

长城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，长城基金管理有限公司（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，并更新基金管理人和/或基金托管人信息（如涉及）。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	长城核心优势混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率 $\times 60\%$ + 中债综合财富指数收益率 $\times 30\%$ + 中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算） $\times 10\%$	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 $\times 15\%$ + 中债-综合财富（总值）指数收益率 $\times 10\%$ + 活期存款基准利率 $\times 5\%$
2	长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金	中证新兴产业指数收益率 $\times 55\%$ + 中债综合财富指数收益率 $\times 45\%$	中证新兴产业指数收益率 $\times 85\%$ + 中债-综合财富（总值）指数收益率 $\times 10\%$ + 活期存款基准利率 $\times 5\%$
3	长城健康消费混合型证券投资基金	中证健康产业指数收益率 $\times 40\%$ + 中证消费服务领先指数收益率 $\times 40\%$ + 中债综合财富指数收益率 $\times 20\%$	中证全指主要消费指数收益率 $\times 65\%$ + 中证健康产业指数收益率 $\times 20\%$ + 中证港股通消费主题指数（人民币）收益率 $\times 5\%$ + 中债-综合

			财富（总值）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
4	长城数字经济混合型证券投资基金	中证沪港深数字经济主题指数收益率×80%+中债综合财富指数收益率×20%	中证数字经济主题指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中债-综合财富（总值）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
5	长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×55%+中债总财富指数收益率×45%	中证 800 指数收益率×85%+中债-总财富（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
6	长城双动力混合型证券投资基金	标普中国 A 股 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%	中证 800 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%
7	长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%	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%
8	长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金	恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×60%+中证全债指数收益率×25%+沪深 300 指数收益率×15%	中证港股通综合指数(人民币)收益率×80%+中证全债指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
9	长城久祥灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×55%+中债总财富指数收益率×45%	中证 800 指数收益率×85%+中债-总财富（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%

10	长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×55%+中债综合财富指数收益率×45%	中证 800 相对成长指数收益率×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	长城久源灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率×55%+中债总财富指数收益率×45%	中证 800 指数收益率×75%+中债-总财富（总值）指数收益率×20%+活期存款基准利率×5%
12	长城品质成长混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×20%	中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×25%+中债-综合财富（总值）指数收益率×5%+活期存款基准利率×5%
13	长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金	中证高端装备制造指数收益率×60%+中债综合财富指数收益率×40%	中证高端装备制造指数收益率×85%+中债-综合财富（总值）指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
14	长城景气成长混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×70%+中债综合财富指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×10%	中证 800 指数收益率×80%+中证港股通综合指数（人民币）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	长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金	中证健康产业指数收益率×45%+中债综合财富指数收益率×45%+中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）×	中证健康产业指数收益率×70%+中债-综合财富（总值）指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+活期存款基

		10%	准利率 $\times$ 5%
16	长城半导体产业混合型发起式证券投资基金	中证全指半导体产品与设备指数收益率 $\times$ 70%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数收益率(人民币) $\times$ 10%	中证全指半导体产品与设备指数收益率 $\times$ 80%+中证港股通 TMT 主题指数(人民币)收益率 $\times$ 10%+中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 5%+活期存款基准利率 $\times$ 5%
17	长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金	中国战略新兴产业成份指数收益率 $\times$ 65%+中债总指数收益率 $\times$ 25%+中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 10%	上证科创板综合指数收益率 $\times$ 75%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 10%+中债-总财富(总值)指数收益率 $\times$ 10%+活期存款基准利率 $\times$ 5%
18	长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率 $\times$ 55%+中债总财富指数收益率 $\times$ 45%	中证 800 相对成长指数收益率 $\times$ 85%+中债-总财富(总值)指数收益率 $\times$ 10%+活期存款基准利率 $\times$ 5%
19	长城创新驱动混合型证券投资基金	中证创新驱动主题指数收益率 $\times$ 70%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 10%	中证新兴产业指数收益率 $\times$ 80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 10%+中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 5%+活期存款基准利率 $\times$ 5%
20	长城大健康混合型证券投资基金	中证健康产业指数收益率 $\times$ 70%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 20%+中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$	中证医药卫生指数收益率 $\times$ 60%+恒生医疗保健指数收益率 $\times$ 25%+中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 10%+活期存款基准利率 $\times$

