

(上接C221版)

16、银华多策略灵活配置混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金股票资产采用多元化的配置策略,积极优选全市场的投资机会,整体性布局于具有核心竞争力及比较优势的行业和公司,同时追求超越业绩比较基准的投资回报,力求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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金将股票资产所对应的基准指数从沪深300指数调整为中证800指数。

此外,基于本基金过往实际投资运作情况,考虑到基金合同约定的本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的股票部分所对应的基准要素权重从50%提高至90%,将债券资产所对应的基准要素权重从50%调低至5%,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。调整后的中证800指数与本基金的产品定位、投资风格及过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产的业绩比较基准要素。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、公司债等债券组成,反映境内人民币债券市场整体表现,适合作为本基金债券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,适合作为本基金现金类资产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。

17、银华睿裕主题混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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选择符合主题行业并投资其中的优势企业,把握国民收入增长和消费升级催生的投资机会。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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布的匹配,同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金将股票资产所对应的基准指数从沪深300指数调整为沪深300价值指数。

此外,考虑到基金合同约定基金投资于股票资产占基金总资产的比例为60%-95%,债券为0%-40%,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的股票部分所对应的基准要素权重从80%提高至90%,并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等相匹配。调整后新业绩比较基准中,沪深300价值指数从沪深300指数样本中,选取价值因子得分最高的100只证券作为指数样本,反映沪深300指数样本中具有价值特征的上上市公司证券的整体表现。调整后的沪深300价值指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产的业绩比较基准要素。中债-总财富(总值)指数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情况,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。

18、银华裕利混合型发起式证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金股票资产将采用“自上而下”选择细分行业及“自下而上”的方式挑选公司,遵循国家宏观经济政策导向,选择国家明确支持的细分行业,并通过定性定量方法选择财务质量和价值方面达到要求的公司进入本基金的基础股票库。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,以及指数市值覆盖、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从沪深800指数调整为中证800价值指数,将港股通标的股票部分所对应的基准要素从恒生指数调整综合指数(人民币)。基于基金的投资目标、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,以及指数市值覆盖、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调整为中证800指数。

此外,基于本基金过往实际投资运作情况,考虑到基金合同约定股票资产占基金资产的比例为50%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%),并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的股票部分所对应的基准要素权重从30%提高至40%,将债券资产所对应的基准要素权重从30%调低至20%,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。

调整后新业绩比较基准中,中证800价值指数从沪深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上市公司证券的整体表现。调整后的中证800价值指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金A股股票资产部分的业绩比较基准要素。中证港股通综合指数(人民币)选择符合港股通资格的上上市公司证券作为样本,反映港股通境内上市公司的整体表现,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。中债-总财富(总值)指数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情况,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。

19、银华泓泓灵活配置混合型发起式证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金通过对国有企业改革关键变量的深入研究,结合宏观经济周期和行业景气度分析,精准把握适合所有制改革的契机,改革方向符合产业发展逻辑,主动引入资金、新技术和创新的管理体系,减少对政府资金和资源的依赖,在市场化中提高竞争力和可持续发展能力的优质上市公司。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,以及指数市值覆盖、行业与个股分布等,本基金将股票资产所对应的基准指数从沪深300指数调整为中证红利指数。

基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将权益资产所对应的基准要素权重从50%提高至80%,将债券资产所对应的基准要素权重从50%调低至20%,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相匹配。

调整后新业绩比较基准中,中证红利指数选取100只现金股息率高、分红较为稳定,并具有一定规模及流动性的上市公司证券作为指数样本,以反映高股息率上市公司证券的整体表现,调整后的中证红利指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票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。

20、银华智能建造股票型发起式证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金要投资于符合“智能建造”产业化方向的公司股票,主要行业分布在建筑、建材、机械等重点行业,在严格控制投资集中度风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格与个股分布的匹配度,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股股票资产所对应的基准指数从沪深800指数调整为中证万得制造业指数,将港股通标的股票部分所对应的基准要素从恒生指数调整为恒生综合行业指数。

