

华商基金管理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，华商基金管理有限公司（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	调整后的业绩比较基准
1	华商核心成长一年持有期混合型证券投资基金	中证 500 指数收益率*60%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合财富（总值）指数收益率*10%
2	华商品质慧选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*75%+中债综合财富（总值）指数收益率*15%+中证港股通综合指数收益率*10%	中证全指指数收益率*85%+中债-综合财富（总值）指数收益率*15%
3	华商双擎领航混合型证券投资基金	中证科技 100 指数收益率*40%+中证内地消费主题指数收益率*40%+中债总全价（总值）指数收益率*20%	中证科技 100 指数收益率*35%+中证内地消费主题指数收益率*35%+中证医药卫生指数收益率*15%+中债-总全价（总值）指数收益率*15%
4	华商均衡 30 混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*80%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*90%+中债-综合财富（总值）指数收益率*10%
5	华商主题精选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
6	华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%	中证 800 指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
7	华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%	中证 800 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
8	华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*65%+上证国债指数收益率*35%	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
9	华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金	沪深 300 指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%	中证 800 指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%

10	华商上游产业股票型证券投资基金	中证上游资源产业指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%	中证全指原材料指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
11	华商改革创新股票型证券投资基金	中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
12	华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金	中信计算机指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%	中信计算机指数收益率*90%+中证全债指数收益率*10%
13	华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金	中信电子元器件指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%	中信电子指数收益率*90%+中证全债指数收益率*10%
14	华商未来主题混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
15	华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金	中证全债指数	中证可转换债券指数收益率*65%+中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*20%+中证 800 指数收益率*15%
16	华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金	中证全债指数	中证可转换债券指数收益率*55%+中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*30%+中证 800 指数收益率*15%
17	华商收益增强债券型证券投资基金	中证综合债指数收益率	中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*45%+中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数收益率*45%+中证可转换债券指数收益率*10%
18	华商安恒债券型证券投资基金	中证全债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%	中证全债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*7%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%
19	华商安元债券型证券投资基金	中债-综合全价（总值）指数收益率*88%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%	中债-综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*7%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%
20	华商信用增强债券型证券投资基金	中证全债指数	中债-AAA 信用债综合财富（1-3 年）指数收益率*60%+中证可转换债券指数收益率*25%+中证 800 指数收益率*15%

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）、业绩比较基准要

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.hsfund.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、托管协议（如有）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

客户服务电话：400-700-8880、010-58573300

网址：www.hsfund.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（更新）、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。

华商基金管理有限公司

2026 年 8 月 21 日

附件：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、华商核心成长一年持有期混合型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准： $\text{中证 500 指数收益率} \times 60\% + \text{中债综合财富（总值）指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 10\%$

(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涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过自上而下的精选高景气度的成长赛道进行行业配置，并结合自下而上挖掘具有长期发展潜力的优质成长个股，构建股票投资组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。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，以及指数盘别/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要素指数从中证 500 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80% 提高至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重从 60% 提高至 70%，港股通股票部分的基准要素权重保持不变），将债券资产所对应的基准要素权重从 20% 调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，中证 500 指数（指数代码：000905）由中证指数有限公司编制，由沪深证券市场中 500 只沪深 300 指数成份股之外的流动性好、代表性强的中小市值股票组成，综合反映沪深证券市场中一批中小市值公司的整体情况。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率上升，相关系数、行业偏离度保持平稳，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商品质慧选混合型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中债综合财富（总值）指数收益率} \times 15\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证全指指数收益率} \times 85\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 15\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，主要通过定量和定性相结合的方式考察和筛选未来成长性高、盈利能力强、估值匹配且核心竞争力突出的优质公司进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。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，以及指数盘别/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要素指数从沪深 300 指数调整为中证全指指数。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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 股股票资产所对应的基准要素权重从 75%提高至 85%，债券资产所对应的基准要素权重保持不变，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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证全指指数（指数代码：000985）由上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的股票和

