

## 融通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，融通基金管理有限公司（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	融通产业趋势臻选股票型证券投资基金	沪深300指数收益率×80%+中证香港100指数收益率×10%+中债综合全价(总值)指数收益率×10%	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数（港元）收益率×20%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%
2	融通明锐混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数（港元）收益率×20%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%
3	融通转型三动力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(全价)指数收益率×50%	中证全指工业指数收益率×30%+中证全指信息技术指数收益率×30%+中证全指医药卫生指数收益率×25%+中债-综合全价（总值）指数收益率×15%
4	融通新能源灵活配置混合型证券投资基金	中证内地新能源主题指数收益率×50%+中债综合(全价)指数收益率×50%	中证新能源指数收益率×90%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%

5	融通新消费灵活配置混合型证券投资基金	中证全指主要消费指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%	中证全指主要消费指数收益率×80%+中债-综合全价(总值)指数收益率×20%
6	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%	中证800指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
7	融通慧心混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数(港元)收益率×20%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
8	融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金	中证红利指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%	中证红利指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数(港元)收益率×10%+中债-综合全价(总值)指数收益率×20%
9	融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率×50%+中债综合(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%
10	融通产业趋势精选混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×45%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%+中证香港100指数收益率×20%+中国战略新兴产业成份指数收益率×5%	沪深300指数收益率×70%+中证港股通综合指数(港元)收益率×20%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
11	融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金	中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%	中证800指数收益率×85%+中证港股通综合指数(港元)收益率×5%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
12	融通价值成长混合型证券投资基金	中证800指数收益率×60%+中证香港100指数收益率×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数(港元)收益率×20%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%

13	融通产业趋势先锋股票型证券投资基金	沪深300指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%	中证800指数收益率×75%+中证港股通综合指数(港元)收益率×10%+中债-综合全价(总值)指数收益率×15%
14	融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价(总值)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%
15	融通收益增强债券型证券投资基金	中债综合全价(总值)指数收益率	中债-综合全价(总值)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%
16	融通稳鑫90天持有期债券型证券投资基金	中债综合全价(总值)指数收益率	中债-综合全价(1-3年)指数收益率
17	融通可转债债券型证券投资基金	中证可转换债券指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%	中证可转换债券指数收益率×90%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%
18	融通通源短融债券型证券投资基金	一年期定期存款利率(税后)	中债-综合全价(1年以下)指数收益率

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(<http://www.rtfund.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：400-883-8088

网址：www.rtfund.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。

融通基金管理有限公司

2026年6月26日

## 附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

### 一、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 80\% + \text{中证香港100指数收益率} \times 10\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数(港元)收益率} \times 20\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

#### （二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产将在大类资产配置的基础上，结合产业趋势投资策略，挖掘A股与港股通范围内的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原基金合同业绩比较基准中沪深300指数（指数代码：000300/399300）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）选取中证500指数和沪深300指数的成份股作为指数样本，反映沪深市场不同市值规模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。原基金合同业绩比较基准中中证香港100指数（指数代码：H11100）从香港市场选取最大的100只证券作为指数样本，以反映香港交易所上市证券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中中证港股通综合指数（港元）（指数代码：930930）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，以反映港股通范围内上市公司的整体表现，更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。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金股票资产与债券资产所对应的基准要素权重仍分别设置为90%与10%，其中将股票资产中的A股股票与港股通标的股票所对应的基准要素权重分别调整为70%与20%，债券资产所对应的基准要素权重保持不变。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 二、融通明锐混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 20\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 20\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指}$

数（港元）收益率×20%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%

## （二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、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对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘A股与港股通范围内的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原基金合同业绩比较基准中沪深300指数（指数代码：000300/399300）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证800指数（指数代码：000906）选取中证500指数和沪深300指数的成份股作为指数样本，反映沪深市场不同市值规模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。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，其中将股票资产中的A股股票所对应的基准要素权重调整为70%，股票资产中港股通标的股票所对应的基准要素权重保持20%不变，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 三、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%

调整后的新业绩比较基准：中证全指工业指数收益率×30%+中证全指信息技术指数收益率×30%+中证全指医药卫生指数收益率×25%+中债-综合全价（总值）指数收益率×15%

