

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 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。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	摩根中国优势证券投资基金	沪深 300 指数收益率*70%+ 中债总指数收益率*30%	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	摩根成长先锋混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*80%+ 中债总指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*85%+中 债-总全价（总值）指数收益率 *15%
3	摩根双核平衡混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*50%+ 上证国债指数收益率*50%	沪深 300 指数收益率*60%+中 债-总财富（总值）指数收益率 *40%
4	摩根中小盘混合型证券投资基金	中证 700 指数收益率*80%+ 银行活期存款利率(税 后)*20%	中证 700 指数收益率*85%+中 债-国债总全价（1-3 年）指数 收益率*15%
5	摩根强化回报债券型证券投资基金	中证综合债券指数	中债-综合财富（1-3 年）指数 收益率*90%+沪深 300 指数收 益率*10%
6	摩根健康品质生活混合型证券投资基金	中证内地消费指数收益率 *65%+中证港股通大消费主 题指数收益率*15%+银行活	中证内地消费主题指数收益率 *60%+中证港股通大消费主题 指数（人民币）收益率*20%+

		期存款利率(税后)*20%	中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*20%
7	摩根智选 30 混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*80%+ 上证国债指数收益率*20%	中证 800 成长指数收益率 *85%+上证国债指数收益率 *15%
8	摩根成长动力混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*80%+ 中债总指数收益率*20%	中证 800 成长指数收益率 *85%+中债-总全价（总值）指数收益率*15%
9	摩根双债增利债券型证券投资基金	中证综合债券指数	中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*65%+中证 800 指数收益率*10%+中证可转换债券指数收益率*25%
10	摩根卓越制造股票型证券投资基金	申万制造业指数收益率 *85%+上证国债指数收益率 *15%	中证高端装备制造指数收益率 *85%+上证国债指数收益率 *15%
11	摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金	中证 1000 指数收益率 *90%+银行活期存款利率 (税后)*10%	中证 1000 指数收益率*90%+中 债-国债总全价（1-3 年）指数 收益率*10%
12	摩根智慧互联股票型证券投资基金	中证 TMT 产业主题指数收 益率*85%+银行活期存款利 率(税后)*15%	中证 TMT 产业主题指数收益率 *85%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*15%
13	摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)	中证中国内地企业 500 指数 收益率*60%+中债总指数收 益率*40%	中证 800 指数收益率*50%+中 证港股通综合指数（人民币） 收益率*35%+中债-总全价（总 值）指数收益率*15%
14	摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)	MSCI 全球指数(MSCI ACWI)*80%+摩根大通全球 债券指数(J.P. Morgan Global Aggregate Bond Index)*20%	MSCI 全球指数(MSCI All Countries World Index)*60%+摩 根大通全球债券指数(J.P. Morgan Global Aggregate Bond

			Index)*40%
15	摩根安通回报混合型证券投资基金	中证综合债券指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%	中证综合债指数收益率*70%+中证 800 指数收益率*20%+中证可转换债券指数收益率*10%
16	摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%	中证 500 指数收益率*95%+中债-国债总全价(1-3 年)指数收益率*5%
17	摩根安隆回报混合型证券投资基金	中证综合债券指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%	中债-综合财富(1-3 年)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%
18	摩根领先优选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*40%+中证港股通综合指数收益率*30%+中债总指数收益率*30%	中证 800 成长指数收益率*65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+中债-总全价(总值)指数收益率*15%
19	摩根瑞益纯债债券型证券投资基金	中证综合债券指数收益率	中债-综合财富(1-3 年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
20	摩根优势成长混合型证券投资基金	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(税后)*15%	中证 800 成长指数收益率*65%+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*15%
21	摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金	中债综合财富(1 年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款基准利率(税后)*20%	中债-综合财富(1 年以下)指数收益率*85%+一年期定期存款基准利率*15%
22	摩根慧享成长混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数收益率*20%+上证国债指数收益率	中证 800 成长指数收益率*65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+上证

