

## 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 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	调整后的新业绩比较基准
1	华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%	中证 A500 指数收益率*80%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%
2	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金	标普中国 A 股 300 指数*70%+中证全债指数*30%	中证 800 指数收益率*85%+中证全债指数收益率*15%
3	华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金	中证 500 指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债综合指数收益率*20%	中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+中债-综合全价（总值）指数收益率*10%
4	华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*45%+恒生综合指数收益率*45%+上证国债指数收益率*10%	中证 800 指数收益率*30%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*60%+上证国债指数收益率*10%
5	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	沪深 300 指数*80%+上证国债指数*20%	中证 1000 指数收益率*90%+中债-综合财富（总值）指数收益率*10%
6	华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%	中证全指指数收益率*95%+中债-综合全价（总值）指数收益率*5%
7	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金	沪深 300 指数*60%+中债国债总指数*40%	国证 1000 成长指数收益率*85%+中债-国债总全价（总值）指数收益率*15%

8	华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金	中证医药卫生指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%	中证医药卫生指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%
9	华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金	中证医药卫生指数收益率*65%+中债综合指数收益率*35%	中证医药卫生指数收益率*60%+中证港股通医药卫生综合指数(人民币)收益率*20%+中债-综合全价(总值)指数收益率*20%
10	华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金	中证500指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+中债综合指数收益率*20%	中证内地低碳经济主题指数收益率*75%+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*10%
11	华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金	沪深300金融地产行业指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%	中证金融地产指数收益率*70%+中证港股通内地金融指数(人民币)收益率*20%+上证国债指数收益率*10%
12	华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%	中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+中证A500指数收益率*10%
13	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金	一年期银行定期存款利率(税后)+1%	中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证A500指数收益率*15%
14	华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%	中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证A500指数收益率*15%
15	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金	上证国债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%	中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+中证1000指数收益率*20%
16	华泰柏瑞鸿益30天滚动持有短债债券型证券投资基金	中债综合财富(1年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%	中债-综合财富(1年以下)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](http://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 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

本公司客户服务电话：400-888-0001、(021) 38784638

本公司网站：[www.huatai-pb.com](http://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6月27日

## 附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

### 1、华泰柏瑞富利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%+中债综合指数收益率\*50%

调整后新业绩比较基准：中证 A500 指数收益率\*80%+中债-综合全价（总值）指数收益率\*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 50%提高至 80%，债券资产所对应的要素权重相应由 50%调整至 20%。

本基金的股票资产采用全市场选股策略，根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。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 指数更换为更具代表性的中证 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。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数更适合作为本基金 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。

### 2、华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：标普中国 A 股 300 指数\*70%+中证全债指数\*30%

调整后新业绩比较基准：中证 800 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

调整后 A 股股票资产所对应的要素权重由 70%调整至 85%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 30%调整至 15%。本基金采用全市场选股的投资策略，可以投资于价格合理且具有良好增长趋势的企业。以合理估值为投资基础，以增长趋势的变化为投资契机，通过阶段性的投资回报累积，获得管理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标普中国 A 股 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。与原基准要素标普中国 A 股 300 指数相比，该指数样本量大，行业覆盖面广，与基金的投资风格等更匹配。

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。

### 3、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证 500 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数 (人民币) 收益率} \times 10\% + \text{中债综合指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通综合指数 (人民币) 收益率} \times 25\% + \text{中债-综合全价 (总值) 指数收益率} \times 10\%$

(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、港股通标的股票、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 65%，调整后的港股通标的股票资产所对应的要素权重由 10%调整至 25%，即股票资产所对应的要素权重由 80%提高至 90%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 10%。本基金采用全市场选股的投资策略，结合指标与基本面研究，选择质地优良的成长性公司，在合理控制组合风险及考虑流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，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中证 500 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。与原基准要素中证 500 指数相比，该指数样本量大，行业覆盖面广，与基金的投资风格等更匹配。