## （二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业三个行业相关公司，并挖掘经济转型过程中高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业等三个行业发展带来的投资机会，在合理控制投资风险的基础上，获取基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的长期收益。原基金合同业绩比较基准中沪深300指

数（指数代码：000300/399300）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全指工业指数（指数代码：000988）从中证全指指数范围内选取流动性较好、市值较大的工业行业上市公司证券作为指数样本，以反映工业行业上市公司证券的整体表现；中证全指信息技术指数（指数代码：000993）从中证全指指数范围内选取流动性较好、市值较大的信息技术行业上市公司证券作为指数样本，以反映信息技术行业上市公司证券的整体表现；中证全指医药卫生指数（指数代码：000991）从中证全指指数范围内选取流动性较好、市值较大的医药卫生行业上市公司证券作为指数样本，以反映医药卫生行业上市公司证券的整体表现；上述指数更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至85%，其中将中证全指工业指数、中证全指信息技术指数、中证全指医药卫生指数对应的基准要素权重分别设置为30%、30%、25%，债券资产所对应的基准要素权重调整为15%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### **四、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金**

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{中证内地新能源主题指数收益率} \times 50\% + \text{中债综合(全价)指数收益率} \times 50\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证新能源指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

#### **（二）新业绩比较基准选择原因及合理性**

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投向新能源主题相关公司，通过梳理新能源产业发展所带来的投资机会，并结合积极的大类资产配置，谋求基金资产的长期稳定增值。原基金合同业绩比较基准中中证内地新能源主题指数（指数代码：000941）从涉及新能源生产、新能源存储以及新能源汽车等业务的上市公司证券中选取新能源业务规模较大、盈利较好的50只样本作为指数样本，反映沪深A股市场中新能源主题公司股票的整体表现。调整后的新业绩比较基准中中证新能源指数（指数代码：399808）选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源

交互设备等业务的上市公司证券作为指数样本，以反映新能源产业相关上市公司证券的整体表现；中证新能源指数产业覆盖面更广、权重结构更分散合理，更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### **五、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金**

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{中证全指主要消费指数收益率} \times 50\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 50\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证全指主要消费指数收益率} \times 80\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 20\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至80%，债券资产所对应的基准要素权重调整为20%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### **六、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金**

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 50\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 50\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、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对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘A股范围内的优质公司，在严格控制投资组合风险的前提

下，通过对行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入研究，精选出质地优秀、成长性良好的公司进行投资，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。原基金合同业绩比较基准中沪深300指数（指数代码：000300/399300）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）选取中证500指数和沪深300指数的成份股作为指数样本，反映沪深市场不同市值规模上市公司证券的整体表现，更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 七、融通慧心混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 20\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 20\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数(港元)收益率} \times 20\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、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对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘A股与港股通范围内的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原基金合同业绩比较基准中沪深300指数（指数代码：000300/399300）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）选取中证500指数和沪深300指数的成份股作为指数样本，反映沪深市场不同市值规模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。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，其中将股票资产中的A

股股票所对应的基准要素权重调整为70%，股票资产中港股通标的股票所对应的基准要素权重保持20%不变，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 八、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金

(一) 原基金合同业绩比较基准：中证红利指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%

调整后的新业绩比较基准：中证红利指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数（港元）收益率×10%+中债-综合全价（总值）指数收益率×20%

(二) 新业绩比较基准选择原因及合理性

由于本基金投资范围包含港股通标的股票，同时实际资产配置中会根据需要参与港股通标的股票的投资。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高股息投资指数（港元）作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。中证港股通高股息投资指数（港元）（指数代码：930914）从符合港股通条件的上市公司证券中选取30只流动性好、连续分红、股息率高的证券作为指数样本，以反映港股通范围内连续分红且股息率较高的上市公司证券的整体表现。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至80%，其中将股票资产中的A股股票所对应的基准要素权重调整为70%，股票资产中港股通标的股票所对应的基准要素设置为10%，债券资产所对应的基准要素权重调整为20%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 九、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

