鹏华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,鹏华基金管理有限公司(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	鹏华汇智优选混合型证券投资基金	中证800指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*30%+恒生指数收益率*20%(经汇率估值调整)	中证800相对成长指数收益率*70%+恒生指数收益率*20%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
2	鹏华弘裕一年持有期混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)	中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+中证800指数收益率*17%+恒生指数收益率*3%
3	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%(经汇率估值调整)	中证A500指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
4	鹏华弘和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)+3%	中证800指数收益率*75%+中债-综合全价(总值)指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
5	鹏华研究驱动混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*40%+恒生指数收益率(经汇率调整后)*40%+中证综合债指数收益率*20%	中证800指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*15%
6	鹏华量化先锋混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%	中证全指指数收益率*90%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
7	鹏华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-综合财富(1-3年)指数收益率*84%+沪深300指数收益率*8%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%+活期存款基准利率*5%
8	鹏华宁华一年持有期混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)	中债-综合财富(总值)指数收益率*90%+中证A500指数收益率*10%
9	鹏华安享一年持有期混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)	中债-综合财富(总值)指数收益率*85%+中证800指数收益率*12%+恒生指数收益率*3%
10	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*55%+中证综合债指数收益率*45%	沪深300指数收益率*80%+中债-综合财富(总值)指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
11	鹏华弘润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)+3%	中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
12	鹏华先进制造股票型证券投资基金	中证装备产业指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证中游制造产业指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
13	鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证A500指数收益率*85%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*15%
14	鹏华远见成长混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%(经汇率估值调整)	中证A500指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
15	鹏华产业升级混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%(经汇率估值调整)	中证A500指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
16	鹏华优质回报两年定期开放混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*60%+恒生指数收益率(经汇率调整后)*20%+中证综合债指数收益率*20%	中证A500指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
17	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*60%+中证综合债指数收益率*40%	中证A500指数收益率*80%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
18	鹏华消费优选混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	申银万国消费品指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
19	鹏华价值精选股票型证券投资基金	沪深300指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10%	中证A500指数收益率*85%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*15%
20	鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)	沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%	中证A500指数收益率*75%+中债-综合财富(总值)指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%
21	鹏华弘益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)+3%	中证800价值指数收益率*80%+中债-综合全价(总值)指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%
22	鹏华弘华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)+3%	中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+中证800指数收益率*10%
23	鹏华稳健鸿利一年持有期混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*60%+中证综合债指数收益率*30%+恒生指数收益率(经汇率调整)*10%	沪深300指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+中证综合债指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
24	鹏华优势企业股票型证券投资基金	沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证800指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
25	鹏华科技驱动混合型发起式证券投资基金	中证科技100指数收益率*70%+中债综合财富(总值)指数收益率*20%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)*10%	中证科技100指数收益率*80%+恒生科技指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%
26	鹏华安荣混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*25%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)	中债-新综合财富(总值)指数收益率*85%+中证红利指数收益率*12%+中证港股通高股息投资指数(人民币)收益率*3%
27	鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*50%+沪深300指数收益率*50%	中债-综合财富(总值)指数收益率*90%+中信成长风格指数收益率*10%
28	鹏华弘实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)+3%	中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
29	鹏华安颐混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)	中债-综合财富(总值)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%
30	鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%	中债-综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
31	鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金	中证综合债指数收益率*50%+沪深300指数收益率*50%	中证A500指数收益率*85%+中债-综合财富(1-3年)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
32	鹏华丰盈债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
33	鹏华丰玉债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-0-5年债券综合财富(总值)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
34	鹏华永平6个月定期开放债券型证券投资基金	中证综合债指数收益率*100%	中债-0-5年债券综合财富(总值)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
35	鹏华丰华债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
36	鹏华双季红180天持有期债券型证券投资基金	中证综合债指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
37	鹏华尊悦3个月定期开放债券型发起式证券投资基金	中债综合指数收益率	中债-0-3年债券综合财富(总值)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
38	鹏华丰康债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
39	鹏华尊和一年定期开放债券型发起式证券投资基金	中证综合债指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*10%	中债-0-5年债券综合财富(总值)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
40	鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
41	鹏华尊晟3个月定期开放债券型发起式证券投资基金	中证综合债指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
42	鹏华产业债债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-高等级信用债综合指数(0-3年)财富指数收益率*83%+中证可转换债券指数收益率*12%+活期存款基准利率*5%
43	鹏华丰收债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*5%+沪深300指数收益率*10%
44	鹏华可转债债券型证券投资基金	中证可转换债券指数收益率*60%+中债总指数收益率*30%+沪深300指数收益率*10%	中证可转债及可交换债券指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
45	鹏华双债加利债券型证券投资基金	三年期银行定期存款利率(税后)+2%	中债-综合全价(1-3年)指数收益率*75%+中证可转债及可交换债券指数收益率*10%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
46	鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*85%+中证可转债及可交换债券指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
47	鹏华信用增利债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-高等级信用债综合指数(0-3年)财富指数收益率*85%+中证可转债及可交换债券指数收益率*5%+沪深300指数收益率*10%
48	鹏华丰享债券型证券投资基金	中债总指数收益率	中债-综合财富(3-5年)指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
49	鹏华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-综合财富(1-3年)指数收益率*89%+沪深300指数收益率*8%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%
50	鹏华丰锐债券型证券投资基金(LOF)	中债总指数收益率	中债-综合财富(1-3年)指数收益率*83%+中证800指数收益率*12%+活期存款基准利率*5%
51	鹏华稳健恒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-综合财富(1-3年)指数收益率*80%+中证800价值指数收益率*10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%+活期存款基准利率*5%
52	鹏华易选积极3个月持有期混合型基金中基金(FOF)	中证800指数收益率×70%+中债新综合财富指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%(经汇率估值调整)	中证A500指数收益率*63%+恒生指数收益率*7%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*25%+上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约价格收益率*5%
53	鹏华易诚积极3个月持有期混合型基金中基金(FOF)	中证800指数收益率×65%+中债新综合财富指数收益率×25%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×10%	中证A500指数收益率*68%+恒生指数收益率*7%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*25%
54	鹏华易选稳健3个月持有期混合型基金中基金(FOF)	中债新综合全价(总值)指数收益率*70%+中证A500指数收益率*18%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)*2%+上海黄金交易所Au9999现货实盘合约收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%	中债-新综合全价(总值)指数收益率*75%+中证A500指数收益率*15%+上海黄金交易所Au99.99现货实盘合约价格收益率*5%+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》。此外,本次调整根据相关法律法规的要求对基准要素名称进行规范表述。

