# 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 11 月 30 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 | 国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金 | 50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债券指数收益率 | 中证 A500 指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10% |
| 2 | 国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50% | 中债-新综合全价（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15% |
| 3 | 国泰金龙行业精选证券投资基金 | 75%×〖上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均〗+25%×〖上证国债指数〗 | 中证 800 指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*20% |
| 4 | 国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中证综合债指数收益率×80% | 中债-新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5% |
| 5 | 国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中证综合债指数收益率×80% | 中债-新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 6 | 国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50% | 沪深 300 指数收益率*85%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15% |
| 7 | 国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金 | 申银万国制造业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20% | 申银万国制造业指数收益率*85%+中证港股通工业综合指数（港元）收益率*5%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%+活期存款基准利率*5% |
| 8 | 国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×50%＋中证综合债指数收益率×50% | 中证 800 指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*20% |
| 9 | 国泰大农业股票型证券投资基金 | 中证大农业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20% | 中证大农业指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*5%+活期存款基准利率*5% |
| 10 | 国泰民福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 | 沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债指数收益率*25% |
| 11 | 国泰智能汽车股票型证券投资基金 | 中证新能源汽车指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20% | 中证新能源汽车指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10% |
| 12 | 国泰智能装备股票型证券投资基金 | 中证高端装备制造指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20% | 中证高端装备制造指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10% |
| 13 | 国泰互联网+股票型证券投资基金 | 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*85%+中证综合债指数收益率*15% |
| 14 | 国泰聚鑫量化选股混合型发起式证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×75%+银行活期存款利率（税后）×20%+中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整）×5% | 沪深 300 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（港元）收益率*5%+中债-新综合全价（总值）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5% |
| 15 | 国泰浓益灵活配置混合型证券投资 | 三年期银行定期存款利率（税后）+2% | 中债-新综合全价（总值）指数收益率*55%+沪深 300 指数收益率*40%+活期存款基准利 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 基金 | | 率*5% |
| 16 | 国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金 | 沪深 300 指数收益率×50%＋中证综合债券指数收益率×50% | 中证 800 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20% |
| 17 | 国泰润利纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5% |
| 18 | 国泰可转债债券型证券投资基金 | 中证可转换债券指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10% | 中证可转换债券指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*10%+中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*10% |
| 19 | 国泰聚禾纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5% |
| 20 | 国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5% |
| 21 | 国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5% |
| 22 | 国泰合融纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5% |
| 23 | 国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5% |
| 24 | 国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金 | 中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5% | 中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*5%+活期存款基准利率*5% |
| 25 | 国泰安璟债券型证券投资基金 | 中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5% | 中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5% |
| 26 | 国泰信瑞纯 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 债债券型证券投资基金 | | （总值）指数收益率*80%+中债-国开行债券总财富（3-5年）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5% |
| 27 | 国泰金龙债券证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5% |
| 28 | 国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金 | 中证综合债指数收益率 | 中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率 |
| 29 | 国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金 | （经估值日汇率调整后的）摩根大通亚洲债券中国总收益指数（JACI China Total Return Index） | 摩根大通亚洲债券中国总收益指数（J.P. Morgan Asia Credit Index (JACI) China Total Return Index）收益率*50%+彭博离岸人民币债券指数（Bloomberg Offshore Renminbi (CNH) Index）收益率*45%+人民币活期存款基准利率*5% |
| 30 | 国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-LOF） | 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%+中证综合债指数收益率*10% |

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 10 月 31 日

**附：业绩比较基准调整原因及合理性说明**

**1、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债券指数收益率

调整后新业绩比较基准：中证 A500 指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10%

（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，本基金的股票资产主要投资于本基金界定的新经济主题相关股票，以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，根据个股的估值水平优选个股。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，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 A500 指数。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，反映各行业最具代表性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 50%调整为 90%，债券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。

**2、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合全价（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%

（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，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，配置能够提供稳定收益的债券资产。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，本基金债券资产的业绩比较基准要素由中债综合指数调整为中债-新综合全价（总值）指数。中债-新综合全价（总值）指数由在境内公开发行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资产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%，股票资产所对应的基准要素权重由 50%调整为 15%。

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、国泰金龙行业精选证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：75%×〖上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均〗+25%×〖上证国债指数〗

调整后新业绩比较基准：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）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，采取定量分析与定性分析相结合的方式，通过资产配置、行业精选与个股选择，构建股票投资组合。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上证 A 股指数和深圳 A 股指数的总市值加权平均调整为中证 800 指数。中证 800 指数由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，指数样本量大，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。

本基金的债券资产采用全市场策略，通过对利率走势和债券发行人基本面进行分析、宏观经济分析、相对价值分析等，构建债券资产组合。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上证国债指数调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。中债-综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），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股票资产所对应的基准要素权重由 75%调整为 80%，债券资产所对应的基准要素权重由 25%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。

**4、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中证综合债指数收益率×80%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+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：