		*15%	国债指数收益率*15%
23	摩根均衡精选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*60%+ 中证港股通综合指数收益率 *20%+银行活期存款利率 (税后)*20%	沪深 300 指数收益率*60%+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*20%
24	摩根汇智优选混合型证券投资基金	中证 A500 指数收益率 *90%+银行活期存款利率 (税后)*10%	中证 A500 指数收益率*90%+中 债-国债总全价（1-3 年）指数 收益率*10%
25	摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	中证纯债债券型基金指数收 益率*70%+中证红利指数收 益率*8.5%+MSCI 世界指数 (MSCI WORLD INDEX)收 益率(使用估值汇率折 算)*8.5%+活期存款基准利 率(税后)*5%+中证港股通高 股息投资指数(人民币)收益 率*4%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约收益 率*4%	中债-新综合财富（总值）指数 收益率*75%+中证 A500 指数收 益率*9%+MSCI 发达市场指数 （MSCI World Index）收益率 *8%+恒生指数收益率*4%+上海 黄金交易所 AU99.99 现货实盘 合约价格收益率*4%

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.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21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

客服电话：400-889-4888

公司网址：am.jpmorgan.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

一、摩根中国优势证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：沪深 300 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 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：基于本基金的过往持仓情况，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所对应的基准要素权重从 70%提高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重降低至 15%。

（2）更换业绩比较基准要素：基于基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金精心选择在经济全球化趋势下具有国际比较优势的中国企业，通过精选证券和适度主动投资，最终谋求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、风格特征、行业与个股分布等，将 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 成长指数。中证 800 成长指数以中证 800 指数为样本空间，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。

二、摩根成长先锋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 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：基于本基金的过往持仓情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重降低至 15%。

（2）更换业绩比较基准要素：基于基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于国内市场上展现最佳成长特质的股票，积极捕捉高成长性上市公司所带来的投资机会，努力实现基金资产长期稳健增值。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、风格特征、行业与个股分布等，将 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 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，反映沪深市场大中盘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。

三、摩根双核平衡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*50%+上证国债指数收益率*50%

调整后业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*60%+中债-总财富（总值）指数收益率*40%

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 50%提升至 60%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 50%调整至 40%。

（2）更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，债券部分的指数由上证国债指数调整为中债-总财富（总值）指数。中债-总财富（总值）指数由在境内公开发行且上市流通的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，反映境内利率类债券市场整体表现，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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、摩根中小盘混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：中证 700 指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%

调整后业绩比较基准：中证 700 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：基于本基金的过往持仓情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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、摩根强化回报债券型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：中证综合债券指数

调整后业绩比较基准：中债-综合财富(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：

（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设置为 10%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 100%降低到 90%。

（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沪深 300 指数作为股票资产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，综合反映沪深市场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。

（3）更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，债券部分的指数由中证综合债券指数调整为中债-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。

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、摩根健康品质生活混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准： $\text{中证内地消费指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通大消费主题指数收益率} \times 15\% + \text{银行活期存款利率(税后)} \times 20\%$

调整后业绩比较基准： $\text{中证内地消费主题指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通大消费主题指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率} \times 20\%$

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%降低到 60%，将业绩比较基准中的港股通股票资产的基准要素权重从 15%提升到 20%，增设债券指数要素并将权重设置为 20%，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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，该指数成分券由在境内公开发行人且上市流通、待偿期在 1-3 年（含 1 年）的记账式国债组成，反映境内中短久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。

七、摩根智选 30 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%+上证国债指数收益率*20%

调整后业绩比较基准：中证 800 成长指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

（1）调整业绩比较基准的要素权重：基于本基金的过往持仓情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 85%，并将债券资产所对应的基准要素权重降低至 15%。

（2）更换业绩比较基准要素：基于基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于受益于国家经济转型，具有较高增长潜力的上市公司股票，在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。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、风格特征、行业与个股分布等，将 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 成长指数。中证 800 成长指数以中证 800 指数为样本空间，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、摩根成长动力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 A 股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，本基金的股票资产将采取自下而上的精选个股策略，以深入的基本面研究为基础，精选具有良好成长性的优质上市公司股票，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 成长指数从中证 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。

