

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 9 月 21 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	南方盛元红利混合型证券投资基金	上证红利指数 $\times$ 90%+上证国债指数 $\times$ 10%	中证红利指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
2	南方远见回报股票型证券投资基金	沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%	沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
3	南方产业活力股票型证券投资基金	沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%	沪深 300 指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
4	南方匠心优选股票型证券投资基金	中证 800 指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%	中证 800 指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
5	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金	中证 700 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%	中证 500 成长指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
6	南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金	经人民币汇率调整的恒生指数收益率 $\times$ 95%+人民币同期活期存款利率 $\times$ 5%	恒生综合指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%

7	南方北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金	北证 50 成份指数收益率 $\times$ 65%+中债总指数收益率 $\times$ 25%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%	北证 50 成份指数收益率 $\times$ 80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
8	南方专精特新混合型证券投资基金	中证 1000 指数收益率 $\times$ 70%+中债总指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%	中证专精特新 100 指数收益率 $\times$ 75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 15%
9	南方策略优化混合型证券投资基金	沪深 300 指数 $\times$ 80%+上证国债指数 $\times$ 20%	中证 800 指数收益率 $\times$ 90% + 中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
10	南方国策动力股票型证券投资基金	沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数 $\times$ 20%	沪深 300 指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
11	南方宝嘉混合型证券投资基金	上证国债指数收益率 $\times$ 70%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 25%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%	沪深 300 指数收益率 $\times$ 25%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%+中债-综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 70%
12	南方周期优选混合型发起式证券投资基金	中证周期 100 指数收益率 $\times$ 70%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%	中证周期 100 指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 15%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 15%
13	南方港股创新视野一年持有期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 $\times$ 60%+中证 800 指数收益率 $\times$ 10%+中债综合指数收益率 $\times$ 30%	恒生综合指数收益率 $\times$ 85%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 15%
14	南方积极配置混合型证券投资基金	上证综指 $\times$ 85%+上证国债指数 $\times$ 15%	中证 800 指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%
15	南方誉稳一年持有期混合型证券投资基金	中债综合指数收益率 $\times$ 85%+中证 800 指数收益率 $\times$ 10%+中证港股通综合指数（人民币）收	中债-综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 75%+中证 800 指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%

		益率×5%	
16	南方誉盈一年持有期混合型证券投资基金	中债综合指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%	中债-综合财富（总值）指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%
17	南方智信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%	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%
18	南方安康混合型证券投资基金	上证国债指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%	中债-综合财富（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
19	南方改革机遇灵活配置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×40%	沪深 300 指数收益率×80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×20%
20	南方军工改革灵活配置混合型证券投资基金	中证军工指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%	中证军工指数收益率×90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%
21	南方平衡配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%	中证 800 指数收益率×75%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×25%
22	南方医药创新股票型证券投资基金	中证医药卫生指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+上证国债指数收益率×15%	中证医药卫生指数收益率×65%+中证港股通医药卫生综合指数（人民币）收益率×25%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%
23	南方利淘灵活配置混合型证券投资基金	人民币三年期定期存款利率（税后）+2%	中债-综合全价（总值）指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%
24	南方利安灵活配置混合型证券投资基金	人民币三年期定期存款利率（税后）+2%	中债-综合全价（总值）指数收益率×90%+中证 800 指数收益率×10%
25	南方新材料股票型发起式证券投资基金	中证新材料主题指数收益率×75%+上证国债指数收益率×20%+恒生原材料业指数（人民币）收益率×5%	中证新材料主题指数收益率×85%+恒生综合行业指数-原材料业收益率×5%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%

26	南方新兴消费增长股票型证券投资基金 (LOF)	中证内地消费主题指数收益率×55%+中证港股通主要消费综合指数（人民币）收益率×30%+中证综合债指数收益率×15%	中证内地消费主题指数收益率×65%+中证港股通主要消费综合指数（人民币）收益率×25%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%
27	南方高端装备混合型证券投资基金	中证高端装备制造指数收益率×75%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%	中证高端装备制造指数收益率×80%+中证港股通工业综合指数（人民币）收益率×10%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%
28	南方景气前瞻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（人民币）收益率×20%+上证国债指数收益率×20%	中证 800 成长指数收益率×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%
29	南方天元新产业股票型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%	沪深 300 指数收益率×90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%
30	南方全球精选配置证券投资基金	MSCI 世界指数（MSCI World Index）×60%+MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）×40%	MSCI 世界指数（MSCI World Index）收益率×36%+MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）收益率×18%+彭博全球综合指数（Bloomberg Global-Aggregate Total Return Index Value Unhedged USD）收益率×36%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×10%
31	南方多利增强债券型证券投资基金	中央国债登记结算公司中债总指数（全价）	中债-信用债总全价（总值）指数收益率×85%+中证可转债及可交换债券指数收益率×15%
32	南方广利回报债券型证券投资基金	中证全债指数	中债-综合财富（1-3 年）指数收益率×60%+中证可转债及可交换债券指数收益率×25%+中证 800 指数收益率×15%

