南方基金管理股份有限公司
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,南方基金管理股份有限公司(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	南方新能源产业趋势混合型证券投资基金	中证新能源指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+恒生工业行业指数(人民币)收益率×10%	中证新能源指数收益率×80%+国证港股通新能源指数(人民币)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
2	南方蓝筹成长混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	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(1-3年)指数收益率×10%
3	南方智诚混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300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(1-3年)指数收益率×10%
4	南方瑞祥一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300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(1-3年)指数收益率×10%
5	南方智锐混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×20%
6	南方人工智能主题混合型证券投资基金	中证人工智能主题指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数×10%	中证人工智能主题指数收益率×70%+中证港股通TMT主题指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×15%
7	南方优质企业混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	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(1-3年)指数收益率×10%
8	南方瑞盛三年持有期混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
9	南方高质量优选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×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	沪深300指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
10	南方景气驱动混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	中证800指数收益率×65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×15%
11	南方科技创新混合型证券投资基金	中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%	中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中证港股通科技指数(港元)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
12	南方优势产业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300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(1-3年)指数收益率×10%
13	南方信息创新混合型证券投资基金	中证信息技术指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%	中证信息技术指数收益率×80%+中证港股通TMT主题指数(人民币)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
14	南方产业优势两年持有期混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
15	南方科创板3年定期开放混合型证券投资基金	上证科创板50成份指数收益率×65%+中债总指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%	上证科创板50成份指数收益率×85%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
16	南方核心成长混合型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	中证新兴产业指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
17	南方行业领先混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
18	南方港股通优势企业混合型证券投资基金	经人民币汇率调整的恒生综合指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证800指数收益率×10%	恒生综合指数收益率×80%+中证800指数收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
19	南方均衡成长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×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	沪深300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(1-3年)指数收益率×10%
20	南方行业精选一年持有期混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
21	南方卓越优选3个月持有期混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%	中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%
22	南方发展机遇一年持有期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×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%	沪深300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(1-3年)指数收益率×10%
23	南方悦享稳健添利债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(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%
24	南方津享稳健添利债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(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%
25	南方泽享稳健添利债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(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%
26	南方振元债券型发起式证券投资基金	沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%+中债综合指数收益率×90%	中债-信用债总全价(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%
27	南方通元6个月持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(总值)指数收益率×90%+中证800指数收益率×7%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×3%
28	南方尊享稳健增利债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(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%
29	南方晖元6个月持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(总值)指数收益率×95%+中证800指数收益率×5%
30	南方稳鑫6个月持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×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%	中债-信用债总全价(总值)指数收益率×95%+中证800指数收益率×5%
31	南方佳元6个月持有期债券型证券投资基金	中债新综合财富指数收益率×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%	中债-综合财富(1-3年)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%
32	南方永元一年持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-综合全价(总值)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%
33	南方达元债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%	中债-信用债总全价(总值)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×6%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×4%
34	南方宝元债券型基金	交易所国债指数×75%+(上证A股指数+深证A股指数)×25%	中债-信用债总财富(总值)指数收益率×55%+中债-国债及政策性银行债财富(总值)指数收益率×20%+沪深300指数收益率×25%
35	南方亚洲美元收益债券型证券投资基金	美元一年银行定期存款利率(税后)+2%	彭博亚洲美元投资级债券指数(Bloomberg Asia USD Investment Grade Bond Index)收益率×95%+人民币活期存款基准利率×5%
36	南方浩鑫稳健优选6个月持有期混合型基金中基金(FOF)	中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%	中证偏股型基金指数收益率×5%+中证债券型基金指数收益率×95%

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、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.nffund.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—889—8899

网址:www.nffund.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。

南方基金管理股份有限公司
2026年6月27日

附:业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、南方新能源产业趋势混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证新能源指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+恒生工业行业指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:中证新能源指数收益率×80%+国证港股通新能源指数(人民币)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