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，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，配置能够提供稳定收益的债券资产。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，本基金债券资产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（总值）指数。中债-新综合财富（总值）指数由在境内公开发行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债券资产所对应的基准要素权重由 80%调整为 85%，股票资产所对应的基准要素权重由 20%调整为 15%（其中 A 股股票部分所对应的基准要素权重由 15%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。

**5、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中证综合债指数收益率×80%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+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：

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，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、可转换债券策略、可交换债券策略等多种投资策略，构建债券资产组合。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（总值）指数。中债-新综合财富（总值）指数由在境内公开发行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债券资产所对应的基准要素权重由 80%调整为 85%，股票资产所对应的基准要素权重由 20%调整为 15%（其中 A 股股票部分所对应的基准要素权重由 15%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。

**6、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%＋中债综合指数收益率×50%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*85%+中债-综合全价（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：

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 50%调整为 85%，债券资产所对应的基准要素权重由 50%调整为 15%。

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、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：申银万国制造业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：申银万国制造业指数收益率*85%+中证港股通工业综合指数（港元）收益率*5%+中债-综合全价（总值）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：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于大制造主题股票，结合对大制造主题中各公司财务指标的分析和各公司在所属行业当中的竞争地位、企业的盈利前景及成长空间等的分析研究，精选出未来发展前景较好的公司进行投资。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，并结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，新增中证港股通工业综合指数（港元）作为港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。中证港股通工业综合指数（港元）从中证港股通综合指数样本中，选取中证一级行业分类为“工业”的全部证券作为样本，反映港股通范围内工业行业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。

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 80%调整为 90%（其中 A 股股票部分所对应的基准要素权重由 80%调整为 85%，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 20%调整为 5%，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。

**8、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%＋中证综合债指数收益率×50%

调整后新业绩比较基准：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）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，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。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 股股票资产的业绩比较基准要素由沪深 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 只证券构成。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。

本基金的债券资产采用全市场策略，综合考虑收益性、流动性和风险性，进行积极投资。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，本基金债券资产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（1-3 年）指数。中债-综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），适合作为本基金债券资产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 50%调整为 80%，债券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。

**9、国泰大农业股票型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证大农业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

调整后新业绩比较基准：中证大农业指数收益率*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：

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 80%调整为 90%，债券资产所对应的基准要素权重由 20%调整为 5%，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、国泰民福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%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债指数收益率*25%

（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股票资产所对应的基准要素权重由 50%调整为 75%，债券资产所对应的基准要素权重由 50%调整为 25%。

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、国泰智能汽车股票型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证新能源汽车指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

调整后新业绩比较基准：中证新能源汽车指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*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股票资产所对应的基准要素权重由 80%调整为 90%，债券资产所对应的基准要素权重由 20%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。

**12、国泰智能装备股票型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

调整后新业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*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股票资产所对应的基准要素权重由 80%调整为 90%，债券资产所对应的基准要素权重由 20%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。

**13、国泰互联网+股票型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益

率×20%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*15%

（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股票资产所对应的基准要素权重由 80%调整为 85%，债券资产所对应的基准要素权重由 20%调整为 15%。

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。

**14、国泰聚鑫量化选股混合型发起式证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×75%+银行活期存款利率（税后）×20%+中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整）×5%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（港元）收益率*5%+中债-新综合全价（总值）指数收益率*15%+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-新综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-新综合全价（总值）指数由在境内公开发行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。

**15、国泰浓益灵活配置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）+2%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合全价（总值）指数收益率*55%+沪深 300 指数收益率*40%+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，本基金的债券资产采用全市场策略，通过久期策略、期限结构策略和个券选择策略等构建债券资产组合。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金选取中债-新综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-新综合全价（总值）指数由在境内公开发行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，以定性和定量分析为基础，选择估值合理、具有较高安全边际和盈利确定性的股票构建投资组合。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，本基金选取沪深 300 指数作为 A 股股票部分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 股股票部分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 55%，股票资产所对应的基准要素权重设置为 40%，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。

**16、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%＋中证综合债券指数收益率×50%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*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，在行业配置基础上，通过精选成长性明确、市场估值合理的优质上市公司，构建股票投资组合。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。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，适合作为本基金 A 股股票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 50%调整为 80%，债券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。

**17、国泰润利纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*95%+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，本基金的债券资产采用全市场策略，通过灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易策略等多种投资策略，构建债券资产组合。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。中债-新综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），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 100%调整为 95%，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。

**18、国泰可转债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%

调整后新业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*10%+中债-新综合财富（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：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券投资将根据对宏观经济形势和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析，综合运用多种策略构建资产组合。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金普通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。中债-新综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），适合作为本基金普通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，将业绩比较基准中可转换债券资产所对应的基准要素权重由 60%调整为 80%，普

通债券资产所对应的基准要素权重由 30%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。

**19、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+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，本基金的债券投资根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态地对债券投资组合进行调整。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-高信用等级债券财富（总值）指数。中债-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，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 100%调整为 95%，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。