33	南方双元债券型证券投资基金	中证全债指数	中债-信用债总财富（1-3 年）指数收益率×90%+中证可转债及可交换债券指数收益率×10%
34	南方润元纯债债券型证券投资基金	中证全债指数	中债-信用债总财富(总值)指数收益率×80%+中债-金融债券总财富（总值)指数收益率×20%
35	南方信元债券型证券投资基金	中债-固定利率债券全价（1-3 年）指数收益率	中债-信用债总全价（总值）指数收益率
36	南方稳福 120 天持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%	中债-综合全价（1 年以下）指数收益率
37	南方稳航 120 天滚动持有债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%	中债-综合全价（1 年以下）指数收益率
38	南方稳瑞 90 天持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×85%+中证可转换债券指数收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×10%	中债-综合全价（1 年以下）指数收益率
39	南方稳信 180 天持有期债券型证券投资基金	中债综合指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%	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（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9月21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8月22日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、南方盛元红利混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{上证红利指数} \times 90\% + \text{上证国债指数} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证红利指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 10\%$

(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，本基金重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司，力争为投资者谋求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。原业绩比较基准中，上证红利指数（指数代码 000015）选取在上海证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 50 只证券作为指数样本，以反映沪市高股息率证券的整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中证红利指数（指数代码 000922）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，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。

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。

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、南方远见回报股票型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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、南方产业活力股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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%，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、南方匠心优选股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 10\%$

（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、南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证 700 指数收益率} \times 80\% + \text{上证国债指数收益率} \times$

20%

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 500 成长指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合财富 (1-3 年) 指数收益率} \times 10\%$

(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，本基金重点投资具有长期价值增值潜力的新蓝筹上市公司，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 700 指数（指数代码 000907）由中证 500 指数和中证 200 指数成份股组成。调整后的新业绩比较基准中，中证 500 成长指数（指数代码 H30351）从中证 500 指数样本中，选取成长因子得分最高的 100 只证券作为指数样本，并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权，反映中证 500 指数样本中具有成长特征的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%，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。

6、南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{经人民币汇率调整的恒生指数收益率} \times 95\% + \text{人民币同期活期存款利率} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{恒生综合指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合财富 (1-3 年) 指数收益率} \times 10\%$

年) 指数收益率 $\times 10\%$

(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, 本基金主要投资于香港成长股票, 力争实现基金资产的长期稳健增值。原业绩比较基准中, 恒生指数(指数代码 HSI) 是香港最早的股票市场指数之一, 成份股包括市值最大、成交最活跃并在香港上市的股票。调整后的新业绩比较基准中, 恒生综合指数(指数代码 HSCI) 涵盖在香港联合交易所主板上市证券总市值最高的 95%, 提供了一项全面的香港市场指标, 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。

此外, 综合考虑本基金对于债券资产的投资策略, 新增中债-综合财富(1-3 年) 指数(指数代码 CBA00221) 作为债券资产的业绩比较基准要素。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, 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%, 并将债券部分要素权重设置为 10%, 并删除原人民币同期活期存款利率要素。

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。

7、南方北交所精选两年定期开放混合型发起式证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 北证 50 成份指数收益率 $\times 65\%$ +中债总指数收益率 $\times 25\%$ +中证港股通综合指数(人民币) 收益率 $\times 10\%$

调整后新业绩比较基准: 北证 50 成份指数收益率 $\times 80\%$ +中证港股通综合指数(人民币) 收益率 $\times 10\%$ +中债-综合财富(1-3 年) 指数收益率 $\times 10\%$

(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(指数代码

CBA00303) 隶属于中债总指数族, 该指数成分券由在境内公开发行业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) 由在境内公开发行业且上市流通的国债、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。