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。基金管理人将一并更新基金管理人和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、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.phfund.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、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:400-6788-533

网址:www.phfund.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。

鹏华基金管理有限公司

2026年6月27日

附:业绩比较基准调整原因及合理性说明

业绩比较基准调整原因及合理性说明

一、鹏华汇智优选混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:中证800指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*30%+恒生指数收益率*20%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中证800相对成长指数收益率*70%+恒生指数收益率*20%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*5%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从70%提高到90%,其中,将股票资产中的A股资产的基准要素权重从50%提高到70%,港股资产的基准要素权重维持20%不变;将基准中的债券资产的基准要素权重从30%降低到5%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由中证800指数调整为中证800相对成长指数。调整后的新业绩比较基准中,中证800相对成长指数综合考察中证800指数样本的价值和成长特征,选取成长风格较为突出的证券为样本,并采用经综合成长概率调整后的自由流通市值加权,以反映中证800指数中具有成长风格特征证券的整体表现,为市场提供更具多元化风险收益特征的投资标的,适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数,中债-新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

二、鹏华弘裕一年持有期混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+中证800指数收益率*17%+恒生指数收益率*3%

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指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:基准中债券资产的基准要素权重维持80%不变,股票资产的基准要素权重维持20%不变。其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从15%提高到17%,港股股票的基准要素权重从5%降低到3%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)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,反映境内人民币债券市场整体表现,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证800指数。调整后的新业绩比较基准中,中证800指数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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

三、鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中债-新综合财富(总值)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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%,其中,将股票资产中的A股资产的基准要素权重从70%提高到75%,港股资产的基准要素权重维持10%不变;将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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的上市公司证券的整体表现。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。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数。中债-新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