存托凭证组成样本，具有较高的市场代表性，反映上交所、深交所和北交所市场上市公司的整体表现，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系数上升，行业偏离度下降，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商双擎领航混合型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准： $\text{中证科技 100 指数收益率} \times 40\% + \text{中证内地消费指数收益率} \times 40\% + \text{中债总全价（总值）指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证科技 100 指数收益率} \times 35\% + \text{中证内地消费主题指数收益率} \times 35\% + \text{中证医药卫生指数收益率} \times 15\% + \text{中债-总全价（总值）指数收益率} \times 15\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因、差异及影响

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向本基金所界定的双擎领航主题上市公司股票，重点投资于科技类以及消费类的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。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，本基金选取中证科技 100 指数、中证内地消费主题指数和中证医药卫生指数作为股票部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80% 提高至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重从 20% 调低至 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、仓位等基本匹配。

由于医药行业属于中信一级行业分类中的消费领域，本基金新业绩比较基

准中增加了中证医药卫生指数（指数代码：000933）。中证医药卫生指数从中证 800 指数样本中选取中证一级行业分类归属于医药卫生行业的全部证券，反映中证 800 指数样本中医药卫生行业公司证券的整体表现，适合作为本基金医药行业股票部分的业绩比较基准要素。调整后的股票基准成份券覆盖率增加，相关系数保持平稳，行业偏离度下降，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商均衡 30 混合型证券投资基金

（1）业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*80%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*90%+中债-综合财富（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涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金重点精选具有优质成长前景且兼具充足估值安全边际的上市公司进行集中投资。因此整体投资策略的架构以“自下而上”的精选个股为主，兼顾股票资产在行业间的合理配置；在形成最终股票投资组合后，本基金将根据宏观经济及证券市场状况确定大类资产的配置比例以提升本基金的风险调整后收益。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，将股票部分所对应的基准要素指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 20%调低至 10%，从而使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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系数上升，行业偏离度下降，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商主题精选混合型证券投资基金

（1）业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*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涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题投资”这个核心理念，深入分析挖掘社会经济发展进程中各类投资主题得以产生和持续的内在驱动因素，重点投资于具有可持续发展前景的投资主题中的优质上市公司，在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票部分所对应的基准要素指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 75%

提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 25%调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系数上升，行业偏离度保持平稳，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金

（1）业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%

调整后新业绩比较基准：中证 800 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

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要投资于与健康生活相关的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。由于健康生活主题覆盖众多子行业，我们将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值。在行业配置的基础上，本基金管理人将采用“自下而上”的研究方法，充分发挥投研团队的主动选股能力，紧密围绕健康生活投资主题，从上市公司的基本面研究出发，重点分析企业成长性和投资价值，挖掘出符合中国经济转型、具有爆发式增长机会、有利于改善人类生活质量、持续成长能力的优质企业。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，将股票部分所对应的基准要素指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近三年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 55% 提高至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重从 45% 调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系数上升，行业偏离度下降，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金

（1）业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*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涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过紧密跟踪中国经济动向，把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征，挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会，综合运用主题投资、行业轮动等投资策略，追求基金资产的长期、持续增值。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，将股票部分所对应的基准要素指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近三年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 55% 提高至 75%，将债券资产所对应的基准要素权重从 45% 调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系数上升，行业偏离度保持平稳，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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、华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证 800 指数收益率*65%+上证国债指数收益率*35%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*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仅涉及基准要素权重调整，不涉及基准要素指数调整。

基于本基金近三年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 65% 提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 35% 调低至 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、仓

位等基本匹配。

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、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%

调整后新业绩比较基准：中证 800 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

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，积极进行资产配置，深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资，充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人创造绝对收益和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，将股票部分所对应的基准要素指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近三年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 55%提高至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重从 45%调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系

