（上接 209 版）

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，本基金将信用债部分所对应的基准指数由中证信用债指数调整为中债－信用债总财富（总值）指数、选取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。中债－信用债总财富（总值）指数隶属于中债总指数族分类，该指数成份券由信用类债券组成，是一个反映境内信用类债券市场价格走势情况的宽基指数，适合作为本基金信用债部分的业绩比较基准要素。中证可转换债券指数的样本券由在沪深交易所上市的可转换债券组成，指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换债券的整体表现，适合作为本基金可转债部分的业绩比较基准要素。

（二）相关影响

上述调整符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》和《公开募集证券投资基金业绩比较基准操作细则》的要求，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。

二十一、国投瑞银恒源 30 天持有期债券型证券投资基金

当前业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%＋银行活期存款利率（税后）×10%

调整后的业绩比较基准为：中债－综合全价（总值）指数收益率×95%＋活期存款基准利率×5%

（一）调整原因及差异

此次本基金业绩比较基准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。

本基金的债券资产投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略和信用债投资策略。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，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）指数隶属于中债总指数族分类，由在境内债券市场公开发行的债券组成，主要包括国债、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，反映境内人民币债券市场整体表现，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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。

基于基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%、每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将债券资产所对应的基准要素权重从 90%提高至 95%，将现金类资产的基准要素权重从 10%调低至 5%，从而使得新业绩比较基准中各大资产类别所对应的基准要素权重与基金合同约定等相匹配。

（二）相关影响

上述调整符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》和《公开募集证券投资基金业绩比较基准操作细则》的要求，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。

二十三、国投瑞银顺熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金

当前业绩比较基准为：中债综合指数收益率

调整后的业绩比较基准为：中债－1–5 年债券综合全价（总值）指数收益率

（一）调整原因及差异

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准指数调整。

本基金的债券资产投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略和信用债投资策略。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，本基金将债券部分所对应的基准指数从中债综合全价（总值）指数调整为中债－1–5 年债券综合全价（总值）指数。中债－1–5 年债券综合全价（总值）指数隶属于中债总指数族分类，由在境内公开发行且上市流通、剩余期限在 1–5 年的国债、地方政府债、政策性银行债券、信用债等组成，反映境内人民币中等久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。

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。

基于基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%、每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将债券资产所对应的基准要素权重从 90%提高至 95%，将现金类资产的基准要素权重从 10%调低至 5%，从而使得新业绩比较基准中各大资产类别所对应的基准要素权重与基金合同约定等相匹配。

（二）相关影响

上述调整符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》和《公开募集证券投资基金业绩比较基准操作细则》的要求，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。

二十四、国投瑞银恒泽中短债债券型证券投资基金

当前业绩比较基准为：中债总财富（1–3 年）指数收益率×80%＋一年期定期存款利率（税后）×20%

调整后的业绩比较基准为：中债 –0–3 年债券综合财富（总值）指数收益率×95%＋活期存款基准利率×5%

（一）调整原因及差异

此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准指数、基准要素权重调整。

本基金的债券资产投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略，主要投资于中短期债券。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，本基金将债券部分所对应的基准指数从中债总财富（1–3 年）指数调整为中债 –0–3 年债券综合财富（总值）指数。中债 –0–3 年债券综合财富（总值）指数隶属于中债总指数族分类，由在境内公开发行且上市流通、剩余期限在 3 年以下的国债、地方政府债、政策性银行债券、信用债等组成，反映境内人民币中短久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。

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。

基于基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%、投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%、本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将债券资产所对应的基准要素权重从 80%提高至 95%，将现金类资产的基准要素权重从 20%调低至 5%，从而使得新业绩比较基准中各大资产类别所对应的基准要素权重与基金合同约定等相匹配。

（二）相关影响

上述调整符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》和《公开募集证券投资基金业绩比较基准操作细则》的要求，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。