四、鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:一年期银行定期存款利率(税后)+3%

调整后的新业绩比较基准:中证800指数收益率*75%+中债-综合全价(总值)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、差异及影响:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重设置为75%,将基准中的债券资产的基准要素权重设置为20%,现金类资产的基准要素权重设置为5%,更符合基金所投资的主要资产类别、过往投资运作情况及产品的中长期定位。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数设置为中证800指数。调整后的新业绩比较基准中,中证800指数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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数设置为中债-综合全价(总值)指数。中债-综合全价(总值)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,反映境内人民币债券市场整体表现,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

五、鹏华研究驱动混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*40%+恒生指数收益率(经汇率调整后)*40%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准:中证800指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中债-新综合财富(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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%,其中,将股票资产中的A股资产的基准要素权重从40%提高到75%,港股资产的基准要素权重从40%降低到10%;将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到15%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证800指数。调整后的新业绩比较基准中,中证800指数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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数。中债-新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

六、鹏华量化先锋混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准:中证全指指数收益率*90%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%,将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证全指指数。调整后的新业绩比较基准中,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,适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证全债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

七、鹏华稳健添利债券型证券投资基金

1、原业绩比较基准: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%

调整后的新业绩比较基准:中债-综合财富(1-3年)指数收益率*84%+沪深300指数收益率*8%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的债券资产的基准要素权重从90%降低到84%,将基准中的股票资产的基准要素权重从10%提高到11%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%。其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从7.5%提高到8%,港股股票的基准要素权重从2.5%提高到3%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在债券指数的选取方面,结合基金过往实际运作,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,将债券部分的指数由中债综合指数调整为中债-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,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

八、鹏华宁华一年持有期混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中债-综合财富(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、差异及影响:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的债券资产的基准要素权重从80%提高到90%,将基准中的股票资产的基准要素权重从20%降低到10%。其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从15%降低到10%,港股股票的基准要素权重从5%降低到0%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)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,反映境内人民币债券市场整体表现,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

九、鹏华安享一年持有期混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中债-综合财富(总值)指数收益率*85%+中证800指数收益率*12%+恒生指数收益率*3%

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指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的债券资产的基准要素权重从80%提高到85%,将基准中的股票资产的基准要素权重从20%降低到15%。其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从15%降低到12%,港股股票的基准要素权重从5%降低到3%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)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,反映境内人民币债券市场整体表现,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质公司,构建股票投资组合。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,将股票部分的指数由沪深300指数调整为中证800指数。中证800指数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。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。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十、鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*55%+中证综合债指数收益率*45%

调整后的新业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+中债-综合财富(总值)指数收益率*15%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从55%提高到80%,将基准中的债券资产的基准要素权重从45%降低到15%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别、过往投资运作情况及产品的中长期定位。

(2)更换业绩比较基准要素:在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十一、鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:一年期银行定期存款利率(税后)+3%

调整后的新业绩比较基准:中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的债券资产的基准要素权重设置为85%,将基准中的股票资产的基准要素权重设置为10%,现金类资产的基准要素权重设置为5%,更符合基金所投资的主要资产类别、过往投资运作情况及产品的中长期定位。

(2)更换业绩比较基准要素:在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数设置为中债-综合全价(总值)指数。中债-综合全价(总值)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,反映境内人民币债券市场整体表现,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数设置为沪深300指数。调整后的新业绩比较基准中,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,反映沪深市场大盘上市公司证券的整体表现,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十二、鹏华先进制造股票型证券投资基金

1、原业绩比较基准:中证装备产业指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准:中证中游制造产业指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*5%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%,将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金在有效控制风险前提下,精选优质的先进制造业上市公司,力求超额收益与长期资本增值,综合考虑基准指数与产品定位、投资风格和主题库的匹配度,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由中证装备产业指数调整为中证中游制造产业指数。调整后的新业绩比较基准中,中证中游制造产业指数从中证800指数样本中选择化学制品、钢铁、机械制造、通信设备等行业作为指数样本股,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十三、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*85%+中债-新综合财富(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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%,将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到15%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金对个股逐一进行梳理和筛选,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,自下而上精选个股。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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数。中债-新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十四、鹏华远见成长混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%,其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从70%提高到80%,港股股票的基准要素权重维持10%不变;将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:

在股票指数的选取方面,本基金的股票资产采用全市场选股策略,通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司,构建股票投资组合。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,将股票部分的指数由沪深300指数调整为中证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的上市公司证券的整体表现。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。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十五、鹏华产业升级混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%(经汇率估值调整)