此外,考虑到基金合同约定本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的A股股票部分所对应的基准要素权重从60%提高至80%,将债券资产所对应的基准要素权重从20%调低至5%,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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相匹配。

调整后新业绩比较基准中,中证万得制造业指数基于申万行业分类标准编制,用以表征制造业上市公司整体表现,调整后的申万万得制造业指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。恒生综合行业指数由恒生综合行业指数成份股,反映上述相关上市公司在香港股票市场的表现,调整后的恒生综合行业指数属于工业与基建过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,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。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。

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。

21、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将A股股票资产所对应的基准要素权重从45%提高至75%,将港股通标的股票资产所对应的基准要素权重从35%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。

22、银华沪东轮动混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素权重,并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金股票资产在“严格控制投资集中度”的前提下,通过把握行业轮动规律,动态调整基金股票资产在不同行业之间的配置比例,力求实现基金净值增长持续稳健,并实现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、指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等因素,本基金将股票资产部分所对应的基准指数从沪深300指数调整为中证800指数。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

23、银华新能源汽车主题优化配置发起式证券投资基金(QDII)
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金重点投资于新能源及智能汽车产业链,在全球市场范围内挖掘稳健、稳健、可持续增长的优质企业,追求超越业绩比较基准的投资回报,力求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、投资风格与主题属性的匹配度,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,本基金将境外股票资产所对应的基准指数从标普500指数调整为中港美全上市全球智能汽车主题指数(人民币)。

此外,基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将境外权益资产所对应的基准要素权重从45%提高至70%,将境内权益资产所对应的基准要素权重从45%调低至20%,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情况和产品定位更为匹配。

调整后新业绩比较基准中,中证港全上市全球智能汽车主题指数(人民币)由中国香港和美国市场上的证券中选取50只业务涉及感知定位、决策规划、控制执行、智能能以及车联网等智能汽车和相关的境上市公司证券作为指数样本,反映中国香港和美国市场上的智能汽车主题上市公司证券的整体表现,与本基金基金定位更为匹配,能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作

为本基金境外权益资产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。

24、银华通达成长主题证券投资基金(LOF)
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,本基金增加中证国债指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

此外,基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的商品资产所对应的基准要素权重从100%调低至90%,并增加债券资产所对应的基准要素权重5%,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,中证国债指数选取在沪深交易所成银行间市场上市的BBB及以上、且剩余期限1年以下的国债、金融债、企业债等债券作为成份券,反映相应期限债券的走势。调整后的中证国债指数与本基金的产品定位、投资风格及过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金债券部分资产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,适合作为本基金现金类资产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。

25、银华安悦六个月持有期混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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定性分析和定量分析相结合的方法,选择在行业中具备竞争优势、成长性良好和价值合理的股票,在严格控制投资集中度风险的前提下,追求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指数调整为中证800指数。

基于本基金过往实际运作情况,结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将A股权益类资产对应的要素权重由10%提高至12%,将港股权益类资产对应的基准要素权重由5%调低至3%,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。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金A股权益类资产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。

26、银华弘益一年持有期混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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,选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票。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股股票部分资产的基准要素由沪深300指数调整为中证800指数。

基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的现金类资产增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,同时删除港股通标的股票部分资产的基准要素,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实际投资运作等相匹配。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金A股股票部分资产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,适合作为本基金现金类资产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。

27、银华弘益灵活配置混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金的债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况等因素的综合分析,主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。根据过往债券配置情况,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,本基金将债券部分基准要素从一年期人民币定期存款基准利率(税后)调整为中债-综合全价(总值)指数和沪深300指数。

基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的债券基准要素权重从15%提高至90%,将业绩比较基准中的股票基准要素权重从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相匹配。

调整后新业绩比较基准中,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,调整后的中债-综合全价(总值)指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金债券部分资产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,调整后的沪深300指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

28、银华灵活配置混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金的债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况等因素的综合分析,主要通过类属配置与券种选择进行投资管理。根据过往债券配置情况,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,本基金将债券部分基准要素从一年期人民币定期存款基准利率(税后)调整为中债-综合全价(总值)指数、中证红利指数和活期存款基准利率。