二十五、国投瑞银恒誉 90 天持有期中短债债券型证券投资基金

当前业绩比较基准为：中债－综合财富（1–3 年）指数收益率×45%＋中债－综合财富（1 年以下）指数收益率×45%＋一年期定期存款利率（税后）×10%

调整后的业绩比较基准为：中债－综合财富（1–3 年）指数收益率×45%＋中债－综合财富（1 年以下）指数收益率×50%＋活期存款基准利率×5%

（一）调整原因及差异

此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准指数、基准要素权重调整。

本基金的债券资产投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略和信用债投资策略，主要投资于中短期债券。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－综合财富（1–3 年）指数、中债－综合财富（1 年以下）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债－综合财富（1–3 年）指数隶属于中债总指数族分类，由在境内债券市场公开发行的债券组成，主要包括国债、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，成份券待偿期在 1–3 年（含 1 年），反映境内人民币中短久期债券市场整体表现；中债－综合财富（1 年以下）指数隶属于中债总指数族分类，由在境内债券市场公开发行的债券组成，主要包括国债、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，中债－综合财富（1–3 年）指数及中债－综合财富（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。

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。

基于基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%、投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的 80%、每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将债券资产所对应的基准要素权重从 90%提高至 95%，并将其中中债－综合财富（1–3 年）指数及中债－综合财富（1 年以下）指数的权重分别设置为 45%及 50%，将现金类资产的基准要素权重从 10%调低至 5%，从而使得新业绩比较基准中各大资产类别所对应的基准要素权重与基金合同约定等相匹配。

（二）相关影响

上述调整符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》和《公开募集证券投资基金业绩比较基准操作细则》的要求，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。

二十六、国投瑞银聚福稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

当前业绩比较基准为：中债－综合全价（总值）指数收益率×80%＋中证 800 指数收益率×12.5%＋中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整后）×2.5%＋银行活期存款利率（税后）×5%

调整后的业绩比较基准为：中债－综合全价（总值）指数收益率×75%＋中证 800 指数收益率×20%＋活期存款基准利率×5%

（一）调整原因及差异

此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准指数、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。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过对被动型基金和主动型基金使用不同的筛选方法，选择优质固定收益类基金，同时本基金将根据需要适度进行债券投资，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。综合考虑基准指数与产品定位、投资策略的匹配度，以及基准指数的表征性、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）指数作为固定收益类资产的业绩比较基准要素。中债－综合全价（总值）指数隶属于中债总指数族分类，由在境内债券市场公开发行的债券组成，主要包括国债、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，反映境内人民币债券市场整体表现，适合作为本基金固定收益类资产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，本基金通过对被动型基金和主动型基金使用不同的筛选方法，选择优质权益类基金，同时，本基金的股票资产采用“自下而上”选股策略，辅以行业分析进行组合优化，选取中长期持续增长、未来阶段性高速增长或业绩质量优秀的股票作为投资对象。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、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取中证 800 指数作为权益类资产的业绩比较基准要素。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，适合作为本基金权益类资产的业绩比较基准要素。

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。

基于本基金历史权益类资产的仓位中枢，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，本基金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从 80%调低至 75%，将权益类资产所对应的基准要素权重从 15%提高至 20%，并删除港股通标的股票部分所对应的业绩比较基准要素，将现金类资产所对应的基准要素权重设置为 5%，从而使得业绩比较基准中各大资产类别所对应的基准要素权重与基金过往实际投资运作等相匹配。

（二）相关影响

上述调整符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》和《公开募集证券投资基金业绩比较基准操作细则》的要求，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。

（上接 210 版）

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

30.嘉实稳宁纯债债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：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%

调整后新业绩比较基准：中债 –0–3 年债券综合全价（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：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的债券资产的基准要素权重从 90%提高至 95%、流动性资产的基准要素权重从 10%降低至 5%；在基准指数的选取方面，债券部分从“中债综合全价(总值)指数”变更为“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、现金类资产等，相应选取与之匹配的债券指数、存款利率作为基准要素。同时基于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金将债券资产所对应的基准要素权重设置为 95%；并选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，将活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

31.嘉实汇利 120 天滚动持有纯债债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：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%