结合本基金的投资范围和投资策略,本基金重点投资于本基金定义的"新能源"范畴的上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。原业绩比较基准中,恒生工业行业指数(人民币)反映工业行业相关上市公司在香港股票市场的表现。调整后的新业绩比较基准中,国证港股通新能源指数(人民币)(指数代码987027)选取在香港交易所上市、具备互联互通标的资格并且公司业务涉及新能源和新能源整车相关领域同时公司不属于公用事业行业的股票作为选择空间,旨在反映港股通范围内新能源领域相关上市公司的运行特征,能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金港股通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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为80%和10%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

2、南方蓝筹成长混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准: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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

3、南方智诚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%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

4、南方瑞祥一年定期开放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%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

5、南方智锐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%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至80%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为60%和20%),降低债券部分要素权重至20%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

6、南方人工智能主题混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证人工智能主题指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数×10%

调整后新业绩比较基准:中证人工智能主题指数收益率×70%+中证港股通TMT主题指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×15%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

结合本基金的投资范围和投资策略,本基金主要投向"人工智能"主题证券,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。原业绩比较基准中,中证港股通综合指数选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本,反映港股通范围内上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,中证港股通TMT主题指数(人民币)(指数代码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,能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金港股通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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中A股股票部分权重至70%,港股通股票部分权重至15%,降低债券部分要素权重至15%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

7、南方优质企业混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准: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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

8、南方瑞盛三年持有期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%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为75%和15%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

9、南方高质量优选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×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为80%和10%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

10、南方景气驱动混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:中证800指数收益率×65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。中债综合指数(指数代码CBA00203)隶属于中债总指数族分类,该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的债券,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中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至85%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为65%和20%),降低债券部分要素权重至15%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

11、南方科技创新混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%

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×80%+中证港股通科技指数(港元)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

结合本基金的投资范围和投资策略,本基金的股票资产主要投向本基金定义的"科技创新"范畴内的证券,紧密跟踪中国科技创新产业的发展方向,争取抓住科技创新成长周期,努力挖掘质地优秀、具备长期价值增长潜力的上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。原业绩比较基准中,中证港股通综合指数选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本,反映港股通范围内上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,中证港股通科技指数(港元)(指数代码931573)从港股通范围内选取市值较大、研发投入较高且营收增速较好的科技龙头上市公司证券作为样本,反映港股通内科技龙头上市公司证券的整体表现,能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金港股通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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为80%和10%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

12、南方优势产业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

(1)当前业绩比较基准:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

13、南方信息创新混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证信息技术指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%

调整后新业绩比较基准:中证信息技术指数收益率×80%+中证港股通TMT主题指数(人民币)收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率×10%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

结合本基金的投资范围和投资策略,本基金的股票资产主要投向本基金定义的"信息创新"范畴内的证券,紧密跟踪中国信息科技产业的发展方向,争取抓住科技创新成长周期,努力挖掘质地优秀、具备长期价值增长潜力的上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。原业绩比较基准中,中证港股通综合指数选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本,反映港股通范围内上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,中证港股通TMT主题指数(人民币)(指数代码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,能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金港股通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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为80%和10%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

14、南方产业优势两年持有期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%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为75%和15%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

15、南方科创板3年定期开放混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:上证科创板50成份指数收益率×65%+中债总指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%

调整后新业绩比较基准:上证科创板50成份指数收益率×85%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。中债总指数隶属于中债总指数族,该指数成分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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股股票部分的权重分别为85%和5%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

16、南方核心成长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×50%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)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×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为75%和15%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

17、南方行业领先混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证800指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。中债总指数隶属于中债总指数族,该指数成分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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于过往仓位情况、基金投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为75%和15%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

18、南方港股通优势企业混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:经人民币汇率调整的恒生综合指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证800指数收益率×10%

调整后新业绩比较基准:恒生综合指数收益率×80%+中证800指数收益率×10%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。上证国债指数(指数代码000012)样本券由在上海证券交易所上市的固定利率国债组成。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中港股通股票部分和A股股票部分的权重分别为80%和10%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

19、南方均衡成长混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:沪深300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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。上证国债指数(指数代码000012)样本券由在上海证券交易所上市的固定利率国债组成。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别调整为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

20、南方行业精选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800指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。中债总指数隶属于中债总指数族,该指数成分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。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为75%和15%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