8、南方专精特新混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 中证 1000 指数收益率 $\times$ 70%+中债总指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 10%

调整后新业绩比较基准: 中证专精特新 100 指数收益率 $\times$ 75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 10%+中债-综合财富(1-3 年)指数收益率 $\times$ 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“专精特新”主题证券, 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 1000 指数(指数代码 000852)选取中证 800 指数样本以外的规模偏小且流动性好的 1000 只证券作为指数样本, 与沪深 300 和中证 500 等指数形成互补。调整后的新业绩比较基准中, 中证专精特新 100 指数(指数代码 932357)从专精特新“小巨人”企业中选取 100 只规模较大的上市公司证券作为指数样本, 反映代表性专精特新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 A 股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。中债总指数(指数代码

CBA00303)隶属于中债总指数族,该指数成分券由在境内公开发行业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)由在境内公开发行业且上市流通的国债、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、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 75%,港股通股票部分权重不变,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。

9、南方策略优化混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 沪深 300 指数 $\times$ 80%+上证国债指数 $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准: 中证 800 指数收益率 $\times$ 90% + 中债-综合财富(1-3 年)指数收益率 $\times$ 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,本基金的股票资产采用全市场选股策略,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。原业绩比较基准中,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,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。

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、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%，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、南方国策动力股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数 $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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%，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。

11、南方宝嘉混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{上证国债指数收益率} \times 70\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 25\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 25\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 70\%$

(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。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（总值）指数（指数代码 CBA00201）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。

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、南方周期优选混合型发起式证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证周期 100 指数收益率} \times 70\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证周期 100 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 15\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 15\%$

(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。原业绩比较基准中，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 85%（其中 A 股股票部分和港股通股票部分的权重分别为 70%和 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。

13、南方港股创新视野一年持有期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%+中证 800 指数收益率×10%+中债综合指数收益率×30%

调整后新业绩比较基准：恒生综合指数收益率×85%+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，本基金对股票资产的投资以香港市场为主，以创新的视野来发掘创新技术、创新模式、创新业态等特征为代表的经济增长方式，努力挖掘质地优秀、具备长期价值增长潜力的上市公司，在控制风险的基础上力争实现基金资产的长期稳定增值。原业绩比较基准中股票部分选取恒生综合指数和中证 800 指数作为基准要素。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。本次调整后，新业绩比较基准中股票部分仅采用恒生综合指数作为基准要素。本基金对股票资产的投资以香港市场为主，恒生综合指数（指数代码 HSCI）涵盖在香港联合交易所主板上市证券总市值最高的 95%，提供了一项全面的香港市场指标，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。

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。原基准中的中债综合指数（指数代码 CBA00203）成份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-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%，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。

14、南方积极配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{上证综指} \times 85\% + \text{上证国债指数} \times 15\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 10\%$

（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，本基金通过积极操作进行资产配置和行业配置，在时机选择的同时精选个股，力争在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，为投资者寻求较高的投资收益。原业绩比较基准中，上证综合指数（指数代码 000001）由在上海证券交易所上市的符合条件的股票与存托凭证组成样本，指数市场认同度较高。指数样本量大，行业覆盖面广。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。

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%，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、南方誉稳一年持有期混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 85\% + \text{中证 800 指数收益率} \times 10\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 75\% + \text{中证 800 指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本次调整仅涉及业绩比较基准中债券与 A 股股票部分权重的调整。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 25%（其中 A 股股票部分和港股通股票部分的权重分别为 20%和 5%），降低债券部分要素权重至 75%。

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、南方誉盈一年持有期混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 85\% + \text{中证 800 指数收益率} \times 10\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 75\% + \text{中证 800 指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 5\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本次调整仅涉及业绩比较基准中债券与 A 股股票部分权重的调整。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 25%（其中 A 股股票部分和港股通股票部分的权重分别为

为 20%和 5%)，降低债券部分要素权重至 75%。

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、南方智信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 $\times$ 60%+上证国债指数收益率 $\times$ 30%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%

调整后新业绩比较基准：中证 800 指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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，从而在控制风险的基础上力争实现基金资产的长期稳定增值。原业绩比较基准中，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，更适合作为本基金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 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。

18、南方安康混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：上证国债指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%

