

关于调整上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资 基金业绩比较基准并修改基金合同的公告

上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本公司”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及《上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，为进一步优化公司旗下基金业绩比较基准，经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2022 年 9 月 9 日起调整上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的业绩比较基准，并相应修改本基金的基金合同等法律文件。现将上述变更事项公告如下：

一、本次修改的基本情况

将本基金业绩比较基准“中证 800 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%”调整为“中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

本基金目前的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。为进一步优化公司旗下基金业绩比较基准的管理，更好地表征基金投资运作情况及风险收益特征，本基金的业绩比较基准将调整为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%（以下简称“新基准”）。本基金与新基准的相关系数和拟合优度均较高，且变更后的股票指数权重可更好地体现本基金的资产配置特点。

二、基金合同相应条款的修订

基金合同“第十二部分 基金的投资”中“五、业绩比较基准”

原表述为：

“中证 800 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%

中证 800 指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股共同构成，较好的反映了市场上不同规模特征股票的整体表现，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围

和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

.....”

修改为：

“中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

中证 500 指数由中证指数有限公司编制，综合反映了沪深市场中小市值公司的整体状况，适合作为本基金股票投资的比较基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

.....”

三、重要提示

1、根据本基金基金合同的约定，如果“市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的复合指数权重比例，本基金将根据实际情况在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准予以调整”。本公司已与基金托管人就上述修改达成一致，上述修改不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。

2、对于本次基金合同的修改内容，本基金的招募说明书及基金产品资料概要对应内容也随之相应修改。具体修改内容请见登载于本公司网站(www.cifm.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)的更新后的基金合同、招募说明书及基金产品资料概要。

3、本次修订自 2022 年 9 月 9 日起生效。

4、投资者可拨打客户服务电话(400-889-4888)或登录本公司网站(www.cifm.com)咨询相关信息。

风险提示：

本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现，基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的基金合同、招募说明书、产品资料概要等相关

法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告

上投摩根基金管理有限公司

2022年9月9日