	申万农林牧渔一级行业指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%	中证大农业指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%
5	国寿安保泰悦3个月滚动持有债券型证券投资基金	中债综合(全价)指数收益率*80%+一年期人民币定期存款基准利率(税后)*20%	中债-综合全价(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款基准利率*20%
6	国寿安保泰裕债券型证券投资基金	中债综合指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%	中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+沪深300指数收益率*7%+恒生指数收益率*3%
7	国寿安保稳福6个月持有期混合型证券投资基金	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*5%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%	中债-综合全价(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
8	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*35%+恒生指数收益率*35%+中证综合债券指数收益率*30%	中证800指数收益率*80%+中证全债指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%
9	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%	沪深300指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
10	国寿安保研究精选混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%	沪深300指数收益率*90%+中证全债指数收益率*10%
11	国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%	中证高端制造主题指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
12	国寿安保智慧生活股票型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率(全价)*20%	中证800指数收益率*85%+中债-综合全价(总值)指数收益率*15%
13	国寿安保稳鑫一年持有期混合型证券投资基金	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*5%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%	中债-综合全价(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
14	国寿安保科技创新混合型证券投资基金(LOF)	中证500指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%	中国战略新兴产业成份指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
15	国寿安保健康科学混合型证券投资基金	中证医药卫生指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%	中证医药卫生指数收益率*90%+中证全债指数收益率*10%
16	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%	中证800指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
17	国寿安保裕安混合型证券投资基金	上证国债指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+恒生指数收益率*5%	中债-综合全价(总值)指数收益率*55%+沪深300指数收益率*40%+恒生指数收益率*5%
18	国寿安保稳安混合型证券投资基金	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*5%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%	中债-综合全价(总值)指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
19	国寿安保尊恒利率债债券型证券投资基金	中债-国债及政策性银行债指数收益率	中债-国债及政策性银行债全价(总值)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
20	国寿安保高端装备股票型发起式证券投资基金	中证高端装备制造指数收益率*80%+中债综合指数收益率*15%+中证港股通科技指数收益率*5%	中证高端装备制造指数收益率*80%+中债-综合全价(总值)指数收益率*15%+中证港股通工业综合指数(人民币)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