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、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金**

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 45\% + \text{恒生综合指数收益率} \times 45\% + \text{上证国债指数收益率} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 30\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 60\% + \text{上证国债指数收益率} \times 10\%$

(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。本基金主要投资于港股通标的股票、A 股股票、债券等资产，调整后的港股通标的股票资产所对应的要素权重由 45% 提高至 60%，A 股股票资产所对应的要素权重由 45% 降低至 30%，即调整后的股票资产和债券资产所对应的要素权重不变。

本基金的股票资产主要投向新经济主题相关证券，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 指数更换为更具代表性的中证 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。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数样本量大，行业覆盖面广，更适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。同时，本基金将港股通标的股票部分的基准要素由恒生综合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。

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。

## 5、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数} \times 80\% + \text{上证国债指数} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 1000 指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 10\%$

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金调整业绩比较基准的要素权重、更换基准要素，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 90%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20% 调整至 10%。

本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，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 1000 指数。中证 1000 指数选取中证 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。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数具有指数样本量大，行业覆盖面广等特征，与基金的投资风格等更匹配。

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-综合财富（总值）指数作为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、华泰柏瑞量化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： $\text{中证 800 指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证全指指数收益率} \times 95\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 5\%$

(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。

本基金利用定量投资模型, 在严格控制风险的前提下, 追求资产的长期增值, 力争实现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, 本基金将 A 股股票部分的基准要素由中证 800 指数更换为中证全指指数。中证全指指数由上海证券交易所、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。与原基准要素中证 800 指数相比, 该指数样本量大, 行业覆盖面广, 更适合作为本基金 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, 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, 将债券部分的基准要素从银行活期存款利率(税后)更换为中债-综合全价(总值)指数。

调整后的新要素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, 且新要素与基金合同定位相匹配。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、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 沪深 300 指数\*60%+中债国债总指数\*40%

调整后新业绩比较基准: 国证 1000 成长指数收益率\*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 60%调整至 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%。本基金主要投资于突出成长 A 类、高速稳定成长 B 类和高速周期成长 C 类股票。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, 以及指数风格界定、

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 指数更换为国证 1000 成长指数。国证 1000 成长指数由国证 1000 指数样本股中成长风格突出的证券组成，为投资者提供更丰富的指数化投资工具。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数样本量大，行业覆盖面广，与基金的投资风格等更匹配。

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风格界定。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。

#### **8、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金**

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 70\% + \text{上证国债指数收益率} \times 30\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 85\% + \text{上证国债指数收益率} \times 15\%$

(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、债券等资产，调整后的 A 股股票资产所对应的要素权重由 70% 提高至 85%，调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 30% 调整至 15%。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。

#### **9、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金**

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 65\% + \text{中债综合指数收益率} \times 35\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通医药卫生综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 20\%$

(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

该部分股票资产的基准要素并将其所对应的要素权重设置为 20%，A 股股票资产所对应的要素权重由 65%调整至 60%，即调整后的股票资产整体所对应的要素权重由 65%提高至 80%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 35%调整至 20%。本基金主要投资于医疗健康行业相关上市公司发行股票，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，本基金选取中证港股通医药卫生综合指数（人民币）作为港股通标的股票部分的基准要素。

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，且调整后的新要素与基金主题界定匹配。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、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金

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

调整后新业绩比较基准： $\text{中证内地低碳经济主题指数收益率} \times 75\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 15\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\%$

（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、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 60%提高至 75%，港股通标的股票资产所对应的要素权重由 20%降低至 15%，即调整后的股票资产整体所对应的要素权重由 80%提高至 90%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 10%。

本基金的股票资产主要投向低碳经济相关行业证券，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 500 指数更换为更具代表性的中证内地低碳经济主题指数。中证内地低碳经济主题指数由清洁能源发电、能源转换及存储、清洁生产及消费与废物处理等公司组成，以反映低碳经济主题上市公司证券的整体表