数上升，行业偏离度保持平稳，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

10、华商上游产业股票型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证上游资源产业指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证全指原材料指数收益率*85%+中证全债指数收益率*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涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金重点研究当前经济趋势，把握上游产业中所蕴含的投资机会，精选相关产业下具有优质成长性的上市公司，追求资产的长期稳定增值。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，将股票部分所对应的基准要素指数从中证上游资源产业指数调整为中证全指原材料指数。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80% 提高至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重从 20%调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，中证上游资源产业指数（指数代码：000961）隶属中证产业链指数系列，中证产业链指数系列由中证上游资源产业指数、中证中游制造产业指数以及中证下游消费与服务产业指数等三条指数构成，分别从中证 800 指数样本中选取规模大、具有相关产业链特征的上市公司证券作为指数样本，为投资者提供更多样化的投资标的。调整后的业绩比较基准中，中证全指原材料指数（指数代码：000987）隶属于中证全指行业优选指数系列。中证全

指行业优选指数系列从中证全指对应行业中选取符合一定流动性与市值筛选条件的上市公司作为指数样本，以反映各个行业内较具代表性与可投资性的上市公司证券的整体表现。中证全指原材料指数适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。调整后的股票基准成份券覆盖率上升，相关系数保持平稳，行业偏离度下降，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

11、华商改革创新股票型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证 800 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*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涉及基准要素权重调整，不涉及基准要素指数调整。

基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 20%调低至 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、仓位等基本匹配。

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。

12、华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中信计算机指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中信计算机指数收益率*90%+中证全债指数收益率*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仅涉及基准要素权重调整，不涉及基准要素指数调整。

基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 20%调低至 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、仓位等基本匹配。

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。

13、华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中信电子元器件指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中信电子指数收益率*90%+中证全债指数收益率*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仅涉及基准要素权重调整，不涉及基准要素指数调整。新业绩比较基准中的中信电子指数由原业绩比较基准中的中信电子元器件指数更名而来，代码 CI005025 保持不变。

基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 20%调低至 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、仓位等基本匹配。

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。

14、华商未来主题混合型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*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涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金坚持“自上而下”、“自下而上”相结合的投资视角，重点关注居民收入增长和消费升级蕴含的新兴产业投资机会，精选优质上市公司股票，力求实现基金资产的长期稳健增值。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票部分所对应的基准要素指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数。

此外，基于本基金近两年股票资产的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 75% 提高至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重从 25% 调低至 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，沪深 300 指数（指数代码：000300）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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的股票基准成份券覆盖率、相关系数上升，行业偏离度下降，代表性更强。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

15、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证全债指数

调整后新业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率*65%+中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*20%+中证 800 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指数、基准要素权重调整。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于可转换债券、其他债券等固定收益类品种，同时投资于 A 股股票等权益类品种，相应选取与之匹配的可转换债券指数、其他债券指数以及 A 股指数作为基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的可转换债券资产兼顾其债性稳健收益与股性增强收益的双重属性，助力实现基金资产长期稳定增值的整体目标。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾基准指数的表征性、认可度，以及指数的覆盖范围、可转债特性匹配度等，本基金选取中证可转换债券指数作为可转换债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的其他债券资产投资在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。在投资策略选择上，本基金重点关注期限策略及利差策略。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，本基金选取中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数作为其他债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票投资以自下而上的精选个股为主，采用定量和定性相结合的方式，投资以成长型股票为主。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，本基金选取中证 800 指数作为股票部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金近两年可转换债券资产、其他债券资产、股票资产的平

均仓位情况，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可转换债券资产、其他债券资产、股票资产与所对应的基准要素权重分别设置为 65%、20%与 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。

原业绩比较基准中，中证全债指数（指数代码：H11001）选取在沪深交易所或银行间市场上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、同业存单等债券作为成份券，反映境内债券市场的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证可转换债券指数（指数代码：000832）的样本券由在沪深交易所上市的可转换债券组成。指数采用市值加权计算，以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。中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数（指数代码：CBA33401）隶属于中债总指数族系，该指数成份券包含境内公开发行且上市流通的剩余期限为 0-7 年（含 7 年）的国债及政策性金融债券，适合作为本基金其他债券部分的业绩比较基准要素。中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。调整后的基准久期与实际投资运作相匹配。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