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*80%+恒生指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)指数收益率*5%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到90%,其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从70%提高到80%,港股股票的基准要素权重维持10%不变,将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到5%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,构建股票投资组合,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十六、鹏华优质回报两年定期开放混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+恒生指数收益率(经汇率调整后)*20%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*75%+恒生指数收益率*10%+中债-综合财富(总值)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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%,其中,将股票资产中的A股股票的基准要素权重从60%提高到75%,港股股票的基准要素权重从20%降低到10%,将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十七、鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证综合债指数收益率*40%

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*80%+中债-新综合财富(总值)指数收益率*15%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从60%提高到80%,将基准中的债券资产的基准要素权重从40%降低到15%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别、过往投资运作情况及产品的中长期定位。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数。中债-新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十八、鹏华消费优选混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后的新业绩比较基准:申银万国消费品指数收益率*85%+中证综合债指数收益率*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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从80%提高到85%,将基准中的债券资产的基准要素权重从20%降低到10%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金致力于挖掘大消费类行业中的优质上市公司,通过对宏观经济、行业竞争格局、企业竞争优势等进行综合分析、评估,精选具有良好基本面及估值优势的大消费类上市公司构建股票投资组合,综合考虑基准指数与产品定位、投资风格和主题库的匹配度,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为申银万国消费品指数。调整后的新业绩比较基准中,申银万国消费品指数是申银万国股价系列指数旗下一只主题指数,基于申万行业分类标准编制,用以表征消费品上市公司整体股价表现,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

十九、鹏华价值精选股票型证券投资基金

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10%

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*85%+中债-新综合财富(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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的A股股票资产的基准要素权重从90%降低到85%,将基准中的债券资产的基准要素权重从10%提高到15%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,本基金采用全市场选股策略,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-新综合财富(总值)指数。中债-新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

二十、鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)

1、原业绩比较基准:沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%

调整后的新业绩比较基准:中证A500指数收益率*75%+中债-综合财富(总值)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、差异及影响:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重从70%提高到75%,将基准中的债券资产的基准要素权重从30%降低到20%,现金类资产的基准要素权重从0%提高到5%,更符合基金所投资的主要资产类别及过往投资运作情况。

(2)更换业绩比较基准要素:在股票指数的选取方面,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,将股票资产中的A股股票部分的指数由沪深300指数调整为中证A500指数。调整后的新业绩比较基准中,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,更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数由中证综合债指数调整为中债-综合财富(总值)指数。中债-综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族,该指数成分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,是中债指数应用最广泛指数之一,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

二十一、鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:一年期银行定期存款利率(税后)+3%

调整后的新业绩比较基准:中证800价值指数收益率*80%+中债-综合全价(总值)指数收益率*15%+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:

本基金业绩比较基准调整涉及基准指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的股票资产的基准要素权重设置为80%,将基准中的债券资产的基准要素权重设置为15%,现金类资产的基准要素权重设置为5%,更符合基金所投资的主要资产类别、过往投资运作情况及产品的中长期定位。

(2)更换业绩比较基准要素:基于基金投资目标、投资范围和投资策略,本基金的股票资产将通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质公司,构建股票投资组合,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,将股票资产中的A股股票部分的指数设置为中证800价值指数。调整后的新业绩比较基准中,中证800价值指数从中证800指数样本中,选取价值因子得分最高的250只证券作为指数样本,反映中证800指数样本中具有价值特征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。

在债券指数的选取方面,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,将债券部分的指数设置为中债-综合全价(总值)指数。中债-综合全价(总值)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,反映境内人民币债券市场整体表现,更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于以上情况,本次调整业绩比较基准旨在提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性,更加清晰反映基金的风险收益特征,不会对产品投资运作、持有人利益产生实质性不利影响。

二十二、鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金

1、原业绩比较基准:一年期银行定期存款利率(税后)+3%

调整后的新业绩比较基准:中债-综合全价(总值)指数收益率*90%+中证800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指数、基准要素权重调整。

(1)调整业绩比较基准的要素权重:将基准中的债券资产的基准要素权重设置90%,将基准中的股票资产的基准要素权重设置10%,更符合基金所投资的主要资产类别、过往投资运作情况及产品的中长期定位。

(下转C99版)