

## 摩根基金管理(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,摩根基金管理(中国)有限公司(以下简称“基金管理人”)决定自2026年11月30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 | 基金名称                                 | 原基金合同业绩比较基准                                                                         | 调整后的新业绩比较基准                                                                     |
|----|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 1  | 摩根阿尔法混合型基金证券投资<br>基金                 | 沪深300指数收益率*90%+中债总指数<br>收益率*10%                                                     | 中证800指数收益率*90%+中债-总全价(总值)指<br>数收益率*10%                                          |
| 2  | 摩根双息平衡混合型证券投资<br>基金                  | 中债总指数收益率*50%+中债红利指数<br>收益率*50%                                                      | 中证红利指数收益率*70%+中债-总全价(总值)指<br>数收益率*30%                                           |
| 3  | 摩根亚太优势混合型证券投资基<br>金(MQI)             | 摩根世界综合全亚太指数(不含日本)<br>(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japn)                           | MSCI亚太红利日本指数(MSCI AC Asia Pacific ex<br>Japan Index ex Japn)收益率*10%             |
| 4  | 摩根全球新兴市场混合型基金投<br>资基金(MQII)          | 摩根新兴市场全球混合指数(总回报)                                                                   | MSCI新兴市场指数(MSCI Emerging Markets In-<br>dex)收益率*90%+中债-总全价(总值)指数收<br>益率*10%     |
| 5  | 摩根全球天然资源混合型基金<br>证券投资(MQIII)         | 标普全球矿产及能源指数(S&P Global<br>Mining & Energy Index)收益率                                 | 标普全球矿产及能源指数(S&P Global Mining &<br>Energy Index)收益率*90%+中债-总全价(总值)指<br>数收益率*10% |
| 6  | 摩根领航动力灵活配置混合基<br>金证券投资               | 沪深300指数收益率*80%+中债总指数<br>收益率*20%                                                     | 中证800成长指数收益率*85%+中债-总全价(总<br>值)指数收益率*15%                                        |
| 7  | 摩根民生需求混合型证券投资基<br>金                  | 沪深300指数收益率*85%+中债总指数<br>收益率*15%                                                     | 中证800成长指数收益率*85%+中债-总全价(总<br>值)指数收益率*15%                                        |
| 8  | 摩根整合驱动灵活配置混合基<br>金证券投资               | 中证800指数收益率*90%+中债总指数<br>收益率*10%                                                     | 中证800成长指数收益率*85%+中债-总全价(总<br>值)指数收益率*15%                                        |
| 9  | 摩根科技前沿灵活配置混合基<br>金证券投资               | 中证800指数收益率*90%+行业流行指<br>数收益率*10%                                                    | 中证800成长指数收益率*85%+中债-中债-中国<br>总全价(总值)指数收益率*15%                                   |
| 10 | 摩根创新商业模式灵活配置混<br>合型基金证券投资            | 中证800相对成长指数收益率*60%+中<br>证800相对成长指数收益率*70%+中证港股通<br>综合指数收益率*20%+中证港股通综合指数<br>收益率*10% | 中证800相对成长指数收益率*70%+中证800成长指<br>数收益率*20%+中债-总全价(总值)指数收益率*10%                     |
| 11 | 摩根香港精选港股通混合基金<br>证券投资                | 中证港股通综合指数收益率*70%+中<br>证800成长指数收益率*30%                                               | 中证港股通综合指数(人民币)收益率*85%+中<br>债-总全价(总值)指数收益率*15%                                   |
| 12 | 摩根安裕回报混合型证券投资<br>基金                  | 中证综合债券指数收益率*70%+中<br>证300指数收益率*30%                                                  | 中债-综合全价(1-3年)指数收益率*75%+中<br>证800指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人<br>民币)收益率*5%              |