**20、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+

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，本基金的债券资产通过灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易策略、资产支持证券投资策略等多种投资策略，构建资产组合。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-高信用等级债券财富（总值）指数。中债-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，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 100%调整为 95%，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。

**21、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+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，本基金的债券资产灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易策略、资产支持证券投资策略等多种投资策略，构建资产组合。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-高信用等级债券财富（总值）指数。中债

-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，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 100%调整为 95%，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。

**22、国泰合融纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+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，本基金的债券投资根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用多种投资策略，构建资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态地对投资组合进行调整。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-高信用等级债券财富（总值）指数。中债-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，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 100%调整为 95%，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。

**23、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*95%+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，本基金的债券投资基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，通过久期策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购交易策略、信用衍生品投资策略等多种投资策略，构建资产组合。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-高信用等级债券财富（总值）指数。中债-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，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 100%调整为 95%，同时新增 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。

**24、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*90%+沪深

300 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：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券投资将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用多种策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。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财富（总值）指数调整为中债-新综合财富（1-3 年）指数。中债-新综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金的股票资产采用全市场选股策略，将全面考察公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征等对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备投资价值的股票。结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金删除港股通标的股票所对应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 85%调整为 90%，股票资产所对应的基准要素权重由 15%调整为 5%（其中 A 股股票部分所对应的基准要素权重由 10%调整为 5%，删除 5%的港股通标的股票部分所对应的基准要素），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。

**25、国泰安璟债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5%

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率*85%+沪深

300 指数收益率*10%+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：

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，通过灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种投资策略、信用债投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合。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财富（总值）指数调整为中债-新综合财富（1-3 年）指数。中债-新综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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，本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素由恒生综合指数调整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，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。

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。

**26、国泰信瑞纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*80%+中债-国开行债券总财富（3-5 年）指数收益率*15%+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，本基金的债券投资基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，通过久期策略、收益率曲

线策略、类属配置策略、利率品种投资策略、信用债投资策略、国债期货投资策略、回购交易策略、信用衍生品投资策略等多种投资策略，构建资产组合。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-高信用等级债券财富（总值）指数和中债-国开行债券总财富（3-5 年）指数。中债-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，适合作为本基金信用债部分的业绩比较基准要素。中债-国开行债券总财富（3-5 年）指数由国家开发银行在境内公开发行的政策性金融债组成，成份券待偿期在 3-5 年（含 3 年），适合作为本基金利率债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 100%调整为 95%（其中信用债部分所对应的基准要素权重为 80%，利率债部分所对应的基准要素权重为 15%），同时新增 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。

**27、国泰金龙债券证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券财富（总值）指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*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：

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线策略等方法进行投资管理。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，本基金普通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-高信用等级债券财富（总值）指数。中债-高信用等级债券财富（总值）指数成份券包括在境内公开发行的符合一定评级标准的信用债，适合作为本基金普通债券部分的业绩比较基准要素。同时，结合基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，新增中证可转换债券指数作为可转债部分的业绩比较基准要素。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，反映可转换债券的总体表现，适合作为本基金可转债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 100%调整为 95%（其中普通债券部分所对应的基准要素权重由 100%调整为 85%，增加可转债部分所对应的基准要素权重为 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。

**28、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-新综合财富（1-3 年）指数收益率

（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，本基金的债券投资基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，通过久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种投资策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、回购交易策略、信用衍生品投资策略等多种投资策略，构建资产组合。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。中债-新综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行的主要债券品种组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），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。

**29、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金**

（1）当前业绩比较基准：（经估值日汇率调整后的）摩根大通亚洲债券中国总收益指数（JACI China Total Return Index）

调整后新业绩比较基准：摩根大通亚洲债券中国总收益指数（J.P. Morgan Asia Credit Index (JACI) China Total Return Index）收益率*50%+彭博离岸人民币债券指数（Bloomberg Offshore Renminbi (CNH) Index）收益率*45%+人民币活期存款基准利率*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，本基金的债券投资基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对各行业的动态跟踪，通过久期策略、收益率曲线策略、信用债策略等多种投资策略，构建债券资产组合。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，本基金新增彭博离岸人民币债券指数（Bloomberg Offshore Renminbi (CNH) Index）作为债券部分的业绩比较基准要素。彭博离岸人民币债券指数（Bloomberg Offshore Renminbi (CNH) Index）反映以离岸人民币计价的债券市场表现，涵盖固定利率国债、政府相关债券及公司债券等，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，人民币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100%调整为95%（其中摩根大通亚洲债券中国总收益指数（J.P. Morgan Asia Credit Index (JACI) China Total Return Index）所对应的基准要素权重由100%调整为50%，增加彭博离岸人民币债券指数（Bloomberg Offshore Renminbi (CNH) Index）所对应

的基准要素权重为 45%），同时新增 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。

**30、国泰行业轮动股票型基金中基金（FOF-LOF）**

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*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权益类资产所对应的基准要素权重由 80%调整为 90%，固定收益类资产所对应的基准要素权重由 20%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。