		10%	5%
21	长城价值领航混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率(人民币)×10%	中证 800 价值指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数(人民币)收益率×15%+中债-综合全价(总值)指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
22	长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率×50%+中债综合财富指数收益率×50%	中信成长风格指数收益率×85%+中债-综合财富(总值)指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%
23	长城久稳债券型证券投资基金	中债综合指数(总财富)收益率×90%+1 年期定期存款利率(税后)×10%	中债-综合财富(1-3 年)指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%
24	长城月月鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金	中债综合全价指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%	中债-综合全价(1-3 年)指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%
25	长城三个月滚动持有债券型证券投资基金	中债综合全价(总值)指数收益率*90%+一年期定期存款利率*10%	中债-综合全价(1-3 年)指数收益率×90%+中证可转换债券指数收益率×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》。

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。同时更新基金管理人和/或基金托管人信息（如涉及）以及其他相关表述。基金管理人将一并修订托管协议（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、托管协议（如有）、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.ccfund.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、托管协议（如有）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：400-8868-666

网址：www.ccfund.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）等信息披露文件，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。

长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 22 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、长城核心优势混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 60\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 30\% + \text{中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 15\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 70%调升至 85%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 60%调升至 70%，港股通标的股票部分的基准要素权重由 10%调升至 15%），将债券资产所对应的基准要素权重由 30%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

2、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证新兴产业指数收益率} \times 55\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 45\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证新兴产业指数收益率} \times 85\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，不涉及具体指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票指数要素权重由 55%调升至 85%，债券指数要素权重由 45%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，使其与产品的长期定位相匹配。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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

3、长城健康消费混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证健康产业指数收益率} \times 40\% + \text{中证消费服务领先指数收益率} \times 40\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证全指主要消费指数收益率} \times 65\% + \text{中证健康产业指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通消费主题指数（人民币）收益率} \times 5\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投资于健康消费主题相关股票，本基金界定的健康消费主题包括两大投资类别，分别涉及消费类别股票资产和健康类别股票资产，其中，消费类别指满足居民的基本消费需求，如衣食住行、消费服务等方面的公司，主要涉及行业包括食品饮料、家用电器、农林牧渔、休闲服务等申银万国一级行业。健康类别指体现新时代健康生活需求，如药物研发、医疗服务、养老及体现 ESG（环境、社会、公司治理）责任发展方面的公司，主要涉及行业包括医药生物、公用事业等申银万国一级行

业。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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数由中证健康产业指数、中证消费服务领先指数调整为中证全指主要消费指数、中证健康产业指数、中证港股通消费主题指数(人民币)，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 80%调升至 85%，港股通标的股票部分的基准要素权重设置为 5%），将债券资产所对应的基准要素权重由 20%调低至 5%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，中证消费服务领先指数（指数代码 000806）选取涉及食品饮料、服装、文教体育、医药生物、金融保险、文化传播以及家庭用品等消费服务领域的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映消费服务相关上市公司证券的整体表现；调整后的新业绩比较基准中，中证全指主要消费指数（指数代码 000990）从中证全指主要消费行业中选取符合一定流动性与市值筛选条件的上市公司作为指数样本，以反映主要消费行业内较具代表性与可投资性的上市公司证券的整体表现。中证港股通消费主题指数(人民币)（指数代码 931455）从港股通范围内选取流动性较好、市值较大的 50 只消费主题相关证券作为指数样本，以反映港股通内消费类上市公司证券的整体表现。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

4、长城数字经济混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中证沪港深数字经济主题指数收益率×80%+中债

综合财富指数收益率 $\times 20\%$

调整后新业绩比较基准：中证数字经济主题指数收益率 $\times 65\%$ +中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times 25\%$ +中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times 5\%$ +活期存款基准利率 $\times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产主要投资于数字经济主题相关股票，即主要投向数字产业化和产业数字化相关的上市公司。其中，数字产业化涉及的上市公司，主要包括数字经济运行的基础设施以及在此基础上运行的应用和平台经济相关产业链；产业数字化涉及的上市公司，主要指被数字技术深度改造升级带来的产出增加和效率提升的传统行业。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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从中证沪港深数字经济主题指数调整为中证数字经济主题指数、中证港股通综合指数(人民币)，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重为 65%，港股通标的股票部分的基准要素权重为 25%），将债券资产所对应的基准要素权重由 20%调低至 5%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，中证沪港深数字经济主题指数（指数代码 931583）从内地与香港市场中选取涉及数字经济基础设施和数字化程度较高的应用领域上市公司证券作为指数样本，以反映内地与香港市场数字经济主题上市公司证券的整体表现；调整后的新业绩比较基准中，中证数字经济主题指数（指数代码 931582）选取涉及数字经济基础设施和数字化程度较高的应用领域上市