调整后新业绩比较基准：中债 –0–3 年债券综合全价（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：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的债券资产的基准要素权重从 90%提高至 95%、流动性资产的基准要素权重从 10%降低至 5%；在基准指数的选取方面，债券部分从“中债综合全价(总值)指数”变更为“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、现金类资产等，相应选取与之匹配的债券指数、存款利率作为基准要素。同时基于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金将债券资产所对应的基准要素权重设置为 95%；并选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，将活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

32.嘉实汇享 30 天持有期纯债债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：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%

调整后新业绩比较基准：中债 –0–3 年债券综合全价（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：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的债券资产的基准要素权重从 90%提高至 95%、流动性资产的基准要素权重从 10%降低至 5%；在基准指数的选取方面，债券部分从“中债综合全价(总值)指数”变更为“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、现金类资产等，相应选取与之匹配的债券指数、存款利率作为基准要素。同时基于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金将债券资产所对应的基准要素权重设置为 95%；并选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，将活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

33.嘉实稳恒 90 天持有期债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：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%

调整后新业绩比较基准：中债 –0–3 年债券综合全价（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：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的债券资产的基准要素权重从 90%提高至 95%、流动性资产的基准要素权重从 10%降低至 5%；在基准指数的选取方面，债券部分从“中债综合全价(总值)指数”变更为“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、现金类资产等，相应选取与之匹配的债券指数、存款利率作为基准要素。同时基于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金将债券资产所对应的基准要素权重设置为 95%；并选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，将活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

34.嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：一年期银行定期存款收益率(税后)+1%

调整后新业绩比较基准：中债 –1–5 年债券综合全价（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：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将债券资产的基准要素权重设置为 95%，流动性资产的基准要素权重设置为 5%；在基准指数的选取方面，将定期存款利率变更为债券指数加活期存款基准利率作为基准要素，其中债券部分选取“中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数”，流动性管理部分选取“活期存款基准利率”，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、现金类资产等，相应选取与之匹配的债券指数、存款利率作为基准要素。同时基于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金将债券资产所对应的基准要素权重设置为 95%；并选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，将活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –0–3 年债券综合全价（总值）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本基金选取“活期存款基准利率”作为流动性管理部分的基准要素。活期存款基准利率由中国人民银行公布，如果活期存款基准利率发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

35.嘉实纯债债券型发起式证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：中国债券总指数

调整后新业绩比较基准：中债 –1–5 年债券综合财富（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：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的债券资产的基准要素权重从 0%提高至 95%，将现金类资产的基准要素权重从 100%降低至 5%；在基准指数的选取方面，债券部分从“中国债券总指数”变更为“中债 –1–5 年债券综合财富（总值）指数”，同时增加“活期存款基准利率”作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、现金类资产等，相应选取与之匹配的债券指数、存款利率作为基准要素。同时基于本基金投资等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，本基金将债券资产所对应的基准要素权重设置为 95%；并选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，将活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –1–5 年债券综合财富（总值）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

36.嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率 +0.5%

调整后新业绩比较基准：中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数收益率 *95%+ 中证转换债券指数收益率 *5%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将信用债及利率债部分的基准要素权重设置为 95%，可转换债券部分的基准要素权重设置为 5%；在基准指数的选取方面，将定期存款利率变更为债券指数作为基准要素，信用债及利率债部分选取“中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数”，可转换债券部分选取“中证可转换债券指数”，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券（含可转换债券）等资产，相应选取与之匹配的债券指数、可转换债券指数作为基准要素。同时基于除每次开放期开始前三个月、开放期及开放期结束后三个月以外的期间，本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金将信用债及利率债部分、可转换债券部分所对应的基准要素权重分别设置为 95%与 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。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，选取“中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数”作为信用债及利率债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，本基金适度投资于可转换债券，将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。综合考虑基准指数与产品定位和投资策略的匹配度，同时兼顾基准指数的表征性、认可度，以及样本覆盖、收益特征等，本基金选取“中证可转换债券指数”作为可转换债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

37.嘉实稳盛债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：中债总全价指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债 – 综合全价（1–3 年）指数收益率×90%+ 沪深 300 指数收益率×10%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

