

东海基金管理有限责任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，东海基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）决定自 2026 年 9 月 22 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	东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金	中债总指数(全价)收益率	中债综合全价(总值)指数收益率
2	东海领航精选 3 个月持有期混合型发起式证券投资基金	中证 800 指数收益率*80%+ 中国债券总指数收益率 *20%	中证 800 指数收益率*80%+ 中债综合全价(总值)指数 收益率*20%

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。此外，东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同对基金托管人的部分基本信息进行更新。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（<https://www.donghaifunds.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自2026年9月22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：400-9595531

网址：<https://www.donghaifunds.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。

东海基金管理有限责任公司

2026年8月22日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中债总指数(全价)收益率

调整后的业绩比较基准：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：

本基金调整业绩比较基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产投资策略主要包括资产配置策略、久期管理策略、债券的类属配置策略、收益率曲线配置策略、杠杆放大策略、信用债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等。原业绩比较基准债券部分的基准要素“中债总指数(全价)”成分券由在境内公开发行且上市流通的剩余期限一年以上（包含一年）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，成分券未涵盖信用债。调整后的业绩比较基准“中债-综合全价(总值)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，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，包含利率债及公开发行的信用债，覆盖范围更广。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，中债-综合全价(总值)指数与基金实际投资范围及投资策略更为匹配，更能体现本基金的产品定位和投资风格，更适合作为本基金的业绩比较基准。因此本基金的基准要素由“中债总指数(全价)”调整为“中债-综合全价(总值)指数”。

本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该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、东海领航精选 3 个月持有期混合型发起式证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证 800 指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%

调整后的业绩比较基准：中证 800 指数收益率*80%+中债综合全价(总值)指

数收益率*20%

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响:

本基金调整债券部分基准要素, 以使新业绩比较基准代表性更强。

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, 主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。原业绩比较基准债券部分的基准要素“中国债券总指数”的成分券由在境内公开发行且上市流通的的剩余期限一年以上(包含一年)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, 成分券未涵盖信用债。调整后的业绩比较基准“中债-综合全价(总值)指数”的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, 是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数, 包含利率债及公开发行的信用债, 覆盖范围更广。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, 中债-综合全价(总值)指数与本基金的投资范围及投资策略更为匹配, 更能体现本基金的产品定位和投资风格, 适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。因此, 本基金债券资产部分所对应的基准指数由“中国债券总指数”调整为“中债-综合全价(总值)指数”。

本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性, 使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该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。