

# 创金合信量化多因子股票型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告

为维护基金份额持有人权益，以更科学、合理的业绩比较基准评价基金的业绩表现，创金合信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与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，依据《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，决定对本公司旗下创金合信量化多因子股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的业绩比较基准进行调整，并修改基金合同的相应条款。现将具体变更事项公告如下：

## 一、变更业绩比较基准

### （一）变更内容

将本基金的业绩比较基准由原来的“中证 500 指数收益率 $\times$ 90%+2%”变更为“中证 1000 指数收益率 $\times$ 90%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 10%”。

### （二）变更原因

#### 1、调整本基金股票资产基准的原因

本基金将股票资产的基准指数由中证 500 指数变更为中证 1000 指数，是因为从本基金成立至今，中证 500 指数经历了四次成分股定期调整，指数调整结合 2017 年以来市场行情发生结构性变化，导致中证 500 指数与本基金投资组合的风格特征出现不一致，可能对投资者造成误导，不再适合作为股票资产的基准指数。通过将业绩指数调整为中证 1000 指数，可以使投资者更准确地了解本基金的风格特征。

#### 2、调整本基金非股票资产业绩基准的原因

本基金为股票型基金，股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其余非股票资产主要投资于流动性良好的现金管理工具，在满足基金资产流动性的同时增厚投资组合整体的回报。因此，“银行人民币活期存款利率（税后）”更适合作为非股票资产部分的参考目标回报。

综上，通过对业绩比较基准进行变更，可以更加真实地反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

### （三）变更业绩比较基准对基金份额持有人的影响

本基金变更业绩比较基准不涉及基金投资目标、投资范围、投资策略的调整，对基金份额持有人没有实质性不利影响。通过变更业绩比较基准，可以使投资者更加明确了解本基金的风险收益特征，从而更科学、合理地评价本基金的业绩表现和指导投资决策。

## 二、修改基金合同等法律文件的相应条款

根据上述业绩比较基准的变更方案，本公司将对本基金的基金合同等法律文件的相应条款进行修改。修改内容如下：

### （一）基金合同

将基金合同 第十二部分“基金的投资”中“五、业绩比较基准”的内容修改为：

“中证 1000 指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%

如果法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，基金管理人可根据本基金的投资范围和投资策略调整基金的业绩比较基准，但应在调整实施前公告并报中国证监会备案，无须召开基金份额持有人大会审议。”

本公司将于公告当日将修改后的基金合同登载于公司网站。

### （二）托管协议

本基金变更业绩比较基准不涉及托管协议的修改。

### （三）招募说明书

本公司将在今后发布的本基金招募说明书（更新）中更新业绩比较基准。

上述变更及修订事项不涉及基金份额持有人权利义务关系的重大变化，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了适当的程序，符合相关法律法规及基金合同“第十二部分 基金的投资”中“五、业绩比较基准”的有关规定。

## 三、重要提示

1、上述变更及修订事项自 2018 年 6 月 11 日起生效；

2、本公告最终解释权归创金合信基金管理有限公司。投资者欲了解详细信息请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书（更新）及相关法律文件。

3、投资者可通过本公司的客服热线或网站咨询有关详情：

创金合信基金管理有限公司

客服电话：400-868-0666

网址：[www.cjxfund.com](http://www.cjxfund.com)

4、风险提示：

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。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

创金合信基金管理有限公司

二〇一八年六月七日