21、南方卓越优选3个月持有期混合型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中证800指数收益率×60%+上证国债指数收益率×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%

调整后新业绩比较基准:中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债-综合财富(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。上证国债指数(指数代码000012)样本券由在上海证券交易所上市的固定利率国债组成。调整后的新业绩比较基准中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别为75%和15%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

22、南方发展机遇一年持有期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×30%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%

调整后新业绩比较基准:沪深300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(1-3年)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,过往组合久期整体偏向于中短久期。中债综合指数隶属于中债总指数族分类,该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的债券,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中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素,同时调整债券部分要素权重至10%。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制,以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中股票部分权重至90%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别调整为70%和20%),降低债券部分要素权重至10%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

23、南方悦享稳健添利债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(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及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

24、南方津享稳健添利债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(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及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

25、南方泽享稳健添利债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(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及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

26、南方振元债券型发起式证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%+中债综合指数收益率×90%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(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及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

27、南方通元6个月持有期债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(总值)指数收益率×90%+中证800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及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

原业绩比较基准中的股票指数为沪深300指数(指数代码000300),成份股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,反映沪深市场大盘上市公司证券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,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只股票构成,反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现,调整后的中证800指数与基金实际持股风格更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

28、南方尊享稳健增利债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(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及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

29、南方晖元6个月持有期债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(总值)指数收益率×95%+中证800指数收益率×5%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

原业绩比较基准中的股票指数为沪深300指数(指数代码000300)和中证港股通综合指数(人民币)(指数代码为930933),沪深300指数成份股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,反映沪深市场大盘上市公司证券的整体表现;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,反映港股通范围内上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,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只股票构成,反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现,调整后的中证800指数与基金实际持股风格更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中债券部分权重至95%,降低股票部分要素权重至5%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

30、南方稳鑫6个月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:中债-信用债总全价(总值)指数收益率×95%+中证800指数收益率×5%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

原业绩比较基准中的股票指数为沪深300指数(指数代码000300)和中证港股通综合指数(人民币)(指数代码为930933),沪深300指数成份股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,反映沪深市场大盘上市公司证券的整体表现;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,反映港股通范围内上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,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只股票构成,反映沪深市场大中盘上市公司证券的整体表现,调整后的中证800指数与基金实际持股风格更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中债券部分权重至95%,降低股票部分要素权重至5%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

31、南方佳元6个月持有期债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债新综合财富指数收益率×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:中债-综合财富(1-3年)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及合理性:

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,过往组合久期整体偏向于中短久期。中债新综合财富指数(指数代码CBA00101)成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券,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中,中债-综合财富(1-3年)指数(指数代码CBA00221)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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为7%与3%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

32、南方永元一年持有期债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-综合全价(总值)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%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

基于基金过往仓位情况、投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准中债券部分权重至85%,提高股票部分要素权重至15%(其中A股股票部分和港股通股票部分的权重分别调整为12%和3%)。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

33、南方达元债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7.5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2.5%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总全价(总值)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×6%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×4%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

根据过往债券配置情况,本基金主要投资于信用债券,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,将债券指数调整为中债-信用债总全价(总值)指数。原业绩比较基准中,中债综合指数样本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,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中,中债-信用债总全价(总值)指数(指数代码CBA02703)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。因此调整后的中债-信用债总全价(总值)指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,调整业绩比较基准要素的权重,将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别调整为6%与4%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

34、南方宝元债券型基金

(1)当前业绩比较基准:交易所国债指数×75%+(上证A股指数+深证A股指数)×25%

调整后新业绩比较基准:中债-信用债总财富(总值)指数收益率×55%+中债-国债及政策性银行债财富(总值)指数收益率×20%+沪深300指数收益率×25%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