公司证券作为指数样本，以反映数字经济主题上市公司证券的整体表现。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，以反映港股通范围内上市公司的整体表现。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

5、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 55\% + \text{中债总财富指数收益率} \times 45\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 85\% + \text{中债-总财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济成长过程中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值。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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 55%调升至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重由 45%调低至 10%，将现金类资产所对应的基准要素权重设定为 5%，使其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中，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；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。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

6、长城双动力混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{标普中国 A 股 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 25\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 90\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金充分挖掘上市公司从内生性增长到外延式扩张过程中产生的投资机会，追求基金资产的长期增值。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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从标普中国 A 股 300 指数调整为中证 800 指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 75%调升至 90%，将债券资产所对应的基准要素权重由 25%调低至 5%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，标普中国 A 股 300 指数（指数代码 816000）采用国际上广泛使用的全球行业分类标准(GICS), 选择中国 A 股市场中市值规模大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股, 并根据自由流通市值加权计算；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。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

7、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 75\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 25\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 85\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金重点投资于具备核心竞争力的持续成长性企业，强调对公司核心竞争力的判断，及核心竞争力所拥有的超额收益能力的评估。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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 75%调升至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重由 25%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，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；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。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

8、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{恒生指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 60\% + \text{中证全债指数收益率} \times 25\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 15\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 80\% + \text{中证全债指数收益率} \times 10\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金采用全市场选股策略，以港股通标的股票为主。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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中港股通标的股票部分所对应的基准指数从恒生指数调整为中证港股通综合指数（人民币），调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金港股通标的股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 75%调升至 85%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 15%调低至 5%，港股通标的股票部分的基准要素权重由

60%调升至 80%)，将债券资产所对应的基准要素权重由 25%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，使其与产品的长期定位相匹配。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。

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，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，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数；调整后的新业绩比较基准中，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，以反映港股通范围内上市公司的整体表现。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

9、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 55\% + \text{中债总财富指数收益率} \times 45\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 85\% + \text{中债-总财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，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、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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 55%调升至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重由 45%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，使

其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中，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；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。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

10、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 55\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 45\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 相对成长指数收益率} \times 80\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 15\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产受益于改革红利的相关行业，本基金将深入研究各行业受益于改革红利的程度，选择直接受益于改革红利或在全面深化改革推动下盈利水平长期显著提升的行业和公司，同时综合考虑国家经济政策、经济周期、行业竞争格局和相对估值水平等因素，进行股票资产在各行业及个股间的配置。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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中证 800 相对成长指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 55%调升至 80%，将债券资产所对应的基准要素权重由 45%调低至 15%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，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；调整后的新业绩比较基准中，中证 800 相对成长指数（指数代码 H30357）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。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

11、长城久源灵活配置混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 55\% + \text{中债总财富指数收益率} \times 45\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 75\% + \text{中债-总财富（总值）指数收益率} \times 20\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济成长过程中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值，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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、

准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 55%调升至 75%，将债券资产所对应的基准要素权重由 45%调低至 20%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，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；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；同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

12、长城品质成长混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 10\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 25\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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要素及其权重调整，不涉及具体指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 70%调低至 65%，港股通标的股票部分的基准要素权重由 10%调升至 25%），将债券资产所对应的基准要素权重由 20%调低至 5%，同时基准

要素增加 5%的现金类资产，使其与产品的长期定位相匹配。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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

13、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证高端装备制造指数收益率} \times 60\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 40\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证高端装备制造指数收益率} \times 85\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，不涉及具体指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

根据本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票指数要素权重由 60%调升至 85%，债券指数要素权重由 40%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，使其与产品的长期定位相匹配。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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

14、长城景气成长混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数收益率（人民币）} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 80\% + \text{中证港股通综合指数（人民币）收益率} \times 10\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整,不涉及具体指数调整,并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

