

华泰柏瑞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，华泰柏瑞基金管理有限公司（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	调整后的新业绩比较基准
1	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率*60%+中债总指数(全价)收益率*40%	中国战略新兴产业成份指数收益率*85%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%
2	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率*40%+中债总指数(全价)收益率*40%+中证TMT 产业主题指数收益率*20%	中证新兴产业指数收益率*80%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%
3	华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%	中证 A500 指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
4	华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金	恒生指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%	恒生指数收益率*90%+上证国债指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
5	华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金	恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*80%+沪深 300 指数收益率*15%+人民币银行活期存款利率(税后)*5%	中证港股通综合指数（人民币）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%
6	华泰柏瑞红利量化选股混合型证券投资基金	中证红利指数收益率*85%+中债综合全价指数收益率*10%+恒生港股通高股息率指数收益率(使用估值汇率折算)*5%	中证红利指数收益率*90%+恒生港股通高股息率指数收益率*5%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%
7	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*80%+中债国债总指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*85%+中债-国债总全价（总值）指数收益率*15%

8	华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债-综合财富（总值）指数收益率*15%
9	华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%	中证 800 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
10	华泰柏瑞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*80%+上证国债指数收益率*20%	中证内地消费主题指数收益率*55%+中证全指医药卫生指数收益率*40%+上证国债指数收益率*5%
11	华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%	中证新兴产业指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*15%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%
12	华泰柏瑞锦华债券型证券投资基金	中债综合全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*12%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%	中债-综合全价（总值）指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%
13	华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金	中债综合指数	中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*75%+中证可转换债券指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
14	华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金	中债综合全价指数收益率*80%+银行一年期定期存款利率(税后)*20%	中债-综合全价（1-3 年）指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%

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。同时更新基金托管人相关信息（如涉及）。基金管理人将更新托管协议（如涉及）、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（如涉及）、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.huatai-pb.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

本公司客户服务电话：400-888-0001、(021) 38784638

本公司网站：www.huatai-pb.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。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2026 年 8 月 22 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证新兴产业指数收益率*60%+中债总指数(全价)收益率*40%

调整后新业绩比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*85%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分和债券部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 60%提高至 85%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 40%调整至 15%。

本基金的股票资产主要投资于创新动力主题相关的证券，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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由中证新兴产业指数更换为更具代表性的中国战略新兴产业成份指数。中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映战略新兴产业上市公司证券的整体表现，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

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。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、认可度等，本基金将债券部分的基准要素由中债总指数(全价)更换为中债-综合全价（总值）指数。中债-综合全价（总值）指数具有良好的市场代表性和较高的知名度，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更匹配基金的主题界定。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

2、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证新兴产业指数收益率} \times 40\% + \text{中债总指数(全价)收益率} \times 40\% + \text{中证 TMT 产业主题指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证新兴产业指数收益率} \times 80\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 20\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分和债券部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 60% 提高至 80%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 40% 调整至 20%。

本基金的股票资产主要投资于创新升级主题相关的证券，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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由中证新兴产业指数和中证 TMT 产业主题指数调整为中证新兴产业指数。中证新兴产业指数从沪深市场中选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场较具代表性的新兴产业上市公司证券的整体表现，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

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。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、认可度等，本基金将债券部分的基准要素由中债总指数(全价)更换为中债-综合全价（总值）指数。中债-综合全价（总值）指数具有良好的市场代表性和较高的知名度，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更匹配基金的主题界定。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

3、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{上证国债指数收益率} \times 40\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 A500 指数收益率} \times 80\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后 A 股股票资产所对应的要素权重由 60% 调整至 80%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 40% 调整至 20%。

本基金的股票资产投资采取行业轮动策略。所谓行业轮动策略是指，在宏观分析和个股选择的基础上强调行业的动态优化配置。通过超配不同时期的相对强势行业，获得超越市场平均水平的收益。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、认可度等，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 A500 指数。中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。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。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

