

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	调整后的业绩比较基准
1	华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金	中证红利指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%	中证红利指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
2	华商动态阿尔法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*70%+上证国债指数收益率*30%
3	华商量化进取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1000指数收益率*85%+上证国债指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
4	华商大盘量化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%	沪深300指数收益率*95%+上证国债指数收益率*5%
5	华商300智选混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*75%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*5%	沪深300指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+上证国债指数收益率*5%
6	华商高端装备制造股票型证券投资基金	中证高端装备制造指数收益率*70%+中证全债指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*10%	中证高端装备制造指数收益率*80%+中证全债指数收益率*10%+中证港股通TMT主题指数（人民币）收益率*5%+国证港股通新能源指数（人民币）收益率*5%
7	华商医药消费精选混合型证券投资基金	沪深300医药卫生指数收益率*30%+中证内地消费主题指数收益率*30%+中证港股通大消费主题指数（CNY）收益率*10%+中债总全价（总值）指数收益率*30%	中证医药卫生指数收益率*55%+中证全指主要消费指数收益率*20%+中证港股通大消费主题指数（人民币）收益率*10%+中债-总全价（总值）指数收益率*15%
8	华商新常态灵活配置混合型证券投资基金	沪深300收益率*65%+上证国债指数收益率*35%	中证800指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
9	华商量化优质精选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%
10	华商双翼平衡混合型证券投资基金	中债综合全价（总值）指数收益率*60%+沪深300指数收益率*40%	中证800指数收益率*35%+中证可转换债券指数收益率*30%+中债-综合全价（总值）指数收益率*35%

11	华商竞争力优选混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数收益率*5%+中证全债指数收益率*30%	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%+中证全债指数收益率*15%
12	华商鑫选回报一年持有期混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*10%	中证 800 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%
13	华商恒益稳健混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*35%+中证港股通综合指数收益率*5%+中债总全价指数收益率*60%	中债-总全价（总值）指数收益率*55%+中证 800 指数收益率*40%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%
14	华商创新成长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%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富指数收益率*15%
15	华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 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%
16	华商转债精选债券型证券投资基金	中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%	中证可转换债券指数收益率*90%+中债-综合财富（总值）指数收益率*10%
17	华商鸿源三个月定期开放纯债债券型证券投资基金	中债综合全价（总值）指数收益率	中债-新综合全价（总值）指数收益率
18	华商鸿裕利率债债券型证券投资基金	中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率*80%+同期活期存款利率（税后）*20%	中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率
19	华商鸿信纯债债券型证券投资基金	中债综合全价（总值）指数收益率	中债-高信用等级债券全价（总值）指数收益率
20	华商稳健双利债券型证券投资基金	中证综合债指数收益率	中证 800 指数收益率*15%+中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*30%+中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数收益率*55%

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.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 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: 400-700-8880、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、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 6 月 26 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、华商红利优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：中证红利指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%

调整后新业绩比较基准：中证红利指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%

(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 55%提高至 70%，将债券资产所对应的基准要素权重从 45%调低至 30%，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。

2、华商动态阿尔法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*70%+上证国债指数收益率*30%

(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，将主动投资与数量化组合管理有机的结合起来，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的公司选择相结合的策略，从而在有效控制风险的同时，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。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 70%，将债券资产所对应的基准要素权重从 45% 调低至 30%，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。

3、华商量化进取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*60%+上证国债指数收益率*40%

调整后新业绩比较基准：中证 1000 指数收益率*85%+上证国债指数收益率*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，本基金股票投资策略主要是以数量化投资技术为基础，并辅以基本面研究，根据市场的变化，灵活运用多种量化模型策略从而提高组合收益，严格控制下行风险，实现基金资产的持续稳健增长。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 1000 指数。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

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 60% 提高至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重从 40% 调低至 10%，将现金类资产所对应的基准要素权重设定为 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、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 1000 指数（指数代码：000852）选取中证 800 指数样本以外的规模偏小且流动性好的 1000 只证券作为指数样本，与沪深 300 和中证 500 等指数形成互补。中证 1000 指数样本量大，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。同时，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类资产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。

