东吴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，东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自 2026 年 11 月 30 日起调整旗下部分基金的业绩比较基准，同时对相关基金管理人和/或基金托管人信息进行更新（如有），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	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金	中证国有企业改革指数×50%+中债综合指数×50%	中证国有企业改革指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
2	东吴双三角股票型证券投资基金	中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%	中证长三角龙头企业指数收益率×35%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×35%+恒生综合指数收益率×20%+中债-总全价(总值)指数收益率×10%
3	东吴新产业精选股票型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%	中证新兴产业指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
4	东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金	中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%	中证移动互联网指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
5	东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×55%+中国债券综合全价指数收益率×45%	沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
6	东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券	(上证180指数×60%+深证100指数×40%)×65%+中证全债指	沪深 300 指数收益率×90%+中证全债指数收益率×10%

	投资基金	数×35%	
7	东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+中国债券综合全价指数收益率×50%	沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
8	东吴优益债券型证券投资基金	中债总全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%	中债-总全价(总值)指数收益率×80%+中证可转换债券指数收益率×5%+沪深 300 指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
9	东吴兴弘一年持有期混合型证券投资基金	中证500指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数(全价)收益率×20%	沪深 300 指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
10	东吴兴享成长混合型证券投资基金	中证500指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数(全价)收益率×20%	沪深 300 指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
11	东吴医疗服务股票型证券投资基金	中证医疗指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数(全价)收益率×10%	中证全指医药卫生指数收益率×80%+恒生医疗保健指数收益率×10%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
12	东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%	沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
13	东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%	沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
14	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金	中证医疗指数收益率×65%+中债综合全价(总值)指数收益率×35%	中证全指医药卫生指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
15	东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+中国债券综合全价指数收益率×50%	沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%

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。基金管理人将根据实际情况更新基金合同及托管协议中涉及基金管理人和/或基金托管人的基本信息（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（https://www.scfund.com.cn）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、托管协议（如有）自 2026 年 11 月 30 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

客户服务中心电话：400-821-0588

网址：www.scfund.com.cn

（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。

东吴基金管理有限公司

2026 年 10 月 31 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证国有企业改革指数×50%+中债综合指数×50%

调整后新业绩比较基准：

中证国有企业改革指数收益率×90%+中债-综合全价(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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重调整，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产重点投资于在国内上市的国企改革主题的上市公司，以深入的基本面研究为基础，从定性定量两个方面，精选国企改革主题上市公司中基本面良好、具有发展前景的优质上市公司进行投资，构建投资组合，从而在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。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，本基金选取中证国有企业改革指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

中证国有企业改革指数选取全部发生及拟发生改革的国有企业上市公司证券作为待选样本，其中已出台相关股权激励方案和重大资产重组方案的国企上市公司优先入选，以反映国企改革主题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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从50%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 50%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

2、东吴双三角股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%

调整后新业绩比较基准：

中证长三角龙头企业指数收益率×35%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×35%+恒生综合指数收益率×20%+中债-总全价(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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重调整，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向“双三角”相关主题证券，采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资，从而在严格控制风险的前提下，力争获得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，本基金选取中证长三角龙头企业指数、中证珠三角沿海区域发展主题指数和恒生综合指数分别作为 A 股股票和港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

中证长三角龙头企业指数选取注册地为上海、江苏、浙江的上市公司为样本空间，是体现长江三角洲地区经济和资本市场发展特点的区域特色指数，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

中证珠三角沿海区域发展主题指数从注册地在广东、福建、广西的沪深市场上市公司中选取 100 只代表性证券作为指数样本，以反映珠三角沿海区域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。

恒生综合指数涵盖香港联合交易所主板上市股份总市值约 95%，是全面的香港市场指标，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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，本基金选取中债-总全价(总值)

指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中债-总全价(总值)指数成份券由在境内公开发行且上市流通的记账式国债、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，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从60%调整为70%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 20%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

3、东吴新产业精选股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：

中证新兴产业指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债-综合全价(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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重调整，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向新兴产业主题相关公司，通过定量和定性相结合的方法进行个股自下而上的选择，重点挖掘中国经济发展和结构转型环境下新兴产业的投资机会，从而分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。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，本基金选取中证新兴产业指数和恒生综合指数分别作为A股和港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

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。

恒生综合指数涵盖香港联合交易所主板上市股份总市值约 95%，是全面的香港市场指标，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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的 A 股股票的基准要素权重从 60%调整为 70%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 20%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

