

华泰证券（上海）资产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，华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自 2026 年 11 月 30 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	调整后的业绩比较基准
1	华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金	中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%	中债-综合财富(总值)指数收益率×90%+中证可转换债券指数收益率×5%+沪深 300 指数收益率×5%
2	华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金	中债综合财富(总值)指数收益率×90%+ 银行活期存款利率(税后)×10%	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%
3	华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金	中债综合财富(1 年以下)指数收益率*60%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率*30%+一年期定期存款利率(税后)*10%	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%
4	华泰紫金月月发 1 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金	中债综合财富(总值)指数收益率×95%+ 银行活期存款利率(税后)×5%	中债-综合财富(总值)指数收益率×85%+中证可转换债券指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
5	华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	中债综合全价(总值)指数收益率×70%+中证 800 指数收益率×22%+中证港股通综合指数收益率×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×3%	中债-综合全价(总值)指数收益率×77%+沪深 300 指数收益率×14%+恒生指数收益率×3%+标普 500 指数(S&P 500 Index)收益率×3%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率×3%

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、业绩比较基准设定的原因（包括与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制的匹配情况）、业绩比较基准要素的相关信息（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况和程序。基金管理人将一并更新基金管理人和/或相应基金托管人的基本信息（如有），并将根据基金合同的修订内容更新招募说明书、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（<https://www.htscamc.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 11 月 30 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：4008895597

网址：<https://www.htscamc.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。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

2026 年 10 月 31 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

一、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%

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%+中证可转换债券指数收益率×5%+沪深 300 指数收益率×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业绩比较基准要素、业绩比较基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

（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 10%调整至 5%，可转换债券资产的基准要素权重从 0%提高到 5%。

（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，在保留原有中债-综合财富（总值）指数并保持其权重不变的基础上，增加中证可转换债券指数并设置权重为 5%，分别作为利率债及信用债、可转换债券部分的业绩比较基准要素。

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，适合作为本基金可转换债券资产部分的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准及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。

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，不会对基金投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

二、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%

调整后的新业绩比较基准：中债-综合财富(1 年以下)指数收益率×95%+活期

存款基准利率 $\times 5\%$

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调整业绩比较基准的要素权重、更换业绩比较基准要素，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

（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%提高到 95%，现金类资产的基准要素权重从 10%降低到 5%。

（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基金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财富(总值)指数调整为中债-综合财富(1 年以下)指数。

中债-综合财富(1 年以下)指数隶属于中债总指数族，该指数成分券包括在境内公开发行的记账式国债、地方政府债、政策性金融债、信用债等各类债券，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，更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准及要素权重更符合基金所投资的主要资产类别的过往实际投资运作情况。

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，不会对基金投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

三、华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债综合财富(1 年以下)指数收益率 $\times 60\%$ +中债综合财富(1-3 年)指数收益率 $\times 30\%$ +一年期定期存款利率(税后) $\times 10\%$

调整后的新业绩比较基准：中债-综合财富(1 年以下)指数收益率 $\times 95\%$ +活期存款基准利率 $\times 5\%$

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业绩比较基准的要素权重、更换业绩比较基准要素，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

（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%提高到 95%，现金类资产的基准要素权重从 10%降低到 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。债券资产基准方面，中债-综合财富(1 年以下)指数权重从 60%提高到 95%，删除中债-综合财富(1-3 年)指数，以更好匹配本基金债券投资的久期中枢。

(2) 更换业绩比较基准要素：在现金类资产的基准选取方面，基于流动性管理需求，选取活期存款基准利率作为现金类资产部分的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准及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。

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，不会对基金投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

四、华泰紫金月月发 1 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金

1、原业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%

调整后的新业绩比较基准：中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 85%+中证可转换债券指数收益率 $\times$ 10%+活期存款基准利率 $\times$ 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调整业绩比较基准的要素权重、更换业绩比较基准要素，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

(1) 调整业绩比较基准的要素权重：将基准中的债券资产中的利率债及信用债的基准要素权重从 95%降低到 85%，可转换债券资产的基准要素权重从 0%提高到 10%，现金类资产的基准要素权重保持 5%。

(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，增加中证可转换债券指数作为债券资产中可转换债券部分的业绩比较基准要素。

中证可转换债券指数的样本券由在沪深交易所上市的可转换债券组成。指数用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换债券的整体表现，适合作为本基金可转换债券部分的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准及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。

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，不会对基金投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

五、华泰紫金多元均衡三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

1、原业绩比较基准：中债综合全价(总值)指数收益率×70%+中证 800 指数收益率×22%+中证港股通综合指数收益率×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×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*77%+沪深 300 指数收益率*14%+恒生指数收益率*3%+标普 500 指数（S&P 500 Index）收益率*3%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*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，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

（1）调整业绩比较基准的要素权重：将业绩比较基准中固定收益类资产的基准要素权重从 70%提高至 77%、权益类资产的基准要素权重从 27%降低至 20%（其中 A 股权益类资产的基准要素权重从 22%降低至 14%、港股权益类资产的基准要素权重从 5%降低至 3%、境外权益类资产所对应的基准要素权重从 0%提高至 3%）。

（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，本基金通过定量和定性相结合的方法，精选具有不同风险收益特征及投资业绩比较优势的基金确定本基金配置组合。经审慎评估，综合考虑基准指数与基金定位、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，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将 A 股权益类资产所对应的基准指数从中证 800 指数调整为沪深 300 指数，将港股权益类资产所对应的基准指数从中证港股通综合指数调整为恒生指数，并将增加标普 500 指数（S&P 500 Index）作为境外权益类资产所对应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，更适合作为本基金 A 股权益类

资产的业绩比较基准要素。

恒生指数包括市值最大及成交最活跃并在香港联合交易所主板上市的公司，是反映香港股票市场表现最具有代表性的综合指标之一，更适合作为本基金港股权益类资产的业绩比较基准要素。

标普 500 指数（S&P 500 Index）由美国市场市值较大、流动性较好的 500 只代表性股票构成，反映美国市场大中型上市公司证券的整体表现。指数样本覆盖面广、行业分布均衡，适合作为本基金境外权益类资产的业绩比较基准要素。

调整后的业绩比较基准及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。

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，不会对基金投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。