基于本基金过往实际运作情况,基金合同约定的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,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金业绩比较基准中的债券基准要素权重从75%,将业绩比较基准中的股票基准要素权重从20%,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,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,调整后的中债-综合全价(总值)指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。中证红利指数选取100只现金股息率高、分红较为稳定,并具有一定规模及流动性的上市公司证券作为指数样本,以反映高股息率上市公司证券的整体表现,调整后的中证红利指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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,适合作为本基金现金类资产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。

29、银华通利灵活配置混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况等因素的综合分析,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,本基金将债券部分基准要素从沪深300指数调整为沪深300价值指数。

此外,考虑到基金合同约定本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的债券部分所对应的基准要素权重从70%提高至95%,并将股票资产所对应的基准要素权重从30%调低至20%,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,沪深300价值指数从沪深300指数样本中,选取价值因子得分最高的100只证券作为指数样本,反映沪深300指数样本中具有价值特征的上上市公司证券的整体表现。调整后的沪深300价值指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产的业绩比较基准要素。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,适合作为本基金债券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,适合作为本基金现金类资产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。

30、银华恒利债券型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和投资策略,本基金的债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况等因素的综合分析,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,本基金将债券部分的基准要素由中债-优选投资级信用债全价(1-3年)指数调整为中债-综合全价(总值)指数。基于基金的投资目标、投资范围和策略,本基金的股票资产通过定性分析和定量分析相结合的方法,采取“自下而上”的选股模式,以价值

选股、组合投资为原则,选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票。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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金将股票部分资产的基准要素由沪深300指数调整为中证800指数。

此外,基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定的本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将债券资产所对应的基准要素权重从85%调低至80%,增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产的业绩比较基准要素。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,调整后的中债-综合全价(总值)指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金债券部分资产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,适合作为本基金现金类资产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。

31、银华恒利债券型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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定性分析和定量分析相结合的方法,采取“自下而上”的选股模式,以价值选股、组合投资为原则,选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票。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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金将股票部分的基准要素由沪深300指数调整为中证800指数。

此外,基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将债券资产所对应的基准要素权重从85%调低至80%,将股票资产所对应的基准要素权重从10%提高至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等相匹配。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

32、银华恒利90天持有期债券型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将债券部分资产的基准要素权重由95%提高至90%,将A股股票资产对应的基准要素权重由4%提高至5%,删除港股通标的股票资产对应的基准要素,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

33、银华恒利债券型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和策略,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,挖掘优质公司,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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金将股票部分的基准要素由沪深300指数调整为中证800指数。

基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将债券部分资产对应的基准要素权重从85%提高至90%,将A股股票资产对应的要素权重从14%调低至10%,同时删除港股通标的股票资产对应的基准要素,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。

调整后新业绩比较基准中,中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

34、银华景顺债券型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和策略,本基金的债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况的综合分析,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,将债券资产部分所对应的基准指数从申债综合财富指数调整为中债-优选投资级信用债全价(1-3年)指数和可转债债券指数。基于基金的投资目标、投资范围和策略,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,挖掘优质公司,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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金增加表征股票资产的沪深300指数作为股票资产部分的业绩比较基准要素。

此外,基于本基金过往实际运作情况,并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的权益资产部分所对应的基准要素权重从18%调低至17%,其中境内权益类资产部分所对应的基准要素权重从12%提高至14%,将境外权益资产部分所对应的基准要素权重由2%提高至3%,删除港股通标的股票部分所对应的基准要素;同时,商品类资产部分所对应的基准要素权重由2%提高至3%;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。

调整后新业绩比较基准中,中债-优选投资级信用债全价(1-3年)指数成份券优选境内公开发行且上市流通的境内市场信用等级AA+及以上、主体评级AA+及以上的公司债、公司债券等(含1-3年(含1年)债券)的中债-优选投资级信用债全价(1-3年)指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金可转债债券部分的业绩比较基准要素。中证可转债债券指数由可转债债券指数成份券(转债除外)的基金或计算,以反映沪深交易所可转债债券的整体表现,调整后的中证可转债债券指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金可转债债券部分的业绩比较基准要素。