4、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证移动互联网指数×50%+中债综合指数×50%

调整后新业绩比较基准：

中证移动互联网指数收益率×90%+中债-综合全价(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，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向移动互联主题的上市公司，并运用自下而上的选股策略，基于定性和定量的双重标准对个股的基本面和投资价值进行细致分析，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。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，本基金选取中证移动互联网指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。中证移动互联网指数由中证指数有限公司编制，

从移动终端提供商、移动互联网平台运营商、通过移动互联网平台商品销售商和内容服务提供商，以及其他受益于移动互联的上市公司证券中挑选规模和流动性较好的公司股票组成样本股，可以较好地反映 A 股上市公司中移动互联主题相关上市企业股票的整体表现，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从50%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 50%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

5、东吴安享量化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×55%+中国债券综合全价指数收益率×45%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(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：

本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重调整，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要采用“自上而下”的投资思路进行大类资产及行业配置，并使用量化模型控制组合回撤，一方面参考量化择时指标进行股票组合的开平仓和止损等投资交易，另一方面通过行业模型和多因子选股模型进行分散化投资，以期为投资者带来稳健收益。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金

选取沪深 300 指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。沪深 300 指数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。沪深 300 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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的 A 股股票的基准要素权重从 55%调整为 90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 45%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

6、东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

(上证 180 指数×60%+深证 100 指数×40%)×65%+中证全债指数×35%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 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同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产通过行业、企业及价格三重比较优势选股模型，对个股在行业、企业及价格三方面比较优势进行分析筛选来构建股票池，并根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律进行中长期周期持有和波段操作。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将股票资产所对应的基准指数由上证 180 指数、深证 100 指数调整为沪深 300 指数。沪深 300 指数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。沪深 300 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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，本基金选取中证全债指数作为债券部分的业绩比较基准要素。中证全债指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，可以全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从65%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 35%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

7、东吴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：

沪深 300 指数收益率×50%+中国债券综合全价指数收益率×50%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(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，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略，深入挖掘潜在的投资主题，并自下而上精选商业模式独特、竞争优势明显、具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司，在充分控制基金资产风险的前提下，力争实现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，本基金选取沪深 300 指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。沪深300指数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。沪深300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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的 A 股股票的基准要素权重从 50%调整为 90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 50%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

8、东吴优益债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中债总全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

调整后新业绩比较基准：

中债-总全价(总值)指数收益率×80%+中证可转换债券指数收益率×5%+沪深 300 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同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合。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，本基金选取中债-总全价(总值)指数及中证可转换债券指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-总全价(总值)指数成份券由在境内公开发行且上市流通的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，反映境内利率类债券整体价格走势，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。中证可转换债券指数样本由在沪深证券交易

所上市的可转换债券组成，反映沪深交易所可转换债券的总体表现，适合作为本基金可转债部分的业绩比较基准要素。

综合考虑本基金对于股票资产和现金类资产的投资策略，本基金选取沪深300指数作为A股股票部分的业绩比较基准要素，选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素。沪深300指数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。沪深300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。活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金流动性管理部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的债券资产的基准要素权重从90%调整为85%（其中中证可转换债券指数对应的权重为5%），将基准中的A股股票的基准要素权重维持为10%，新增现金类资产对应的基准要素权重5%（活期存款基准利率）。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

9、东吴兴弘一年持有期混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证500指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数(全价)收益率×20%

调整后新业绩比较基准：

沪深300指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债-综合全价(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同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用行业配置和个股选择相结合的投资策略，自上而下地进行行业遴选，综合考虑宏观经济环境、国家产业发展政策及不同行业的发展空间、景气周期、竞争格局、上下

游供需情况等因素，精选受益于宏观经济和社会发展方向的盈利趋势向好、发展前景良好、具有良好投资价值的行业进行重点配置；通过定性研究与定量研究相结合的方法，对上市公司的投资价值进行综合评估，精选具备较强竞争优势的上市公司作为投资标的；对于港股通标的股票，本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有相对优势的上市公司纳入本基金的股票投资组合，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。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，本基金将 A 股股票资产所对应的基准指数由中证 500 指数调整为沪深 300 指数，选取恒生指数作为港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。沪深 300 指数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。沪深 300 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。恒生指数以香港股票市场中市值最大及成交最活跃的香港上市公司股票为成份股样本，是反映香港股市价格走势最有影响的股价指数，适合作为本基金港股投资的业绩比较基准要素。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的 A 股股票的基准要素权重从 70%调整为 80%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 20%调整为 10%，港股部分的基准要素权重维持为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