业绩比较基准的调整涉及基准要素和要素权重：基准要素方面，本基金为混合债券型二级基金，现有的业绩比较基准未体现股票相关基准要素及权重，将债券部分由“中债总全价指数”变更为“中债 – 综合全价（1–3 年）指数”，并新增股票部分基准要素“沪深 300 指数”；要素权重方面，同时基于本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%等限制，将债券部分的基准要素权重设置为 90%、股票部分的基准要素权重设置为 10%，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过久期水平、期限结构和类属配置进行投资管理。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，选取“中债 – 综合全价（1–3 年）指数”作为债券部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

38.嘉实稳宏债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：中债总全价指数收益率×90%+ 沪深 300 指数收益率×10%

调整后新业绩比较基准：中债 – 总全价（总值）指数收益率×40%+ 中证可转换债券指数收益率×40%+ 沪深 300 指数收益率×20%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

业绩比较基准的调整涉及基准要素和要素权重：基准要素方面，将债券部分新增“中证可转换债券指数”作为可转换债券部分的基准要素；要素权重方面，基于本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%等限制，本基金将债券资产与股票资产所对应的基准要素权重分别设置为 80%与 20%。债券资产中可转换债券以外的债券、可转换债券部分的业绩比较基准要素权重分别设置为 40%与 40%，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过久期水平、期限结构和类属配置进行投资管理。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，选取“中债 – 总全价（总值）指数”和“中证可转换债券指数”分别作为可转换债券以外的债券、可转换债券部分的业绩比较基准要素。

本基金的股票资产将在全市场范围内进行选择与配置，运用嘉实研究平台，配置行业和个股，优化组合，精选流动性高、安全边际高、具有上涨潜力的个股，力求增强组合的当期收益。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、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取“沪深 300 指数”作为股票部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

39.嘉实稳怡债券型证券投资基金

（1）调整前业绩比较基准：中债总全价指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数收益率×85%+ 中证 800 指数收益率×15%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的债券部分的基准要素权重从 100%降低至 85%、股票部分的基准要素权重从 0%增加至 15%；在基准指数的选取方面，债券部分从“中债总全价指数”变更为“中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数”，同时增加“中证 800 指数”作为股票部分的业绩比较基准要素，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券、股票等资产，相应选取与之匹配的债券指数、股票指数作为基准要素。同时基于本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%等限制，本基金将债券资产与股票资产所对应的基准要素权重分别设置为 85%与 15%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产将在全市场范围内进行选择与配置，主要通过久期水平、期限结构和类属配置进行投资管理。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，选取“中债 –1–5 年债券综合全价（总值）指数”作为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，本基金的股票资产将在全市场范围内进行选择与配置，运用公司研究平台，配置行业和个股，优化组合，精选流动性高、安全边际高、具有上涨潜力的个股。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、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取“中证 800 指数”作为股票部分的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

40.嘉实领航资产配置混合型基金中基金（FOF）

（1）调整前业绩比较基准：中证 800 股票指数收益率 *20%+ 中债综合财富指数收益率 *70%+Wind 商品综合指数收益率 *10%

调整后新业绩比较基准：中债 – 综合财富（总值）指数收益率 *70%+ 中证 800 指数收益率 *20%+MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）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%

（2）新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

业绩比较基准的调整涉及要素权重和基准要素：要素权重方面，将基准中的商品类资产的基准要素权重从 10%降低至 5%、境外权益类资产的基准要素权重从 0%提高至 5%，固定收益类资产和境内权益类资产的权重维持不变；在基准指数的选取方面，商品类资产从“Wind 商品综合指数”变更为“上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格”，同时增加“MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）”作为境外权益类资产的业绩比较基准要素，以使新业绩比较基准更能贴合产品的实际投资风格及运作情况。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金可以投资于固定收益类基金、债券等固定收益类资产；境内权益类基金、股票等境内权益类资产；QDII 基金等境外权益类资产；商品期货基金等商品类资产，相应选取与之匹配的债券指数、A 股指数和境外权益指数、商品价格作为基准要素。同时基于本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金份额的比例不少于基金资产的 80%，投资于股票型基金的比例不高于基金资产净值的 30%等投资比例限制，本基金将固定收益类资产、权益类资产、商品类资产所对应的基准要素权重分别设置为 70%、25%和 5%，其中将权益类资产中的境内权益类资产与境外权益类资产所对应的基准要素权重分别设置为 20%与 5%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金以风险为核心进行分散化资产配置，通过风险模型定量调整各类资产比例，审慎甄选基金，综合利用市场结构、投资者行为、资产风险收益特征等研究成果优化基金组合。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，本基金分别选取“中债 – 综合财富（总值）指数”、“中证 800 指数”、“MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）”和“上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格”作为固定收益类资产、境内权益类资产、境外权益类资产和商品类资产的业绩比较基准要素。