此外,基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定的本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,将业绩比较基准中的权益资产部分所对应的基准要素权重从20%调低至17%,其中,境内权益类资产部分所对应的基准要素权重由20%调低至14%,增加表征境外权益资产部分所对应的基准要素权重3%;同时增加表征商品类资产部分所对应的基准要素权重3%,同时将5%的现金类资产部分所对应的基准要素从一年期人民币定期存款基准利率(税后)调整为活期存款基准利率,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相匹配。

调整后新业绩比较基准中,标普500指数(S&P 500 Index)包括美国股市所有上市板块的500家领先上市公司,以反映美国市场大盘股的整体表现,调整后的标普500指数(S&P 500 Index)与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金境外权益类资产的业绩比较基准要素。上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约在上海黄金交易所交易,代表黄金资产的现货合约,调整后的上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约价格与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金境内权益类资产的业绩比较基准要素。上指综合指数(SSE Composite Index)以上海证券交易所交易,代表黄金资产的现货合约,调整后的上海黄金交易所AU99.99现货实盘合约价格与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金境内权益类资产的业绩比较基准要素。

此外,基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定的本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,将业绩比较基准中的权益资产部分所对应的基准要素权重从25%调低至20%,增加表征境外权益资产部分所对应的基准要素权重5%,同时增加收益类资产部分所对应的基准要素从75%调低至70%,增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,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,反映反映境内人民币债券市场的整体表现,适合作为为本基金债券部分资产的业绩比较基准要素。中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

36、银华恒益灵活配置混合型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和策略,本基金的债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况等因素的综合分析,主要通过类属配置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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,本基金将债券部分基准要素从半年期银行定期存款利率(税后)调整为中债-0-1年债券综合全价(总值)指数和活期存款基准利率。

此外,考虑到基金合同约定本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,将业绩比较基准中的债券基准要素权重从10%提高至95%,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,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,反映反映境内人民币债券市场的整体表现,适合作为为本基金债券部分资产的业绩比较基准要素。中证800指数由沪深两市市值较大、流动性较好的800只股票构成,反映沪深市场中大盘上市公司证券的整体表现。指数样本量大,行业覆盖面广,调整后的中证800指数与基金过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为本基金股票部分资产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。

37、银华恒利债券型证券投资基金
此次本基金业绩比较基准调整同时涉及基准要素,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。

基于基金的投资目标、投资范围和策略,本基金的债券资产根据对宏观经济形势、市场利率走势、收益曲线形态和信用利差状况等因素的综合分析,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,以及基准指数数种、长期、信用等级分布特征等,将债券资产部分基准要素指从中债优选投资级信用债全价(1-3年)指数调整为中债-综合全价(总值)指数。基于基金投资目标、投资范围和策略,本基金的权益资产选择方式,重点选择具有可转换优势和估值优势的个股,力求在承担较低风险

前提下获取超额收益。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,以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等,本基金增加表征股票资产的沪深300指数作为股票资产部分的业绩比较基准要素。

此外,基于本基金过往实际运作情况,考虑到基金合同约定的本基金需保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,并结合基金合同约定的其他投资比例限制和产品定位,本基金将业绩比较基准中的债券部分所对应的基准要素权重从100%调低至80%(其中普通债券部分和可转债部分的基准要素权重分别为70%和10%),增加15%的股票部分资产所对应的基准要素权重,同时增加5%的现金类资产部分所对应的基准要素权重,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。

调整后新业绩比较基准中,中债-新综合财富(1-3年)指数样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份券包括国债、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、公司债券等主要债券种类,成份券持债期在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。调整后的中债-新综合财富(1-3年)指数与基金债券资产过往实际投资运作更为匹配,从而能够更好反映本基金的产品定位和投资风格,适合作为为本基金普通债券部分的业绩比较基准要素。中证可转债债券指数的样本来自在沪深交易所上市的可转债债券组成。指数用市值加权计算,以反映