| 13 | 摩根核心精选股票型证券投资<br>基金                  | 中证800指数收益率*85%+中债总指数<br>收益率*15%                                                     | 中证800成长指数收益率*90%+中债-总全价(总<br>值)指数收益率*10%                                        |
| 14 | 摩根动力精选混合型证券投资<br>基金                  | 中证800指数收益率*80%+中债总指数<br>收益率*20%                                                     | 中证800成长指数收益率*90%+中债-总全价(总<br>值)指数收益率*10%                                        |
| 15 | 摩根稳健均衡养老目标一年持<br>有期混合型基金中基金<br>(FOF) | 中证800指数收益率*50%+中证综合<br>指数收益率*45%+活期存款利率(后)<br>5%                                    | 中证A500指数收益率*50%+中债-新综合全价(总<br>值)指数收益率*50%                                       |
| 16 | 摩根稳健均衡养老目标一年持<br>有期混合型基金中基金<br>(FOF) | 中证800指数收益率*75%+上证国债<br>收益率*15%+中证港股通综合指数(人<br>民币)收益率*10%                            | 中证800成长指数收益率*70%+中证港股通综合指<br>数(人民币)收益率*20%+上证国债收益率*10%                          |
| 17 | 摩根稳健均衡养老目标一年持<br>有期混合型基金中基金<br>(FOF) | 中证综合债券指数收益率*70%+中证800<br>指数收益率*20%+活期存款利率(后)<br>10%                                 | 中债-新综合全价(总值)指数收益率*80%+中<br>证A500指数收益率*20%                                       |
| 18 | 摩根慧见两年持有期混合基<br>金证券投资                | 中证800指数收益率*70%+上证国债<br>收益率*20%+中证港股通综合指数<br>收益率*10%                                 | 中证800成长指数收益率*70%+中证港股通综合指<br>数(人民币)收益率*20%+上证国债收益率*10%                          |
| 19 | 摩根远见两年持有期混合基<br>金证券投资                | 中证800指数收益率*75%+上证国债<br>收益率*15%+中证港股通综合指数<br>收益率*10%                                 | 中证800成长指数收益率*70%+中证港股通综合指<br>数(人民币)收益率*20%+上证国债收益率*10%                          |
| 20 | 摩根行业领先股票型证券投资<br>基金                  | 中证800指数收益率*60%+中证港股<br>通综合指数收益率*20%+活期存款利率(后)<br>15%                                | 中证800指数收益率*90%+中证港股通综合指数<br>(人民币)收益率*10%+上证国债收益率*10%                            |
| 21 | 摩根安裕回报混合型证券投资<br>基金                  | 中证政策性金融债1-3年指数收益<br>率*40%+中证800指数收益率*15%+中证<br>800成长指数收益率*5%                        | 中债-综合全价(1-3年)指数收益率*70%+中<br>证800指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人<br>民币)收益率*10%             |
| 22 | 摩根沃享远一年持有期混<br>合型证券投资基金              | 中证800指数收益率*60%+中证港股<br>通综合指数收益率*20%+上证国债<br>收益率*15%                                 | 中证800成长指数收益率*70%+中证港股通综合指<br>数(人民币)收益率*20%+上证国债收益率*10%                          |
| 23 | 摩根博睿均衡一年持有期混<br>合型基金(FOF)            | 中证800指数收益率*50%+中证综合<br>指数收益率*40%+活期存款利率(后)<br>10%                                   | 中证A500指数收益率*50%+中债-新综合全价(总<br>值)指数收益率*50%                                       |
| 24 | 摩根90天持有期债券型证券投资<br>基金                | 中债综合全价(总值)指数收益率*90%+<br>一年定期存款基准利率(后)*10%                                           | 中债-综合全价(1-3年)指数收益率*95%+一年<br>定期存款基准利率(后)*5%                                     |
| 25 | 摩根60天持有期债券型证券投资<br>基金                | 中债综合全价(总值)指数收益率*90%+<br>一年定期存款基准利率(后)*10%                                           | 中债-综合全价(1-3年)指数收益率*90%+一年<br>定期存款基准利率(后)*10%                                    |
| 26 | 摩根30天持有期债券型证券投资<br>基金                | 中债综合全价(总值)指数收益率*90%+<br>一年定期存款基准利率(后)*10%                                           | 中债-综合全价(1年)以下指数收益率*85%+一<br>年期定期存款基准利率(后)*15%                                   |