(一) 原基金合同业绩比较基准：中证新兴产业指数收益率×50%+中债综合(全价)指数收益率×50%

调整后的新业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\%$

## （二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、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对公司基本面进行持续跟踪分析，重点挖掘新区域新经济相关的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原基金合同业绩比较基准中中证新兴产业指数（指数代码：000964）由沪深市场中规模大、流动性好的100家新兴产业公司组成，以综合反映沪深市场中新兴产业的整体表现。调整后的新业绩比较基准中沪深300指数（指数代码：000300/399300）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，相比于中证新兴产业指数，行业覆盖更广，更匹配本基金的投资策略。更适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 十、融通产业趋势精选混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 45\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 30\% + \text{中证香港100指数收益率} \times 20\% + \text{中国战略新兴产业成份指数收益率} \times 5\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（港元）收益率} \times 20\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

## （二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产将在大类资产配置的基础上，结合产业趋势投资策略，挖掘A股与港股通范围内的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原业绩比较基准中A股股票部分选取沪深300指数和中国战略新兴产业成份指数作为基准要素。其中中国战略新兴产业成份指

数（指数代码：000171），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具有代表性的100只上市公司证券作为指数样本，以反映战略新兴产业上市公司证券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中A股股票部分仅采用沪深300指数作为基准要素。沪深300指数（指数代码：000300/399300）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，相比于中国战略新兴产业成份指数，行业覆盖更广，更匹配本基金的投资策略。更适合作为本基金A股股票部分的业绩比较基准要素。原基金合同业绩比较基准中中证香港100指数（指数代码：H11100）从香港市场选取最大的100只证券作为指数样本，以反映香港交易所上市证券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中中证港股通综合指数（港元）（指数代码：930930）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，以反映港股通范围内上市公司的整体表现，更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。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，其中将股票资产中的A股股票所对应的基准要素权重调整为70%，股票资产中港股通标的股票所对应的基准要素仍设置为20%，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 十一、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 80\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 20\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 85\% + \text{中证港股通综合指数（港元）收益率} \times 5\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

由于本基金投资范围包含港股通标的股票，同时实际资产配置中会根据需要参与港股通标的股票的投资。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，本基金选取中证港股通综合指数（港元）作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。中证港股通综合

指数（港元）（指数代码：930930）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，以反映港股通范围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。

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。原基金合同业绩比较基准中中证综合债券指数（指数代码：H11009）选取在沪深交易所或银行间市场上上市的BBB及以上、且剩余期限1个月及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券，反映全市场债券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中中债-综合全价（总值）指数（指数代码：CBA00203）由在境内债券市场公开发行的国债、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；中债-综合全价（总值）指数由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，调整业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重至90%，其中将股票资产中的A股股票所对应的基准要素权重调整为85%，股票资产中港股通标的股票所对应的基准要素设置为5%，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

## 十二、融通价值成长混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 60\% + \text{中证香港100指数收益率} \times 20\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 20\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（港元）收益率} \times 20\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 10\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、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对公司基本面进行持续跟踪分析，挖掘A股与港股通范围内的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原基金合同业绩比较基准中中证香港100指数（指数代码：H11100）从香港市场选取最大的100只证券作为指数样本，以反映香港交易所上市证券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中中证港股通综合指数（港元）（指数代码：930930）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，以反映港股通范围内上市公司的整体表现，更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。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金股票资产与债券资产所对应的基准要素权重分别设置为90%与10%，其中将股票资产中的A股股票所对应的基准要素权重调整为70%，港股通标的股票所对应的基准要素权重保持20%不变。债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

### 十三、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 80\% + \text{中债综合全价(总值)指数收益率} \times 20\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证800指数收益率} \times 75\% + \text{中证港股通综合指数(港元)收益率} \times 10\% + \text{中债-综合全价(总值)指数收益率} \times 15\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产将在大类资产配置的基础上，结合产业趋势投资策略，挖掘A股与港股通范围内的优质公司，从而在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。原基金合同业绩比较基准中沪深300指数（指数代码：000300/399300）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）选取中证500指数和沪深300指数的成份股作为指数样本，反映沪深市场不同市值规模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。由于本基金投资范围包含港股通标的股票，同时实际资产配置中会根据需要参与港股通标的股票的投资。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，本基金选取中证港股通综合指数（港元）作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。中证港股通综合指数（港元）（指数代码：930930）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，以反映港股通范围内上市公司的整体表现。