调整后新业绩比较基准：中债-综合财富（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

（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。原业绩比较基准中，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（总值）指数（指数代码 CBA00201）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。

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 90%，降低股票部分要素权重至 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、南方改革机遇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×60%+上证国债指数收益率×40%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+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%，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。

20、南方军工改革灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证军工指数收益率} \times 80\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证军工指数收益率} \times 90\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 10\%$

（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%，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、南方平衡配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 50\% + \text{中证全债指数收益率} \times 50\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 75\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 25\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

结合本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。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，与基金实际持股风格更为匹配，更适合作为本基金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。原业绩比较基准中的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 75%，降低债券部分要素权重至 25%。

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、南方医药创新股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 20\% + \text{上证国债指数收益率} \times 15\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通医药卫生综合指数（人民币）收益率} \times 25\% + \text{中债-综合财富（1-3 年）指数收益率} \times 10\%$

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

结合本基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，重点投资于医药创新主题相关的优质上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例范围为 80%-95%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%），投资于医药创新主题证券占非现金基金资产的比例不低于 80%。原业绩比较基准中，中证港股通综合指数（人民币）（指数代码 930933）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，中证港股通医药卫生综合指数（人民币）（指数代码 930975）从港股通范围内选取 50 只流动性较好、市值较大的医疗卫生行业上市公司证券作为指数样本，以反映港股通范围内医药卫生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，

业绩比较基准中 A 股股票部分权重保持 65%不变，提高港股通股票部分权重至 25%，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、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：人民币三年期定期存款利率（税后）+2%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 75%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 25%

(2) 新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金主要投资于股票、债券等资产。本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性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，挖掘优质公司，从而在控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。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，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。指数样本量大，行业覆盖面广，适合作为本基金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。中债-综合全价（总值）指数（指数代码 CBA00203）的指数成份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，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要素更加契合本基金投资的主要资产类别。

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，本基金将股票资产与债券资产所对应的基准要素权重分别设置为 25%与 75%。

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、南方利安灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：人民币三年期定期存款利率（税后）+2%

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

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

本基金主要投资于股票、债券等资产。本基金的股票资产采用全市场选股策略，通过定性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，挖掘优质公司，从而在控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。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。指数样本量大，行业覆盖面广，适合作为本基金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。中债-综合全价（总值）指数（指数代码 CBA00203）的指数成份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，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要素更加契合本基金投资的主要资产类别。

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，本基金将股票资产与债券资产所对应的基准要素权重分别设置为 10%与 90%。

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、南方新材料股票型发起式证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中证新材料主题指数收益率 $\times$ 75%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%+恒生原材料业指数（人民币）收益率 $\times$ 5%

调整后新业绩比较基准：中证新材料主题指数收益率 $\times$ 85%+恒生综合行业指数-原材料业收益率 $\times$ 5%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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 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。

26、南方新兴消费增长股票型证券投资基金（LOF）

（1）当前业绩比较基准：中证内地消费主题指数收益率×55%+中证港股通主要消费综合指数（人民币）收益率×30%+中证综合债指数收益率×15%

调整后新业绩比较基准：中证内地消费主题指数收益率×65%+中证港股通主要消费综合指数（人民币）收益率×25%+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。中证综合债指数（指数代码 H11009）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 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 65%和 25%），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。

27、南方高端装备混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率 $\times$ 75%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 5%

调整后新业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率 $\times$ 80%+中证港股通工业综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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，本基金主要投向“高端装备”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（人民币）（指数代码 930933）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，中证港股通工业综合指数（人民币）（指数代码 930972）在中证港股通综合指数样本中，按中证行业分类标准进行分类，以进入工业一级行业的全部证券作为样本编制指数，以反映港股通公司中工业行业证券的整体表现，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。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 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。

28、南方景气前瞻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 $\times$ 60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准：中证 800 成长指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 20%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 10%

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

结合基金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，从而在控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。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 成长指数（指数代码 H30355）从中证 800 指数样本中，选取成长因子得分最高的 150 只证券作为指数样本，并采用成长因子得分调整后的自由流通市值加权，反映中证 800 指数样本中具有成长特征的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 A 股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 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。

29、南方天元新产业股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 90%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 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%，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。

30、南方全球精选配置证券投资基金

（1）当前业绩比较基准 MSCI 世界指数（MSCI World Index） $\times$ 60%+MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index） $\times$ 40%