上述基金调整业绩比较基准的原因、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(am.jpmorgan.cn)和中国证监会基金电子披露网站(hqplf.csrc.gov.cn/fund)发布。投资者办理基金交易等相关业务,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11月30日起生效。

### 四、其他事项

(一)投资者可通过以下途径咨询有关情况

客服电话:400-889-4888

公司网址:am.jpmorgan.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型、风险承受能力等级和基金的风险等级进行划分,并提出适当性意见。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,选择适合自身的基金。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,由投资者自行承担。

特此公告。

摩根基金管理(中国)有限公司

2026年10月31日

### 附:业绩比较基准调整原因及合理性说明

#### 一、摩根阿尔法混合型基金证券投资

1、调整前业绩比较基准:沪深300指数收益率\*80%+中债总指数收益率\*20%

调整后业绩比较基准:中证800指数收益率\*90%+中债-总全价(总值)指数收益率\*10%。

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从80%提升到90%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%。

(2)更换业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金股票资产采用宽跨式技术,同步以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的择股流程中,精选个股,起始执行,构造出相对均衡的不同风格资产组合。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,以及指数类别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金A股股票部分的基准要素由沪深300指数调整为中证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,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现,指标样本量大,行业覆盖面广,适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

#### 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。

#### 二、摩根双息平衡混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中债总指数收益率\*55%+中债红利指数收益率\*45%

调整后业绩比较基准:中证红利指数收益率\*70%+中债-总全价(总值)指数收益率\*30%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从45%提升到70%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从55%降低到30%。

#### 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。

#### 三、摩根亚太优势混合型证券投资基金(MQI)

1、调整前业绩比较基准:摩根世界综合全亚太指数(不含日本)(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)调整后业绩比较基准:MSCI亚太(除日本)指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index)收益率\*90%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率\*10%。

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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境外股票资产的基准要素权重从100%降到90%,将基准中的债券资产的基准要素权重定为10%。

(2)新增业绩比较基准要素:根据过往仓位情况,并结合基金的投资目标、投资范围和投资策略,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)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-国债总全价(1-3年)指数属于中债-国债总全价指数族,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、待偿期在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映境内中短期国债整体价格走势情况,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-国债总全价(1-3年)指数属于中债-国债总全价指数族,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、待偿期在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映境内中短期国债整体价格走势情况,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

#### 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。

#### 四、摩根全球新兴市场混合型基金证券投资(MQII)

1、调整前业绩比较基准:摩根新兴市场综合指数(总回报)

调整后业绩比较基准:MSCI新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index)收益率\*90%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率\*10%。

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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境外股票资产的基准要素权重从100%降到90%,将基准中的债券资产的基准要素权重定为10%。

(2)新增业绩比较基准要素:根据过往仓位情况,并结合基金投资目标、投资范围和投资策略,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)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-国债总全价(1-3年)指数属于中债-国债总全价指数族,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、待偿期在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映境内中短期国债整体价格走势情况,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

#### 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。

#### 五、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(MQIII)

1、调整前业绩比较基准:标普全球矿产及能源指数(S&P Global Mining & Energy Index)收益率

调整后业绩比较基准:标普全球矿产及能源指数(S&P Global Mining & Energy Index)收益率\*90%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率\*10%。

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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境外股票资产的基准要素权重从100%降到90%,将基准中的债券资产的基准要素权重定为10%。

(2)新增业绩比较基准要素:根据过往仓位情况,并结合基金投资目标、投资范围和投资策略,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)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-国债总全价(1-3年)指数属于中债-国债总全价指数族,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、待偿期在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映境内中短期国债整体价格走势情况,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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。

#### 六、摩根领航动力灵活配置混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:沪深300指数收益率\*80%+中债总指数收益率\*20%

调整后业绩比较基准:中证800成长指数收益率\*85%+中债-总全价(总值)指数收益率\*15%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从80%提升到85%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到15%。

(2)更换业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金将以经济转型作为行业配置和个股选择的主线,重点投资于受益于经济转型和战略扶持、具有良好基本面和持续成长能力的上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。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,以及指数市值覆盖、行业与个股分布等,本基金股票部分的基准要素由沪深300指数调整为中证800成长指数。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的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。

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。

#### 七、摩根民生需求混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:沪深300指数收益率\*85%+中债总指数收益率\*15%

调整后业绩比较基准:中证800成长指数收益率\*85%+中债-总全价(总值)指数收益率\*15%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

调整业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金将通过系统和深入的基本面研究,重点投资于与民生相关行业的上市公司,分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格与主题性的匹配度,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,本基金股票部分的基准要素由沪深300指数调整为中证800成长指数。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的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。

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。

#### 八、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中证800指数收益率\*60%+中债总指数收益率\*40%

调整后业绩比较基准:中证800成长指数收益率\*85%+中债-总全价(总值)指数收益率\*15%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从60%提升到85%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从40%降低到15%。

(2)更换业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金股票资产将重点投资于基本面相关的上市公司,精选未来具有较高成长潜力的公司。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,以及指数类别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金A股股票部分的基准要素由沪深300指数调整为中证800成长指数。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的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。

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。

#### 九、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中证800指数收益率\*80%+银行活期存款利率(后)\*20%

调整后业绩比较基准:中国战略新兴产业成份指数收益率\*85%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率\*15%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从80%提升到85%,增设债券指数要素并将权重设置为15%,同时删除活期存款利率要素。

(2)更换业绩比较基准要素:在基准要素的选取方面,本基金的股票资产将通过系统和深入的基本面研究,密切关注于科技前沿,通过高精尖科学技术为经济发展带来新增力量的相关行业及公司,重点投资于科技前沿主题相关行业的上市公司,分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格与主题性的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度,以及指数类别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金A股股票部分的基准要素由中证800指数调整为中证800成长指数。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的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。