同时基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金

股票资产与债券资产所对应的基准要素权重分别调整为85%与15%，其中将股票资产中的A股股票所对应的基准要素权重调整为75%，将港股通标的股票所对应的基准要素权重设置为10%，债券资产所对应的基准要素权重调整为15%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### 十四、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 50\% + \text{中债综合全价（总值）指数收益率} \times 50\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将股票资产所对应的基准要素权重调整为90%，债券资产所对应的基准要素权重调整为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

#### 十五、融通收益增强债券型证券投资基金

（一）原基金合同业绩比较基准： $\text{中债综合全价(总值)指数收益率}$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 85\% + \text{中证可转换债券指数收益率} \times 5\% + \text{沪深300指数收益率} \times 10\%$

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

由于本基金投资范围包含国内依法发行上市的股票、可转换债券、可交换债券，同时实际资产配置中会根据需要参与股票、可转换债券、可交换债券的投资。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，以及股票指数的指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，以及债券指数的基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金选取沪深300指数作为股票部分的业绩比较基准要素。选

取中证可转换债券指数作为本基金债券部分的业绩比较基准要素之一。沪深300指数（指数代码：000300/399300）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。中证可转换债券指数（指数代码：000832）的样本券由在沪深交易所上市的可转换债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换债券的整体表现。

基于本基金投资比例限制，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基准要素权重调整为90%，其中，中债-综合全价（总值）指数和中证可转换债券指数的权重分别设置为85%和5%。股票资产所对应的基准要素权重设置为10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## **十六、融通稳鑫90天持有期债券型证券投资基金**

（一）原基金合同业绩比较基准：中债综合全价(总值)指数收益率  
调整后的新业绩比较基准：中债-综合全价（1-3年）指数收益率

（二）新业绩比较基准选择原因及合理性

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，预期本基金组合久期整体偏向于中短久期。在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。原基金合同业绩比较基准中债综合全价(总值)指数收益率（指数代码：CBA00203）由在境内债券市场公开发行的国债、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。调整后的新业绩比较基准中债-综合全价（1-3年）指数（指数代码：CBA00223）由在境内债券市场公开发行的国债、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，更适合作为本基金的业绩比较基准要素。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 十七、融通可转债债券型证券投资基金

(一) 原基金合同业绩比较基准： $\text{中证可转换债券指数收益率} \times 70\% + \text{中债综合全价（总值）指数收益率} \times 20\% + \text{沪深300指数收益率} \times 10\%$

调整后的新业绩比较基准： $\text{中证可转换债券指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\%$

(二) 新业绩比较基准选择原因及合理性

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金主要采用可转债套利策略、转股投资策略、条款获利策略等投资策略投资于可转换债券(含分离交易可转债)。其余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。在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。本基金仍选取原基金合同业绩比较基准中中证可转换债券指数和中债-综合全价（总值）指数作为本基金业绩比较基准要素。中证可转换债券指数的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成，以反映国内市场可转换债券的总体表现；中债-综合全价（总值）指数由在境内债券市场公开发行的国债、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。删除原基金合同业绩比较基准要素中沪深300指数。

基于本基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将中证可转换债券指数和中债-综合全价（总值）指数的权重分别设置为90%和10%。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 十八、融通通源短融债券型证券投资基金

(一) 原基金合同业绩比较基准：一年期定期存款利率（税后）

调整后的新业绩比较基准：中债-综合全价（1年以下）指数收益率

(二) 新业绩比较基准选择原因及合理性

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，预期本基金组合久期整体偏向于短久期。通过基金管理人以对短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断，选择具有投资价值的债券，严格控制风险，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。原基金合同业绩比较基准一年期

定期存款利率是由中国人民银行在其网站公布的金融机构存款利率，无法反映债券市场的表现。调整后的新业绩比较基准中债-综合全价（1年以下）指数由在境内债券市场公开发行的国债、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年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现，更适合作为本基金的业绩比较基准要素。

本次业绩比较基准变更旨在更科学、准确地表征本基金的投资风格，未改变基金份额持有人的权利义务，不改变本基金的投资目标、投资范围、投资策略及风险收益特征，基金管理人的投资运作不会因本次基准调整发生实质性变化，仍将严格按照《基金合同》约定开展投资管理工作，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。