本次调整后的新基准更符合基金所投资的主要资产类别及过往实际投资运作情况，与实际产品定位、投资风格更为契合，不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二六年七月主要运营数据的公告

一、公募 REITs 基本信息

公募 REITs 名称	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金
公募 REITs 简称	中金安徽交控 REIT
公募 REITs 代码	508009
公募 REITs 合同生效日	2022年 11 月 11 日
基金管理人名称	中金基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》、《上海证券交易所公开募集不动产投资信托基金(REITs)业务办法(试行)》、《上海证券交易所公开募集不动产投资信托基金（REITs）规则适用指引第 5 号——临时报告（试行）》、《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》、《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》及其更新

二、2026 年 7 月主要运营数据

2026 年以来，不动产项目公司整体运营情况良好，本高速公路通行费收入来源分散，无重要现金流提供方，运营管理机构未发生变动。

沿江高速 7 月主要运营数据如下：

项目	日均路段流量（辆次）				路段收入（人民币，亿元，金额为整）			
	实际	同比上年同期变动	2026年预期目标	目标达成率	实际	同比上年同期变动	2026年预期目标	目标达成率
沿江高速	30,160	-8.36%	31,175	96.74%	2.09	-9.21%	2.34	89.35%

注：①日均自然车流量计算方法：当月断面自然车流量（含免费车流量）/ 当月自然天数；根据安徽省高速公路联网运营有限公司（简称“联网公司”）统计口径，免费车流量包含：非法定节假日免费期间，在收费站正常交易下道收费额为 0 的车辆；法定节假日免费期间，使用 ETC 通行车辆上道下道均在收费站 ETC 道口，且收费额为 0 的车辆。

②以上为联网公司当期清分数据，未经审计，所有中间及最终结果都采用四舍五入方式计算，因此最终结果与清分数据可能有细微差异。该数据不包括联网公司对以前月度清分数据的调整部分，因此各月加总与定期报告披露数据可能存在细微差异，以定期报告披露为准。

本月日均收费车流量为 20,359 辆次，同比下降 8.36%（其中客车下降 9.28%、货车下降 6.10%）、环比上升 4.51%（其中客车上升 7.49%、货车下降 1.91%）。车流量同比下降的主要原因为：（1）受厄尔尼诺天气影响，台风、暴雨等恶劣天气较去年明显增加；（2）竞争性道路宁九高速（指 G4231 南京至九江高速公路（原 S22 天长至天柱山高速公路，北沿江高速）无为至安庆段，于 2025 年 12 月 26 日正式通车运营。）的分流影响。

根据运营管理机构反馈，运营管理机构于 2026 年 8 月组织对沿江高速部分路段实施分阶段封闭养护施工。为最大限度降低封闭施工对路段通行费收入的影响，运营管理机构在交通主管部门的统筹安排下，采取了如下应对措施：

（1）针对桥梁、隧道等特殊路段养护施工，为保障群众出行和施工作业安全，提升养护作业质量与施工效率，运营管理机构联合交警、路政“一路三方”，经多轮评审研判，决定采取集约化养护方案，对沿江高速部分路段实施分阶段封闭施工：2026 年 8 月 3 日至 8 月 7 日对 G4211 宁芜高速繁昌东枢纽至峨山路收费站（约 22.22 公里）下行（铜陵