九、摩根双债增利债券型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：中证综合债券指数

调整后业绩比较基准：中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*65%+中证 800 指数收益率*10%+中证可转换债券指数收益率*25%。

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设置为 10%，将基准中的可转换债券资产的基准要素权重设置为 25%，将基准中的普

通债券资产的基准要素权重从 100%降低到 65%。

(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 800 指数和中证可转换债券指数，分别作为股票资产和可转债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。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。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，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换债券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，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，债券部分的指数由中证综合债券指数调整为中债-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久期债券市场整体表现，适合作为本基金普通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、摩根卓越制造股票型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：申万制造业指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%

调整后业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，本基金将通过系统和深入的基本面研究，重点投资于制造业中具有竞争力的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产长期稳定增值。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，股票部分的指数由申万制造业指数调整为中证高端装备制造指数。中证高端装备制造指数从上市公司中，选取通信设备、电力设备、机械制造、航空航天与国防、电子、半导体、乘用车及零部件等行业中具有代表性的公司作为样本，以反映高端装备制造产业公司的整体表现，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。

十一、摩根动态多因子策略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 1000 指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%

调整后业绩比较基准：中证 1000 指数收益率*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：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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。

十二、摩根智慧互联股票型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：中证 TMT 产业主题指数收益率*85%+银行活期存款利率(税后)*15%

调整后业绩比较基准：中证 TMT 产业主题指数收益率*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：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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。

十三、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)

1、调整前业绩比较基准：中证中国内地企业 500 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 指数收益率*50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*35%+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，将业绩比较基准中股票资产的基准要素权重从 60%提高至 85%，其中将 A 股股票与港股股票所对应的基准要素权重分别设置为 50%与 35%，同时将债券资产的基准要素权重从 40%降低至 15%。

（2）更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，本基金的股票资产主要投向本基金所定义的中国企业股票，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，将原来股票部分的指数由中证中国内地企业 500 指数调整为中证 800 指数和中证港股通指数（人民币），分别作为 A 股和港股股票部分的基准要素。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。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。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，以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、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)

1、调整前业绩比较基准：MSCI 全球指数(MSCI ACWI)*80%+摩根大通全球债券指数(J.P. Morgan Global Aggregate Bond Index)*20%

调整后业绩比较基准：MSCI 全球指数(MSCI All Countries World Index)*60%+摩根大通全球债券指数(J.P.Morgan Global Aggregate Bond Index)*40%

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，将业绩比较基准中股票资产的基准要素权重从 80%下降至 60%，将债券资产的基准要素权重从 20%提升至 40%。

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、摩根安通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*85%+沪深 300 指数收益率*15%

调整后业绩比较基准：中证综合债指数收益率*70%+中证 800 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：

(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 15%提升至 20%，将基准中的可转换债券资产的基准要素权重设置为 10%，将基准中的普通债券资产的基准要素权重从 85%降低到 70%。

(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可转换债券指数作为可转债资产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，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换债券部分的业绩比较基准要素。

(3) 更换业绩比较基准要素：本基金将采用自下而上的分析方法，根据上市公司财务分析、盈利预期、治理结构等因素，结合股票的价值评估，以及对公司经营有实质性影响的事件，精选个股，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，股票部分的指数由沪深 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，反映沪深市场大中盘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。

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。

十六、摩根量化多因子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 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

调整后业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率*5%

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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。

十七、摩根安隆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*80%+沪深 300 指数收益率*20%

调整后业绩比较基准：中债-综合财富(1-3 年)指数收益率*80%+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：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，债券部分的指数由中证综合债券指数调整为中债-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。

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。

十八、摩根领先优选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*40%+中证港股通综合指数收益率*30%+中债总指数收益率*30%

调整后业绩比较基准：中证 800 成长指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+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 A 股股票资产的基准要素权重从 40%提升到 65%，将业绩比较基准中的港股股票资产的基准要素权重从 30%降低到 20%，将基准中的债券资产的基准要素权重由 30%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，本基金的 A 股股票资产将通过对精选行业的发展进行密切跟踪以及自下而上的个股精选策略，挖掘具有较强竞争力和持续成长能力的 A 股上市公司。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 成长指数从中证 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。