4、华商大盘量化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：沪深 300 指数收益率*95%+上证国债指数收益率*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 55%提高至 95%，将债券资产所对应的基准要素权重从 45%调低至 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、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。

5、华商 300 智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%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*5%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+上证国债指数收益率*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，本基金的债券资产主要通过久期控制和结构分析策略进行投资管理，并辅以收益率曲线策略、利差策略等，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。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，将债券资产部分所对应的基准要素指数从中债-综合全价（总值）指数调整为上证国债指数。

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 95%（其中 A 股股票部分的基准要素权重从 75% 提高至 90%，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 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、仓位等基本匹配。

原业绩比较基准中，中债-综合全价（总值）指数（指数代码：CBA00203）成份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人且上市流通的债券，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。调整后的新业绩比较基准，上证国债指数（指数代码：000012）由在上海证券交易所上市的固定利率国债组成，指数采用市值加权计算，以反映沪市国债的整体表现，与本基金更为契合。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、华商高端装备制造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：中证高端装备制造指数收益率*70%+中证全债指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*10%

调整后新业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*80%+中证全债指数收益率*10%+中证港股通 TMT 主题指数（人民币）收益率*5%+国证港股通新能源指数（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资于高端装备制造行业相关股票，本基金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考察和筛选具有综合性比较优势的品种，从而通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过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，将本基金的港股通股票部分所对应的基准指数从中证港股通综合指数调整为中证港股通 TMT 主题指数（人民币）与国证港股通新能源指数（人民币）。

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 70% 提高至 80%，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，中证港股通综合指数（代码：930930）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。调整后的业绩比较基准中，中证港股通 TMT 主题指数（人民币）（代码：931030）从港股通范围内选取 50 只 TMT 主题领域的上市公司证券作为指数样本，以反映相关行业主题上市公司证券的整体表现；国证港股通新能源指数（人民币）（代码：987027）选取港股通范围内公司业务涉及新能源、新能源整车相关领域且不属于公用事业行业

的上市公司证券作为样本，反映港股通范围内新能源领域相关上市公司的运行特征。上述 2 只港股通股票行业主题指数与本基金主题行业更为契合。调整后的股票基准成份券覆盖率保持平稳，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，从而能够更好地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、华商医药消费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 医药卫生指数收益率*30%+中证内地消费主题指数收益率*30%+中证港股通大消费主题指数（CNY）收益率*10%+中债总全价（总值）指数收益率*30%

调整后新业绩比较基准：中证医药卫生指数收益率*55%+中证全指主要消费指数收益率*20%+中证港股通大消费主题指数（人民币）收益率*10%+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医药行业和消费行业主题相关公司，通过精选具备成长潜力且估值合理的个股，从而在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，追求超越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，以及指数主题界定、市值覆盖、行业与个股分布等，将本基金 A 股股票部分所对应的基准指数从沪深 300 医药卫生指数调整为中证医药卫生指数，从中证内地消费主题指数调整为中证全指主要消费指数。

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 70% 提高至 85%（其中 A 股股票中医药主题部分的基准要素权重从 30% 提高至 55%，A 股股票中消费主题部分的基准要素权重从 30% 调低至 20%，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 30% 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 医药卫生指数（指数代码：000913）选取沪深 300 指数样本中归属于医药卫生行业的证券；调整后的业绩比较基准中，中证医药卫生指数（指数代码：000933）选取中证 800 指数样本中按照中证指数一级行业分类归属于医药卫生行业的证券，综合反映 A 股市场医药卫生行业公司证券的整体表现，与主题界定更为契合。原业绩比较基准中，中证内地消费