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,增设债券指数要素,并将中债-国债总全价(1-3年)指数作为债券部分的指数,同时删除活期存款利率要素。中债-国债总全价(1-3年)指数属于中债-国债总全价指数族,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、待偿期在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映境内中短期国债整体价格走势情况,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

#### 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。

#### 十、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中证800相对成长指数收益率\*65%+中证港股通指数收益率\*20%+银行活期存款利率(后)\*15%

调整后业绩比较基准:中证800相对成长指数收益率\*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*20%+中债-国债总全价(1-3年)指数收益率\*10%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股股票资产的基准要素权重从65%提升到70%,增设债券指数要素并将权重设置为10%,同时删除活期存款利率要素。

(2)更换业绩比较基准要素: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,增设债券指数要素,并将中债-国债总全价(1-3年)指数作为债券部分的指数,同时删除活期存款利率要素。中债-国债总全价(1-3年)指数属于中债-国债总全价指数族,该指数成分券由在境内公开发行且上市流通、待偿期在1-3年(含1年)的记账式国债组成,反映境内中短期国债整体价格走势情况,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

#### 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。

#### 十一、摩根香港精选港股通混合型基金证券投资

1、调整前业绩比较基准:中证港股通综合指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%

调整后业绩比较基准:中证港股通综合指数(人民币)收益率\*85%+中债-总全价(总值)指数收益率\*15%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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港股通股票资产的基准要素权重从70%提升到85%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从30%降低到15%。

#### 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。

#### 十二、摩根安裕回报混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中证综合债券指数收益率\*70%+沪深300指数收益率\*30%

调整后业绩比较基准:中债-综合全价(1-3年)指数收益率\*75%+中证800指数收益率\*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*5%。

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,并结合基金合同约定的投资比例限制,将

业绩比较基准中的港股资产的基准要素权重设置为5%,将业绩比较基准中的A股资产的基准要素权重从30%降低到20%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从70%提升到75%。

(2)新增业绩比较基准要素:根据过往仓位情况,综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度,在调整后的业绩比较基准中增加中证港股通综合指数(人民币)作为港股资产的业绩比较基准要素。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,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股票部分的业绩比较基准要素。

(3)更换业绩比较基准要素:在基准要素的选取方面,基于基金投资目标、投资范围和投资策略,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,债券部分的基准要素由中证政策性金融债调整为中债-综合全价(1-3年)指数。中债-综合全价(1-3年)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1-3年(含1年),反映境内人民币中短期债券市场整体表现,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,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,以及指数类别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,A股部分的基准要素由沪深300指数调整为中证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,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现,适合作为本基金A股股票部分的基准要素。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的上市公司证券的整体表现,适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

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。

#### 十三、摩根核心精选股票型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中证800指数收益率\*85%+中债总指数收益率\*15%

调整后业绩比较基准:中证800成长指数收益率\*90%+中债-总全价(总值)指数收益率\*10%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从85%提升到90%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从15%降低到10%。

(2)更换业绩比较基准要素:本基金的股票资产采用严谨、规范的选择方法与积极主动的投资风格相结和,通过“自下而上”的个股筛选策略,精选公司治理良好且具有较好成长性的公司,分享其发展的成长和成长机会。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,以及指数类别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金股票部分的基准要素由中证800指数调整为中证800成长指数。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的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。

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。

#### 十四、摩根动力精选混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准:中证800指数收益率\*80%+中债总指数收益率\*20%

调整后业绩比较基准:中证800成长指数收益率\*90%+中债-总全价(总值)指数收益率\*10%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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股票资产的基准要素权重从80%提升到90%,将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%。

(2)更换业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金的股票资产将自下而上精选具有较高成长潜力的公司构建投资组合,并在实际投资过程中,基于基本面分析、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,以及指数类别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金股票部分的基准要素由中证800指数调整为中证800成长指数。中证800成长指数由中证800指数样本中,选取成长因子得分最高的150只证券作为指数样本,并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权,反映中证800指数样本中具有成长特征的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。

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。

#### 十五、摩根博睿均衡养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)

1、调整前业绩比较基准:中证800指数收益率\*50%+中证综合债券指数收益率\*45%+活期存款利率(后)\*5%

调整后业绩比较基准:中证A500指数收益率\*50%+中债-新综合全价(总值)指数收益率\*50%

#### 2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

(1)调整业绩比较基准的要素权重:根据过往仓位情况,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固定收益类资产的基准要素权重从45%提升至50%,同时删除活期存款利率要素。

(2)更换业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和策略,本基金的权益类资产资产基于资产配置策略,综合运用定量分析和定性分析的方式对