16、华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金

（1）业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证全债指数

调整后新业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率*55%+中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*30%+中证 800 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指数、基准要素权重调整。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于可转

换债券、其他债券等固定收益类品种，同时投资于 A 股股票等权益类品种，相应选取与之匹配的可转换债券指数、其他债券指数以及 A 股指数作为基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的可转换债券资产兼顾其债性稳健收益与股性增强收益的双重属性，助力实现超越业绩基准的整体目标。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，以及指数的覆盖范围、可转债特性匹配度等，本基金选取中证可转换债券指数作为可转换债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的其他债券资产采取积极主动的投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在投资策略选择上，本基金重点关注期限策略及利差策略。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金选取中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数作为其他债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票投资以自下而上的精选个股为主，采用定量和定性相结合的方式，投资以成长型股票为主，把握较确定性的投资机会，在得到稳定收益的同时，以期获得超过业绩比较基准的收益。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，本基金选取中证 800 指数作为股票部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金近两年可转换债券资产、其他债券资产、股票资产的平均仓位情况，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可转换债券资产、其他债券资产、股票资产与所对应的基准要素权重分别设置为 55%、30%与 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。

原业绩比较基准中，中证全债指数（指数代码：H11001）选取在沪深交易所或银行间市场上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票

据、短期融资券、同业存单等债券作为成份券，反映境内债券市场的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中证可转换债券指数（指数代码：000832）的样本券由在沪深交易所上市的可转换债券组成，指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换债券的整体表现；中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数（指数代码：CBA33401）隶属于中债总指数族系，该指数成份券包含境内公开发行且上市流通的剩余期限为 0-7 年（含 7 年）的国债及政策性金融债券；上述两只指数覆盖的债券品种与本基金的债券投资范围以及投资策略契合，且调整后的基准久期与实际投资运作相匹配，适合作为本基金可转换债券与其他债券部分的业绩比较基准要素。中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

17、华商收益增强债券型证券投资基金

（1）业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*45%+中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数收益率*45%+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

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素指数、基准要素权重调整。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于利率类债券、信用类债券和可转换债券等固定收益类金融工具，相应选取与之匹配的利率类债券指数、信用类债券指数和可转换债券指数作为基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金将根据国内外宏观经济形势、市场利率走势和资金供求情况分析，预测债券市场利率走势，并结合各类固定收益产品收益率、流动性、信用风险、久期、税收和利率敏感性分析，

评定各类产品的投资价值，在严格控制风险的前提下，主动构建及调整固定收益投资组合，力争获取超额收益。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，以及指数覆盖范围、信用等级分布、久期特征等，本基金选取中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数作为利率类债券部分的业绩比较基准要素，选取中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数作为信用类债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金将选择公司基本面优良的可转换债券进行投资，本基金持有的可转换债券可以转换为股票。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，以及指数的覆盖范围、可转换债券特性匹配度等，本基金选取中证可转换债券指数作为可转换债券部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金近两年利率类债券、信用类债券和可转换债券资产的平均仓位情况，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利率类债券资产、信用类债券资产、可转换债券资产与所对应的基准要素权重分别设置为 45%、45%与 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。

原业绩比较基准中，中证综合债指数（指数代码：H11009）由在沪深证券交易所及银行间市场上市的剩余期限 1 个月以上的国债、金融债、企业债、央行票据及企业短期融资券构成。调整后的业绩比较基准中，中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数（指数代码：CBA33401）隶属于中债总指数族系，该指数成份券包含境内公开发行且上市流通的剩余期限为 0-7 年（含 7 年）的国债及政策性金融债券；中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数（指数代码：CBA35491）隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包括在境内公开发行且上市流通的信用债，要求中债市场隐含评级 AA+及以上、主体评级 AAA（待偿期 0-7 年）。上述两只指数覆盖的债券品种与本基金的债券投资范围以及投资策略契合，适合作为本基金利率类债券与信用类债券部分的业绩比较基准要素。中证可转换债券指数（指数代码：000832）的样本券由在沪深交易所上市的可转换债券组成。指数采用市值加权计算，以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。调整后的基准久