主题指数（指数代码：000942）由中证 800 指数中的主要消费和可选消费行业公司股票组成样本股；调整后的业绩比较基准中，中证全指主要消费指数（指数代码：000990）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，以反映对应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，与主题界定更为契合。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、华商新常态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 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*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，通过定性分析和定量分析相结合的方法，选择优质上市公司股票进行配置，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，预期整体偏向于大中盘均衡投资风格。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 65% 提高至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重从 35% 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。

9、华商量化优质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*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，本基金的股票资产采用全市场选股策略，主要通过量化方法，自行业配置至个股筛选上均以优质属性为核心出发点，构建定量筛选和量化分析体系，寻求股票投资组合在优质资产层面上的充分暴露，在严格控制风险的前提下，力求为基金份额持有人获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。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。

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。

10、华商双翼平衡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：中债综合全价（总值）指数收益率*60%+沪深 300 指数收益率*40%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*35%+中证可转换债券指数收益率*30%+中债-综合全价（总值）指数收益率*35%

(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，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，从而在力争本金稳妥的基础上，适当参与股票投资，积极追求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。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健增值的整体目标。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，本基金新增中证可转换债券指数作为可转债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 40% 调低至 35%，基于本基金近两年可转债资产的平均仓位，将业绩比较基准中的可转债资产所对应的基准要素权重设定为 30%，将其他债券资产所对应的基准要素权重从 60%调低至 35%，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。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，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。

11、华商竞争力优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：中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数收益率*5%+中证全债指数收益率*30%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+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 70%提高至 85%（其中 A 股股票部分的基准要素权重从 65%提高至 75%，港股通股票部分的基准要素权重从 5%提高至 10%），将债券资产所对应的基准要素权重从 30%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。

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、华商鑫选回报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：沪深 300 指数收益率*70%+中证全债指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率*10%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*15%+中证港股通综合指数（人民币）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，通过行业配置策略与个股精选策略相结合的方式，判断不同行业的竞争格局、技术发展趋势、发展空间以及景气周期，并以严谨的投资分析方法综合考虑公司发展战略、治理结构、经营状况、财务状况等因素，进行优质个股甄选，从而在严格控制风险的前提下，力求为基金份额持有人获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。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%（其中 A 股股票部分的基准要素权重从 70% 提高至 75%，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 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 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。

13、华商恒益稳健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*35%+中证港股通综合指数收益率*5%+中债总全价指数收益率*60%

调整后新业绩比较基准：中债-总全价（总值）指数收益率*55%+中证 800 指数收益率*40%+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，通过定性分析和定量分析相结合的方式精选股票，重点投资于优势行业中获益程度较高且具有核心竞争优势的上市公司，在严格控制投资组合风险特征的前提下，力争获取长期稳定的投资回报，预期整体偏向于大中盘均衡投资风格。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 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 40% 提高至 45%（其中 A 股股票部分的基准要素权重从 35% 提高至 40%，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 60% 调低至 55%，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 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。

14、华商创新成长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%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富指数收益率*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，本基金主要通过定性分析对企业创新潜力和成长性进行判断，以挖掘优质企业，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，预期整体偏向于大中盘均衡投资风格。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。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产主要通过目标久期管理策略、期限结构配置策略、收益率利差策略等投资策略进行投资管理。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，将债券资产部分的基准要素指数从上证国债指数调整为中债-1-3 年国债及政策性金融债财富指数。

原业绩比较基准中，上证国债指数（指数代码：000012）由在上海证券交易所上市的固定利率国债组成。指数采用市值加权计算，以反映沪市国债的整体表现。调整后的业绩比较基准中，中债-1-3 年国债及政策性金融债财富指数（指数代码：CBA33601）隶属中债国债及政策性金融债系列指数，指数成份券包含境内公开发行且上市流通的剩余期限为 1-3 年（含 3 年）的国债及政策性金融债券。该基准指数券种、久期、信用等级分布特征等与实际投资运作相匹配，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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、华商双驱优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*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，主要投资于成长性好且具有一定安全边际的上市公司，同时挖掘被市场忽略且价值低估的优质股票，从而在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续稳健增长。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 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。