4、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{恒生指数收益率} \times 90\% + \text{银行活期存款利率(税后)} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{恒生指数收益率} \times 90\% + \text{上证国债指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金在业绩比较基准中增加表征债券资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于港股通标的股票、债券、现金等资产，原业绩比较基准未包含债券资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分债券

资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 5%，现金资产所对应的基准要素权重由 10%调整至 5%。

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。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、认可度等，本基金选取上证国债指数作为债券部分的业绩比较基准要素。上证国债指数由在上海证券交易所上市的固定利率国债组成，反映沪市国债的整体表现，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

5、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*80%+沪深 300 指数收益率*15%+人民币银行活期存款利率(税后)*5%

调整后新业绩比较基准：中证港股通综合指数（人民币）收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金更换港股通标的股票部分基准要素、在业绩比较基准中增加表征债券资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于港股通标的股票、A 股股票、债券等资产，原业绩比较基准未包含债券资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分债券资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 5%，现金资产所对应的要素权重调整至 0%。

本基金的股票资产将把握 A 股与港股市场互联互通的投资机会，挖掘长期业绩优秀、质地优良的上市公司股票，在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。本基金将港股通标的股票部分的基准要素由恒生指数更换为中证港股通综合指数（人民币），更能反映本基金通过港股通投资于香港市场股票的投资特征。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，以反映港股通范围内上市公司的整体表现，适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

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。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、认可度等,本基金选取中债-综合全价(总值)指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-综合全价(总值)指数具有良好的市场代表性和较高的知名度,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况,调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

6、华泰柏瑞红利量化选股混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 中证红利指数收益率*85%+中债综合全价指数收益率*10%+恒生港股通高股息率指数收益率(使用估值汇率折算)*5%

调整后新业绩比较基准: 中证红利指数收益率*90%+恒生港股通高股息率指数收益率*5%+中债-综合全价(总值)指数收益率*5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性:

本基金调整业绩比较基准的要素权重,以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产,调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 85%提高至 90%,调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 10%调整至 5%。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

7、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 沪深 300 指数收益率*80%+中债国债总指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准: 中证 800 指数收益率*85%+中债-国债总全价(总值)指数收益率*15%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性:

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分的基准要素,以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后 A 股股票资产所对应的要素权重由 80%调整至 85%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 15%。

本基金以对经济周期和产业周期的研究判断为基础，优选受益于经济发展、市场改革且处于行业领先地位的上市公司证券，追求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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。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。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

8、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 80\% + \text{中债综合指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 75\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 10\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 15\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金在业绩比较基准中增加表征港股通标的股票资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，原业绩比较基准未包含港股通标的股票资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分港股通标的股票资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 10%，A 股股票资产所对应的要素权重由 80%调整至 75%，即调整后的股票资产整体所对应的要素权重由 80%提高至 85%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 15%。

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，以反映港股通范围内上市公司的整体表现，适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

9、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 70\% + \text{上证国债指数收益率} \times 30\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 75\% + \text{上证国债指数收益率} \times 25\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后 A 股股票资产所对应的要素权重由 70% 调整至 75%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 30% 调整至 25%。

本基金通过深入研究，主要投资于已实施或将实施激励机制的优质上市公司的证券，以获得激励机制对公司业绩长期的促进，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。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、认可度等，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。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。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更匹配基金的主题界定。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

10、华泰柏瑞健康生活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*80%+上证国债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证内地消费主题指数收益率*55%+中证全指医药卫生指数收益率*40%+上证国债指数收益率*5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、债券等资产，调整后 A 股股票资产所对应的要素权重由 80%调整至 95%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 5%。

本基金的股票资产主要投资于健康生活主题相关的证券，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，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数调整为更具代表性的中证内地消费主题指数和中证全指医药卫生指数。中证内地消费主题指数隶属于中证内地主题系列指数，该系列指数反映沪深市场各重要主题类上市公司证券的整体表现。中证全指医药卫生指数隶属于中证全指行业优选指数系列，该系列从中证全指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。中证内地消费主题指数、中证全指医药卫生指数适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更匹配基金的主题界定。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