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。

原业绩比较基准的债券部分为交易所国债指数(指数代码CBA01001),隶属于中债总指数族,该指数成分券由在境内公开发行且在交易所上市流通的记账式国债组成,是一个反映境内交易所记账式国债整体价格走势情况的分类指数。调整后本基金分别设置中债-信用债总财富(总值)指数和中债-国债及政策性银行债财富(总值)指数用于表征本基金债券部分的投资表现。中债-信用债总财富(总值)指数(指数代码CBA02701)成份券由信用类债券组成,是一个反映境内信用类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。中债-国债及政策性银行债财富(总值)指数(指数代码CBA05801)属于中债总指数族,该指数成分券由在全国银行间债券市场上市且公开发行的国债和政策性银行债组成,可作为投资该类债券的业绩基准和标的指数。同时基于本基金的投资策略,将中债-信用债总财富(总值)指数和中债-国债及政策性银行债财富(总值)指数分别设置55%和20%的权重。

同时,基于本基金的投资风格,将权益类资产部分基准要素由上证A股指数+深证A股指数调整为沪深300指数。原业绩比较基准中,上证A股指数(指数代码000002)由上海证券交易所上市的符合条件的A股组成样本股,反映上海市场A股的股价整体表现;深证A股指数(指数代码399107)由深圳证券交易所主板、创业板上市的全部A股股票组成,反映深交所上市A股价格的综合变动情况以及市场总体走势。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金权益类资产部分的业绩比较基准要素。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

35、南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

(1)当前业绩比较基准:美元一年银行定期存款利率(税后)+2%

调整后新业绩比较基准:彭博亚洲美元投资级债券指数(Bloomberg Asia USD Investment Grade Bond Index)收益率×95%+人民币活期存款基准利率×5%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

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。原业绩比较基准为美元一年银行定期存款利率(税后)+2%。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金主要投资于亚洲市场美元债券,通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面,寻找各类债券的投资机会,在谨慎前提下力争实现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,以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等,选取彭博亚洲美元投资级债券指数(Bloomberg Asia USD Investment Grade Bond Index)作为债券部分的业绩比较基准要素。彭博亚洲美元投资级债券指数(Bloomberg Asia USD Investment Grade Bond Index)是彭博固定收益指数体系(Bloomberg Fixed Income Indices)中的重要基准之一,主要追踪亚洲(除日本外)发行人发行的、以美元计价的投资级固定收益证券的市场表现,指数成分券广泛涵盖了主权债券、准主权债券以及金融和非金融企业债券。该指数具备较强的市场代表性、客观性和较高的透明度,能够公允地反映亚洲美元投资级信用债市场的整体收益水平与风险特征,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时,基于基金投资比例限制以及预期的资产配置比例中枢,业绩比较基准中债券部分的权重设置为95%,同时选取人民币活期存款基准利率作为现金资产部分的业绩比较基准要素并将权重设置为5%。

因此调整后的业绩比较基准能够更好匹配本基金的产品定位和投资风格,提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。

36、南方浩鑫稳健优选6个月持有期混合型基金中基金(FOF)

(1)当前业绩比较基准:中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%

调整后新业绩比较基准:中证偏股型基金指数收益率×5%+中证债券型基金指数收益率×95%

(2)新的业绩比较基准选择原因及合理性:

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金将依托资产配置策略,适度配置固定收益类基金和权益类基金。综合考虑基准指数与产品定位、投资策略的匹配度,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等,本基金的权益类资产部分所对应的基准指数从沪深300指数和中证港股通综合指数(人民币)调整为中证偏股型基金指数,固收类资产部分所对应的基准指数从中证全债指数调整为中证债券型基金指数。

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。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,反映港股通范围内上市公司的整体表现。中证全债指数选取在沪深交易所或银行间市场上市的BBB及以上、且剩余期限1年及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券,反映全市场相应期限债券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中,中证偏股型基金指数(指数代码930950)选取内地上市的所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本,采用净值规模加权,以反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势,更适合作为本基金权益类资产部分的业绩比较基准要素;中证债券型基金指数(指数代码H11023)样本由中证开放式基金指数样本中的债券型基金组成,以反映内地债券型基金的整体走势,更适合作为本基金固定收益类资产部分的业绩比较基准要素。

基于本基金的投资目标、投资范围和投资策略,并结合组合过往投资情况,将固定收益类资产和权益类资产所对应的基准要素权重分别设置为95%与5%。

调整后的业绩比较基准要素与基金的投资目标和投资策略相匹配,能够更好地反映本基金的产品定位。