10、东吴兴享成长混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证 500 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数(全价)收益

率×20%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债-综合全价(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同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用行业配置与个股选择相结合的策略，自上而下地进行行业遴选，根据宏观经济运行特征、经济景气周期以及行业周期轮动特征，从多个维度把握不同行业的景气度变化情况和发展趋势，精选符合盈利趋势向好、发展前景良好、具有良好投资价值的行业进行重点配置；通过定量和定性相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业的成长空间及基本面进行综合的研判，精选具有较高成长预期的优质成长型上市公司；对于港股通标的股票，本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有相对优势的上市公司纳入本基金的股票投资组合，从而在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。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 股股票资产所对应的基准指数由中证 500 指数调整为沪深 300 指数，选取恒生指数作为港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。沪深 300 指数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。沪深 300 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。恒生指数以香港股票市场中市值最大及成交最活跃的香港上市公司股票为成份股样本，是反映香港股市价格走势最有影响的股价指数，适合作为本基金港股投资的业绩比较基准要素。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准

要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从70%调整为80%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 20%调整为 10%，港股部分的基准要素权重维持为10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

11、东吴医疗服务股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证医疗指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数(全价)收益率×10%

调整后新业绩比较基准：

中证全指医药卫生指数收益率×80%+恒生医疗保健指数收益率×10%+中债-综合全价(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指数调整，不涉及基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向医疗服务主题相关证券，并运用“自上而下”的行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，精选出具有持续成长性、竞争优势、估值水平合理的优质个股，从而在严格控制风险的前提下，力争基金资产的持续稳健增值。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 A 股股票资产所对应的基准指数由中证医疗指数调整为中证全指医药卫生指数，将港股投资所对应的基准指数由恒生指数调整为恒生医疗保健指数。中证全指医药卫生指数从中证全指医药卫生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，以反映医药卫生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，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。恒生医疗保健指数反映在香港上市、主要经营医疗保健业务证券的整体表现，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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

本基金为股票型基金，A 股股票、港股、债券资产所对应的基准要素权重分别维持为 80%、10%、10%，调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

12、东吴阿尔法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×65%+中国债券综合全价指数×35%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(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，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产秉承价值型的投资理念，在个股精选的过程中将以寻找价值被低估的股票为基本原则，在分享股价合理回归的收益的同时力求达到投资组合较高的安全边际。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取沪深 300 指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。沪深 300 指数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。沪深 300 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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从65%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 35%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

13、东吴新趋势价值线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×65%+中国债券综合全价指数×35%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(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，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产秉承价值型的投资理念，在个股精选的过程中将以寻找价值被低估的股票为基本原则，在分享股价合理回归的收益的同时力求达到投资组合较高的安全边际，同时充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，精选新技术、新能源、新生活等新趋势主题相关领域的优质上市公司。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，本基金选取沪深 300 指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。沪深 300 指数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。沪深 300 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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从65%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 35%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

14、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：

中证医疗指数收益率×65%+中债综合全价(总值)指数收益率×35%

调整后新业绩比较基准：

中证全指医药卫生指数收益率×90%+中债-综合全价(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同时涉及基准指数、基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向智慧医疗主题相关公司，通过量化选股与择时相结合的方法，采用定性和定量的双重标准筛选智慧医疗主题股票池，并运用多因子模型精选优质上市公司，从而在控制风险的基础上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，将股票资产所对应的基准指数由中证医疗指数调整为中证全指医药卫生指数。中证全指医药卫生指数从中证全指医药卫生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，以反映医药卫生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，适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从65%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 35%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。

15、东吴配置优化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×50%+中国债券综合全价指数收益率×50%

调整后新业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合全价(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，不涉及基准指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产充分发挥基金管理人的研究优势，将积极主动的投资风格与严谨规范的选股方法相结合，综合运用“自上而下”和“自下而上”的投资方法进行行业配置和个股选择，在对宏观经济运行、行业景气变化以及上市公司成长潜力进行定量评估、定性分析和实地调研的基础上，优选重点行业中基本面状况健康、具有估值优势、成长性良好、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取沪深 300 指数作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。沪深 300 指数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。沪深 300 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。

综合考虑本基金对于债券资产的投资策略，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且上市流通的债券，反映境内人民币债券市场价格走势情况，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

根据过往仓位情况，将基准中的A股股票的基准要素权重从50%调整为90%，将基准中的债券资产的基准要素权重从 50%调整为 10%。调整后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产品的长期定位相匹配。

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。