调整后新业绩比较基准：MSCI 世界指数（MSCI World Index）收益率 $\times$

36%+MSCI 新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index) 收益率 $\times$ 18%+彭博全球综合指数 (Bloomberg Global-Aggregate Total Return Index Value Unhedged USD) 收益率 $\times$ 36%+中债-综合财富 (1-3 年) 指数收益率 $\times$ 10%

(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, 本基金遵循全球资产有效配置的投资理念, 通过全球宏观经济和各经济体发展的深入调查研究, 实现基金资产在资产类别以及区域中的有效配置。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, 选取彭博全球综合指数 (Bloomberg Global-Aggregate Total Return Index Value Unhedged USD) 和中债-综合财富 (1-3 年) 指数作为固定收益类资产的业绩比较基准要素。彭博全球综合指数 (Bloomberg Global-Aggregate Total Return Index Value Unhedged USD) 是衡量全球投资级债券的旗舰指标, 覆盖 27 个本币市场, 包括来自发达市场和新兴市场发行人的国债、政府相关债券、公司债及证券化固定利率债券。该指数具备较强的市场代表性、客观性和较高的透明度, 适合作为本基金境外固定收益类资产部分的业绩比较基准要素。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, 适合作为本基金境内固定收益类资产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权益类资产权重至 54%, 调整固定收益类资产要素权重至 46%。

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、南方多利增强债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 中央国债登记结算公司中债总指数 (全价)

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 $\times$ 85%+中

证可转债及可交换债券指数收益率 $\times$ 15%

(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。原业绩比较基准为中央国债登记结算公司中债总指数（全价）（指数代码CBA00303），该指数成份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。

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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，选取中债-信用债总全价（总值）指数和中证可转债及可交换债券指数作为业绩比较基准要素。同时基于本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%，将信用债与可转债所对应的基准要素权重分别设置为85%与15%。

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，适合作为本基金信用债债券部分的业绩比较基准要素。中证可转债及可交换债券指数（指数代码931078）样本券由沪深交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券组成。指数采用市值加权计算，以反映沪深交易所可转换公司债券和可交换公司债券的整体表现，适合作为本基金可转债债券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。

32、南方广利回报债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中证全债指数

调整后新业绩比较基准：中债-综合财富（1-3年）指数收益率 $\times$ 60%+中证可转债及可交换债券指数收益率 $\times$ 25%+中证800指数收益率 $\times$ 15%

(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。原业绩比较基准为中证全债指数（指数代码 H11001），样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场两个市场的国债、金融债券及企业债券。

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。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，更适合作为本基金纯债部分的业绩比较基准要素。

本基金可以投资可转债，根据过往组合的投资情况，本基金在业绩比较基准中增加可转债资产的表征指数。中证可转债及可交换债券指数（指数代码 931078）样本券由沪深交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券组成，可以反映沪深交易所可转换公司债券和可交换公司债券的整体表现，适合作为本基金可转债部分的业绩比较基准要素。

本基金可以投资股票，根据过往组合的投资情况，本基金在业绩比较基准中增加股票资产的表征指数。本基金的股票资产采用全市场选股策略，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，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，适合作为本基金股票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，将业绩基准中的纯债部分、可转债部分及股票部分分别设置 60%、25%和 15% 的权重。

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、南方双元债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中证全债指数

调整后新业绩比较基准：中债-信用债总财富（1-3 年）指数收益率×90%+

中证可转债及可交换债券指数收益率 $\times 10\%$

(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。原业绩比较基准为中证全债指数(指数代码 H11001), 样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场两个市场的国债、金融债券及企业债券。

本基金的债券资产采用全市场策略, 将通过投资信用类债券和可转换债券, 以提高组合收益能力。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, 选取中债-信用债总财富(1-3 年)指数和中证可转债及可交换债券指数作为业绩比较基准要素。同时基于本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%, 投资于信用债券和可转换债券的比例合计不低于债券资产的 80%, 将信用债与可转债所对应的基准要素权重分别设置为 90%与 10%。

调整后的新业绩比较基准中, 中债-信用债总财富(1-3 年)指数(指数代码 CBA02721)由信用类债券组成, 是一个反映境内剩余期限在 1 年至 3 年(含 1 年)之间的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, 适合作为本基金信用债债券部分的业绩比较基准要素。中证可转债及可交换债券指数(指数代码 931078)样本券由沪深交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券组成。指数采用市值加权计算, 以反映沪深交易所可转换公司债券和可交换公司债券的整体表现, 适合作为本基金可转债债券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。