十九、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：中证综合债券指数收益率

调整后业绩比较基准：中债-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：

（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，将基准中的银行存款的基准要素权重设置为 5%，将业绩比较基准中的债券资产的基准要素权重从 100%降低至 95%。

（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活期存款基准利率，作为现金类资产的业绩比较基准要素。活期存款基准利率是指中国人民银行公布的活期存款基准利率，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。

（3）更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，债券部分的指数由中证综合债券指数调整为中债-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且上市流通、待偿期在 1-3 年（含 1 年）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。

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。

二十、摩根优势成长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(税后)*15%

调整后业绩比较基准： $\text{中证 800 成长指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{中债-国债总全价（1-3 年）指数收益率} \times 15\%$

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，本基金通过定性分析和定量分析相结合的方法，聚焦中观行业景气度与自下而上精选个股相结合，精选高景气度行业优质龙头。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，A 股部分的指数由中证 800 相对成长指数调整为中证 800 成长指数。中证 800 成长指数以中证 800 指数为样本空间，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。

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）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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。

二十一、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准： $\text{中债综合财富(1 年以下)指数收益率} \times 80\% + \text{一年期定期存款基准利率(税后)} \times 20\%$

调整后业绩比较基准： $\text{中债-综合财富（1 年以下）指数收益率} \times 85\% + \text{一年期定期存款基准利率} \times 15\%$

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债券资产的基准要素权重从 80%提升至 85%，将基准中的流动性管理部分所对应的基准要素权重从 20%降低至 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。

二十二、摩根慧享成长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*65%+中证港股通综合指数收益率*20%+上证国债指数收益率*15%

调整后业绩比较基准：中证 800 成长指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+上证国债指数收益率*15%。

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

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采用定量及定性研究方法，通过自上而下行业配置与自下而上精选个股相结合，基于严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。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，A 股部分的指数由中证 800 指数调整为中证 800 成长指数。中证 800 成长指数以中证 800 指数为样本空间，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。

二十三、摩根均衡精选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*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+银行活期存款利率(税后)*20%

调整后业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*60%+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*20%。

2、新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全

价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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。

二十四、摩根汇智优选混合型证券投资基金

1、调整前业绩比较基准：中证 A500 指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%

调整后业绩比较基准：中证 A500 指数收益率*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：

更换业绩比较基准要素：在基准要素的选取方面，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，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，同时删除存款利率要素。中债-国债总全价（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数族，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，反映境内中短久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。

二十五、摩根聚利稳健三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

1、调整前业绩比较基准：中证纯债债券型基金指数收益率*70%+中证红利指数收益率*8.5%+MSCI 世界指数(MSCI WORLD INDEX)收益率(使用估值汇率折算)*8.5%+活期存款基准利率(税后)*5%+中证港股通高股息投资指数(人民币)收益率*4%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约收益率*4%

调整后业绩比较基准：中债-新综合财富（总值）指数收益率*75%+中证 A500 指数收益率*9%+MSCI 发达市场指数（MSCI World Index）收益率*8%+恒生指数收益率*4%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约价格收益率*4%

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，将业绩比较基准中债券资产的基准要素权重从 70%提升至 75%，将 A 股资产的基准要素权重从 8.5%提升至 9%，将境外股票资产的基准要素权重从 8.5%下降至 8%。

（2）更换业绩比较基准要素：

在基准要素的选取方面，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，债券部分的指数由中证纯债债券型基金指数调整为中债-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，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、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，A 股部分的指数由中证红利指数调整为中证 A500 指数，港股部分的指数由中证港股通高股息投资指数(人民币)调整为恒生指数。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，以反映各行业最具代表性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。恒生指数包括市值最大及成交最活跃并在香港联合交易所主板上市的公司，长期以来被广泛引用为反映香港股票市场整体表现的指标，适合作为本基金港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。