

东方基金管理股份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，东方基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自2026年7月27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	东方龙混合型开放式证券投资基金	标普中国 A 股 300 成长指数×30%+标普中国 A 股 300 价值指数×45%+中证综合债指数×25%	中证 800 指数收益率×85%+中证综合债指数收益率×15%
2	东方策略成长混合型开放式证券投资基金	标普中国 A 股 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%	中证 800 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
3	东方创新科技混合型证券投资基金	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总全价指数收益率	中证科技 100 指数收益率×85%+中债-总全价(总值)指数收益率×15%
4	东方城镇消费主题混合型证券投资基金	中证城镇消费指数收益率×80%+银行活期存款利率×20%	中证城镇消费指数收益率×85%+中债-总全价(总值)指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
5	东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%	沪深 300 指数收益率×85%+中债-总全价(总值)指数收益率×15%

	金		
6	东方高端制造混合型证券投资基金	中证高端制造主题指数收益率×70%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×10%+中债综合全价指数收益率×20%	中证高端制造主题指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
7	东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×10%+中债综合全价指数收益率×30%	中证800指数收益率×65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×25%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
8	东方兴润债券型证券投资基金	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%	中债-综合全价(总值)指数收益率×80%+中证可转换债券指数收益率×10%+沪深300指数收益率×5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
9	东方享悦90天滚动持有债券型证券投资基金	中债综合全价(总值)指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%	中债-综合全价(总值)指数收益率

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.orient-fund.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（更新）、基金产品资料概要（更新）、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 7 月 27 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：400-628-5888

公司网址：www.orient-fund.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。

东方基金管理股份有限公司

2026 年 6 月 26 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、东方龙混合型开放式证券投资基金

(1) **当前业绩比较基准：**标普中国 A 股 300 成长指数×30%+标普中国 A 股 300 价值指数×45%+中证综合债指数×25%

调整后新业绩比较基准：中证 800 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：

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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产重点投资对象为经过严格筛选的优势行业中的龙头企业，通过定量模型和定性分析的结合，筛选出具有投资价值的个股，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。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，本基金的股票资产所对应的基准指数从标普中国 A 股 300 成长指数和标普中国 A 股 300 价值指数调整为中证 800 指数。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 75%提高至 85%，同时将债券资产所对应的基准要素权重从 25%降低至 15%，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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，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；较原基准要素市场表征性更强、认可度更高。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

2、东方策略成长混合型开放式证券投资基金

(1) **当前业绩比较基准：**标普中国 A 股 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%

调整后新业绩比较基准：中证 800 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：

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。

基于本基金的投资目标、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，通过分析宏观经济发展战略，确定基金重点投资的行业，在风险控制的框架之下进行积极主动的投资管理，自上而下配置资产，自下而上精选证券，从而追求管理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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金的股票资产所对应的基准指数从标普中国 A 股 300 指数调整为中证 800 指数。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，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 75%，同时将债券资产所对应的基准要素权重从 30%降低至 25%，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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，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；较原基准要素市场表征性更强、认可度更高。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

3、东方创新科技混合型证券投资基金

(1) **当前业绩比较基准：**60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总全价指数收益率

调整后新业绩比较基准：中证科技 100 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：

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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向与“创新科技”概念相关的行业，结合自上而下和自下而上的分析，在大类资产配置基础上精选个股，从而在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。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，本基金的股票资产所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证科技 100 指数。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 60%提高至 85%，同时将债券资产所对应的基准要素权重从 40%降低至 15%，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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，中证科技 100 指数选取研发强度较高、盈利能力较强且兼具成长特征的科技龙头上市公司证券作为样本，反映 A 股范围内科技龙头上市公司证券的整体表现，与本基金主题界定更契合。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

4、 东方城镇消费主题混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中证城镇消费指数收益率×80%+银行活期存款利率×20%

调整后新业绩比较基准：中证城镇消费指数收益率×85%+中债-总全价（总值）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：

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。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产采用全市场策略，运用类属资产配置策略、久期调整策略、期限结构策略等多种积极管理策略，优选具有投资价值的个券。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，本基金新增中债-总全价（总值）指数作为债券资产所对应的基准指数。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，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设置为 10%，同时将现金类资产所对应的基准要素权重从 20%降低至 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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，中债-总全价（总值）指数隶属于中债总指数族，该指数成份券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，是一个反映境内利率类债券整体价格走势情况的分类指数，与本基金实际持券风格匹配。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

5、东方支柱产业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×60%+中债总全价指数收益率×40%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 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：

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重调整，不涉及具体基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和

产品定位，将业绩比较基准中的股票资产所对应的基准要素权重从 60%提高至 85%，同时将债券资产所对应的基准要素权重从 40%降低至 15%，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过往实际投资运作等相匹配。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

6、东方高端制造混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证高端制造主题指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%+中债综合全价指数收益率×20%

调整后新业绩比较基准：中证高端制造主题指数收益率×80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中债-综合全价（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：

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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的港股投资策略是通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。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，本基金的港股通标的股票资产所对应的基准指数从恒生指数调整为中证港股通综合指数（人民币）。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，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 90%，其中股票资产中的 A 股股票与港股通标的股票所对应的基准要素权重分别调整为 80%与 10%；同时将债券资产所对应的基准要素权重从 20%降低至 10%，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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，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，与本基金实际投资更匹配。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往

的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

7、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%+中债综合全价指数收益率×30%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中债-综合全价（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：

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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的港股投资策略是通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。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，本基金的港股通标的股票资产所对应的基准指数从恒生指数调整为中证港股通综合指数（人民币）。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，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 90%，其中股票资产中的 A 股股票与港股通标的股票所对应的基准要素权重分别调整为 65%与 25%；同时将债券资产所对应的基准要素权重从 30%降低至 10%，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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，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，与本基金实际投资更匹配。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

8、东方兴润债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+中证可转换债券指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×5%+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：

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。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金可在综合分析可转债的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用 BS 公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的可转债品种进行投资。并结合本基金的具体投资比例限制“投资于可转换债券、分离交易的可转换债券及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%”，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，本基金新增中证可转换债券指数作为可转换债券资产所对应的基准指数。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的港股投资策略是通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。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，本基金的港股通标的股票资产所对应的基准指数从恒生指数调整为中证港股通综合指数（人民币）。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重 90%中利率债和信用债部分从 90%降低至 80%，将可转换债券部分设置为 10%；同时，将股票资产所对应的基准要素权重 10%中 A 股股票与港股通标的股票分别设置为 5%与 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过往实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中，中证可转换债券指数的样本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，契合本基金投资比

例约定、贴合本基金实际债券投资；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，与本基金实际投资更匹配。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。

9、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中债综合全价(总值)指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响：

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重调整，不涉及具体基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金过往资产配置仓位情况，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的债券资产所对应的基准要素权重从 80%提高至 100%，删除现金类资产所对应的基准要素权重，从而使得新业绩比较基准中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。调整后的业绩比较基准能够更真实、准确地表征本基金过往的实际投资运作情况及风险收益特征。

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。