11、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证新兴产业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证新兴产业指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*15%+中债-综合全价（总值）指数收益率*15%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金在业绩比较基准中增加表征港股通标的股票资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于 A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，原业绩比较基准未包含港股通标的股票资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征该部分港股通标的股票资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 15%，A 股股票资产所对应的要素权重由 80%调整至 70%，即调整后的股票资产整体所对应的要素权重由 80%提高至 85%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 15%。

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，以反映港股通范围内上市公司的整体表现，适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更匹配基金的主题界定。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

12、华泰柏瑞锦华债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中债综合全价指数收益率} \times 85\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 12\% + \text{中证港股通综合指数(人民币)收益率} \times 3\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 85\% + \text{中证 800 指数收益率} \times 10\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换 A 股股票部分的基准要素，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于债券、A 股股票、港股通标的股票等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重相应由 12%调整至 10%，港股通标的股票资产所对应的要素权重相应由 3%调整至 5%。

本基金股票投资主要采用“自下而上”的深度基本面研究策略。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金将 A 股股票部分的基准要素由沪深 300 指数更换为中证 800 指数。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票

价格表现。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。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

13、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中债综合指数

调整后新业绩比较基准：中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*75%+中证可转换债券指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金更换普通债券部分基准要素，在业绩比较基准中增加表征可转换债券和现金资产部分的基准要素，并相应调整业绩比较基准的要素权重，以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于普通债券、可转换债券、现金等资产，原业绩比较基准未包含可转换债券和现金资产部分的基准要素，调整后的业绩比较基准中增加了表征可转换债券资产和现金资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 20% 和 5%。普通债券资产所对应的要素权重由 100%调整至 75%。

本基金将主要投资于固定收益类金融工具，其中信用债又将成为固定收益类金融工具中的重点配置标的。在固定收益类金融工具的投资上，本基金将在对未来利率趋势、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面分析的基础上，运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等，以获取债券市场的长期稳定收益。综合考虑基准指数与产品定位、组合久期的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等，本基金将普通债券部分的基准要素由中债综合指数更换为中债-综合财富（1-3 年）指数。中债-综合财富（1-3 年）指数由在境内公开发行且上市流通的国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等成份券组成，成份券待偿期在 1-3 年（含 1 年），反映境内人民币中短久期债券市场整体表现，适合作为本基金普通债券部分的业绩比较基准要素。

本基金适度投资于可转换债券。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。中证可转换债券指数的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成,以反映国内市场可转换债券的总体表现,适合作为本基金可转换债券部分的业绩比较基准要素。

活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力,适合作为本基金现金资产部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况,调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

14、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期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*80%+银行一年期定期存款利率(税后)*20%

调整后新业绩比较基准: 中债-综合全价(1-3 年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性:

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换债券资产和现金资产部分的基准要素,以使新业绩比较基准代表性更强。

本基金主要投资于债券、现金等资产,调整后的债券资产对应的要素权重由 80%调整至 95%,现金资产对应的要素权重由 20%调整至 5%。

本基金的债券投资将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上,综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略,选择合适的时机和品种构建债券组合。综合考虑基准指数与产品定位、组合久期的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金将债券资产部分的基准要素由中债综合全价指数更换为中债-综合全价(1-3 年)指数。中债-综合全价(1-3 年)指数由在境内公开发行且上市流通的国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等成份券组成,成份券待偿期在 1-3 年(含 1 年),反映境内人民币中短久期债券市场整体表现,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。同时将现金资产部分的基准要素由银行一年期定期存款利率(税后)更换为活期存款基准利率。活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力,适合作为本基金现金资产部分的业绩比较基准要素。

调整后的新要素权重更符合基金所投资主要资产类别的过往实际投资运作情况，调整后的新要素也更符合基金产品定位、投资风格等。本次调整业绩比较基准对基金产品投资运作及基金份额持有人利益无实质性不利影响。