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。

16、华商转债精选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：中证可转换债券指数收益率*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：中证可转换债券指数收益率*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权重调整，不涉及基准要素指数调整。

基于本基金可转换债券的平均仓位情况，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所对应的基准要素权重从 80%提高至 90%，并将其他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等相匹配。

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。

17、华商鸿源三个月定期开放纯债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

调整后新业绩比较基准：中债-新综合全价（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指数调整。

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，主要通过久期配置策略、期限结构配置策略等投资策略进行投资管理，综合考虑基准指数与本基金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-新综合全价（总值）指数作为本基金的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准中，中债-新综合全价（总值）指数隶属于中债总指数族，该指数成份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业且上市流通的债券，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，是中债指数应用最广泛指数之一，适合作为本基金的业绩比较基准要素。本次调整后的业绩比较基准更符合基金实际投资情况，可以更好的表征投资目标、投资比例和投资风格，适合作为本基金的业绩比较基准要素。

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、华商鸿裕利率债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-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率*80%+同期活期存款利率（税后）*20%

调整后新业绩比较基准：中债-国债及政策性银行债全价（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，本基金的债券资产采用全市场策略，主要通过利率策略、久期配置策略、收益率曲线策略、期限结构配置策略及息差策略进行投资管理，同时基于本基金近两年债券资产的平均仓位情况，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 80%提高至 100%，调整后的基准采取单一指数，使得新业绩比较基准权重与基金过往实际投资运作等相匹配。

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。

19、华商鸿信纯债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

调整后新业绩比较基准：中债-高信用等级债券全价（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指数调整。

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，综合运用久期配置策略、期限结构配置策略、类属资产配置策略、收益率曲线策略、信用债及资产支持证券策略等组合管理手段进行日常管理，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，选取中债-高信用等级债券全价（总值）指数作为本基金的业绩比较基准要素。

原业绩比较基准中，中债-综合全价（总值）指数（指数代码：**CBA00203**）成份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业且上市流通的债券，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。中债-高信用等级债券全价（总值）指数（指数代码：**CBA01903**）成份券包括在境内公开发行业且上市流通、主体评级 **AA+**及以上的信用债，不包含永续债及可续期债。

基于本基金近两年债券资产的平均仓位并结合基金合同约定的投资比例限制，以及本基金过去两年组合久期特征，中债-高信用等级债券全价（总值）指数覆盖的债券品种与本基金的债券投资范围及投资策略契合，且调整后的基准久期与实际投资运作相匹配，适合作为本基金的业绩比较基准。

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、华商稳健双利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：中证 800 指数收益率*15%+中债-0-7 年国债及政策性金融债财富指数收益率*30%+中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数收益率*55%

(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，适当投资二级市场股票和新股申购，力争较平稳的为基金持有人创造持续收益，最终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，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。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金在债券组合构建过程中分为两个层次，第一个层次是期限的配置，第二个层次是品种的选择，在期限配置方面，主要采取债券组合久期调整、收益率曲线配置等策略，而在品种选择方面，主要考虑信用债券、可转债投资、资产支持证券等投资策略，力争较平稳的为基金持有人创造持续收益，最终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、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以及中债-AAA 信用债综合财富（0-7 年）指数作为债券部分的基准要素。

此外，基于本基金近两年股票资产以及债券资产的平均仓位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与债券资产所对应的基准要素权重分别设置为 15%与 85%，其中将债券资产中的利率类债券与信用类债券所对应的基准要素权重分别设置为 30%与 55%，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）选取在沪深交易所或银行间市场上交易的 BBB 及以上、且剩余期限 1 个月及以上的国债、金融

债、企业债等债券作为成份券，反映全市场债券的整体表现。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。中债-0-7 年国债及政策性金融债财富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，且调整后的基准久期与实际投资运作相匹配，适合作为本基金利率类债券与信用类债券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。