现。与原基准要素中证 500 指数相比，更适合作为本基金 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、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 金融地产行业指数收益率} \times 80\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证金融地产指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通内地金融指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{上证国债指数收益率} \times 10\%$

(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、增加表征港股通标的股票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 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 80%降低至 70%，调整后的业绩比较基准中增加了表征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 20%，即调整后的股票资产整体所对应的要素权重由 80%提高至 90%；调整后的债券资产所对应的要素权重相应由 20%调整至 10%。

本基金的股票资产主要投资于新金融地产概念相关证券，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 金融地产行业指数更换为更具代表性的中证金融地产指数。中证金融地产指数选取中证 800 指数样本中属于金融和房地产行业的上市公司证券作为指数样本，以反映中证 800 指数样本中金融和房地产上市公司证券的整体表现。与原基准要素沪深 300 金融地产行业指数相比，该指数更适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。同时，由于本基金可投资于港股通标的股票，相应设置港股通标的股票部分的基准要素为中证港股通内地金融指数（人民币），能够反映本基金通过港股通投资于香港市场上金融地产行业相关企业的投资特征。

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、华泰柏瑞享利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%+中债综合指数收益率\*50%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率\*90%+中证 A500 指数收益率\*10%

(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 股股票等资产。基于本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将债券资产所对应的要素权重由 50%调整至 90%，A 股股票资产所对应的要素权重相应由 50%调整至 10%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手。根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。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。与原基准要素沪深 300 指数相比，该指数更适合作为本基金 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、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：一年期银行定期存款利率(税后)+1%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率\*85%+中证 A500 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股票资产部分的基准要素，更换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。本基金主要投资于债券、A 股股票等资产，原业绩比较基准不能充分反映基金所投资主要资产类别的市场表现，调整后的债券资产所对应的要素权重设定为 85%，A 股股票资产所对应的要素权重设定为 15%。本基金的债券资产采用久期控制下的资产类属配置策略，并将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择；本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，根据个股的估值水平优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。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，选取中证 A500 指数作为 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。

#### 14、华泰柏瑞鼎利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%+中债综合指数收益率\*50%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率\*85%+中证 A500 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。本基金主要投资于债券、A 股股票等资产，调整后债券资产所对应的要素权重由 50%调整至 85%，调整后的 A 股股票资产所对

应的要素权重相应由 50%调整至 15%。本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，结合宏观经济走势及市场分析，根据市场估值与流动性优选个股，重点配置当前业绩优良、市场认同度较高、在可预见的未来其行业处于景气周期中的股票。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，反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现，该指数具有市值覆盖大中盘结合、行业分布相对更均衡等特征，与基金的投资风格较匹配。

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。

## 15、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{上证国债指数收益率} \times 80\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 15\% + \text{中证港股通综合指数(人民币)收益率} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合财富(总值)指数收益率} \times 80\% + \text{中证 1000 指数收益率} \times 20\%$

(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 股股票等资产，相应更换债券部分的基准要素、更换 A 股股票部分的基准要素、删除港股通标的股票部分的基准要素。调整后 A 股股票资产所对应的要素权重由 15%调整至 20%，调整后的债券资产所对应的要素权重保持 80%不变。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，选取中债-综合财富（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素，中债-综合财富（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。本基金 A 股投资主要采用“自下而上”的深度基本面研究策略，并从多个方面（主营业务、商业模式、财务状况、治理结构、所处行业、公司估值）进行深度研究从而精选个股。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，选取中证 1000 指数作为 A 股股票部分的基准要素，中证 1000 指数选取中证 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。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。

## 16、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中债综合财富(1 年以下)指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%

调整后新业绩比较基准：中债-综合财富（1 年以下）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。

本基金本次业绩比较基准调整，主要将债券资产对应要素权重由 80%调整至 95%，同时将一年期定期存款利率(税后)调整为活期存款基准利率并将权重由 20%调整为 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，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。