34、南方润元纯债债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 中证全债指数

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 $\times 80\%$ +中债-金融债券总财富(总值)指数收益率 $\times 20\%$

(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, 对固定收益类金融工具的投资比例合

计不低于基金资产的 80%，其中对信用类固定收益金融工具和银行存款的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。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，选取中债-信用债总财富(总值)指数和中债-金融债券总财富(总值)指数分别作为信用债与利率债的业绩比较基准要素，同时将信用债与利率债所对应的基准要素权重分别设置为 80%与 20%。

原业绩比较基准为中证全债指数（指数代码 H11001），样本包括银行间债券市场和沪深交易所债券市场两个市场的国债、金融债券及企业债券。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-金融债券总财富(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，适合作为本基金信用债部分的业绩比较基准要素。中债-金融债券总财富（总值）指数成份券由政策性银行债组成，是一个反映境内政策性银行债券整体价格走势情况的总指数，是中债指数应用最广泛指数之一，适合作为本基金利率债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、南方信元债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中债-固定利率债券全价（1-3 年）指数收益率
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

（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-固定利率债券全价（1-3 年）指数（指数代码 CBA00423）指数成份券由在境内公开发行且上市流通的附息式固定利率的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，是一个反映境内固定利率债券整体价格走势情况的指数。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。

36、南方稳福 120 天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 $\times 90\%$ +银行活期存款利率（税后） $\times 10\%$

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（1 年以下）指数收益率

（2）新的业绩比较基准选择原因及合理性：

基于基金投资目标、本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益，过往组合久期整体偏向于短久期，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-综合全价（1 年以下）指数。原业绩比较基准中，中债综合指数（指数代码 CBA00203）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-综合全价（1 年以下）指数（指数代码 CBA00213）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 年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现，适合作为本基金业绩比较基准要素。因此调整后的中债-综合全价（1 年以下）指数更适合作为本基金业绩比较基准要素。同时调整业绩比较基准要素的权重，取消原银行活期存款利率（税后）权重。

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。

37、南方稳航 120 天滚动持有债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 90\% + \text{银行活期存款利率 (税后)} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（1 年以下）指数收益率

(2) 新的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，本基金主要采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置，在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益，过往组合久期整体偏向于短久期，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-综合全价（1 年以下）指数。原业绩比较基准中，中债综合指数（指数代码 CBA00203）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-综合全价（1 年以下）指数（指数代码 CBA00213）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 年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现，适合作为本基金业绩比较基准要素。因此调整后的中债-综合全价（1 年以下）指数更适合作为本基金业绩比较基准要素。同时调整业绩比较基准要素的权重，取消原银行活期存款利率（税后）权重。

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。

38、南方稳瑞 90 天持有期债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 85\% + \text{中证可转换债券指数收益率} \times 5\% + \text{银行活期存款利率 (税后)} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（1 年以下）指数收益率

(2) 新的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，本基金将采取自上而下的投资

策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益，过往组合久期整体偏向于短久期，根据组合过往债券配置情况，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、认可度等，将债券指数调整为中债-综合全价（1 年以下）指数。原业绩比较基准中，中债综合指数（指数代码 CBA00203）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-综合全价（1 年以下）指数（指数代码 CBA00213）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 年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现，适合作为本基金业绩比较基准要素。因此调整后的中债-综合全价（1 年以下）指数更适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。同时调整业绩比较基准要素的权重，取消原中证可转换债券指数和银行活期存款利率（税后）权重。

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。

39、南方稳信 180 天持有期债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 90\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（1 年以下）指数收益率

（2）新的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，本基金的债券资产采用全市场策略，在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益，过往组合久期整体偏向于短久期，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-综合全价（1 年以下）指数。原业绩比较基准中，中债综合指数（指数代码 CBA00203）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-综合全价（1 年以下）指数（指数代码 CBA00213）由在境内公开发行人且上市流通的国债、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 年以下，反映境内人民币短久期债券市场整体表现，适合作为本基金业绩比较基准要素。因此调整后的中债-综合全价（1 年以下）指数更适合作为本基金业绩比较基准要素。同时调整业绩比较基准要素的权重，取消原银行活期存款利率（税后）权重。

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。