期与实际投资运作相匹配。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

18、华商安恒债券型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证全债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%

调整后新业绩比较基准：中证全债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*7%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%

(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仅涉及基准要素权重调整，不涉及基准要素指数调整。

基于《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》相关要求，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港股通标的股票部分所对应的基准要素权重从 2%提高至 3%，同时将 A 股股票部分的业绩比较基准权重由 8%调低至 7%，从而使得新业绩比较基准符合法律法规要求。

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。

19、华商安元债券型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率*88%+沪深 300 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*7%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*3%

(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仅涉及基准要素权重调整，不涉及基准要素指数调整。

基于本基金近两年债券资产以及股票资产的平均仓位、《公开募集证券投

资基金业绩比较基准指引》相关要求，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所对应的基准要素权重从 88%提高至 90%，股票资产所对应的基准要素权重从 12%调低至 10%，其中 A 股股票部分的基准要素权重从 10%调低至 7%，港股通标的股票部分的基准要素权重从 2%提高至 3%，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法律法规、基金过往实际投资运作、仓位等基本匹配。

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。

20、华商信用增强债券型证券投资基金

(1) 业绩比较基准调整内容

当前业绩比较基准：中证全债指数

调整后新业绩比较基准：中债-AAA 信用债综合财富（1-3 年）指数收益率*60%+中证可转换债券指数收益率*25%+中证 800 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指数、基准要素权重调整。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于信用债、可转换债券等固定收益类品种，以及 A 股股票等权益类资产，相应选取与之匹配的信用债指数、可转换债券指数以及 A 股指数作为基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产以信用债为核心配置方向，充分考虑资产的安全性、收益性和流动性，通过积极进行债券配置，力争风险最小化的同时，实现超越业绩基准的投资表现。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金选取中债-AAA 信用债综合财富（1-3 年）指数作为信用债部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的可转换债券资产投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法，对可转债发行人的公司基本情况进行深入研究，选择价值低估的可转换债券进行投资，力争实现超越业绩基准的投资表现。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，以及指数的覆盖范围、可转债特性匹配度等，本

基金选取中证可转换债券指数作为可转换债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票投资充分发挥“自下而上”的主动选股能力，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，在控制风险的前提下适度参与权益投资，力争实现超越业绩基准的投资表现。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，本基金选取中证 800 指数作为股票部分的业绩比较基准要素。

此外，基于本基金近两年信用债资产、可转换债券资产、股票资产的平均仓位情况，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信用债资产、可转换债券资产、股票资产与所对应的基准要素权重分别设置为 60%、25%与 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。

原业绩比较基准中，中证全债指数（指数代码：H11001）选取在沪深交易所或银行间市场上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、同业存单等债券作为成份券，反映境内债券市场的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中债-AAA 信用债综合财富（1-3 年）指数（指数代码：CBA35421）隶属于中债总指数族分类，成份券包括在境内公开发行且上市流通的信用债，要求中债市场隐含评级 AA+及以上、主体评级 AAA。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，指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换债券的整体表现。上述两只指数覆盖的债券品种与本基金的债券投资范围以及投资策略契合，且调整后的基准久期与实际投资运作相匹配，适合作为本基金信用债部分与可转换债券部分的业绩比较基准要素。中证 800 指数（指数代码：000906）由沪深市场市值较大、流动性较好的 800 只证券构成，反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现。中证 800 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。因此调整后的业绩比较基准与基金实际投资风格更为匹配，从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格。

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。