根据本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢,将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 90% (其中 A 股股票部分的基准要素权重由 70%调升至 80%,港股通标的股票部分的基准要素权重 10%保持不变),债券指数要素权重由 20%调低至 5%,同时基准要素增加 5%的现金类资产,使其与产品的长期定位相匹配。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。

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,使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

15、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准: 中证健康产业指数收益率 $\times$ 45%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 45%+中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 10%

调整后新业绩比较基准: 中证健康产业指数收益率 $\times$ 70%+中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 15%+中证港股通综合指数(人民币)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及合理性:

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素及其权重调整,不涉及具体指数调整,并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢,将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 55%调升至 80% (其中 A 股股票部分的基准要素权重由 45%调升至 70%,港股通标的股票部分的基准要素权重 10%保持不变),将债券资产所对应的基准要素权重由 45%调低至 15%,同时基准要素增加 5%的现金类资产,使其与产品的长期定位相匹配,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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

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,使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金

份额持有人利益产生实质性不利影响。

16、长城半导体产业混合型发起式证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证全指半导体产品与设备指数收益率} \times 70\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数收益率(人民币)} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证全指半导体产品与设备指数收益率} \times 80\% + \text{中证港股通 TMT 主题指数(人民币)收益率} \times 10\% + \text{中债-综合财富(总值)指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，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，本基金的股票资产主要投向半导体产业主题相关的优质上市公司，在有效控制风险的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。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，将业绩比较基准中港股通标的股票部分所对应的基准指数从中证港股通综合指数(人民币)调整为中证港股通 TMT 主题指数(人民币)，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金港股通标的股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

根据本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 70%调升至 80%，港股通标的股票部分的基准要素权重 10%保持不变），债券指数要素权重由 20%调低至 5%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，使其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

17、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中国战略新兴产业成份指数收益率} \times 65\% + \text{中债总}$

指数收益率 $\times 25\%$ +中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算) $\times 10\%$

调整后新业绩比较基准: 上证科创板综合指数收益率 $\times 75\%$ +中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times 10\%$ +中债-总财富(总值)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及合理性:

此次本基金业绩比较基准调整涉及基准要素及其权重调整, 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科创板股票, 积极把握科创板优质上市公司投资机会, 在控制风险的前提下, 通过组合管理, 力争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、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, 将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从中国战略新兴产业成份指数调整为上证科创板综合指数, 调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金 A 股股票投资情况, 代表性更强。同时, 新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢, 将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 75%调升至 85% (其中 A 股股票部分的基准要素权重由 65%调升至 75%, 港股通标的股票部分的基准要素权重 10%保持不变), 将债券资产所对应的基准要素权重由 25%调低至 10%, 同时基准要素增加 5%的现金类资产, 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。

原业绩比较基准中, 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, 上证科创板综合指数(指数代码 000680)由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本, 并将样本分红计入指数收益, 反映上海证券交易所科创板上市公司证券在计入分红收益后的整体表现。同时, 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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

18、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 55\% + \text{中债总财富指数收益率} \times 45\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 相对成长指数收益率} \times 85\% + \text{中债-总财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，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，通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济成长过程中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值。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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从沪深 300 指数调整为中证 800 相对成长指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 55%调升至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重由 45%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，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；调整后的新业绩比较基准中，中证 800 相对成长指数（指数代码 H30357）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。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

19、长城创新驱动混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证创新驱动主题指数收益率} \times 70\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数收益率 (使用估值汇率折算)} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证新兴产业指数收益率} \times 80\% + \text{中证港股通综合指数 (人民币) 收益率} \times 10\% + \text{中债-综合财富 (总值) 指数收益率} \times 5\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金投资符合创新驱动主题相关的上市公司，在控制风险的前提下，通过组合管理，力争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、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，将业绩比较基准中 A 股股票部分所对应的基准指数从中证创新驱动主题指数调整为中证新兴产业指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金 A 股股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80% 调升至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 70% 调升至 80%，港股通标的股票部分的基准要素权重 10% 保持不变），将债券资产所对应的基准要素权重由 20% 调低至 5%，同时基准要素增加 5% 的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，中证创新驱动主题指数（指数代码 930833）根据企业创新投入和创新产出的指标，选取各个行业中最具创新力的 300 只上市公司证券作为指数样本，以反映创新型上市公司证券的整体表现；调整后的新业绩比较基准中，中证新兴产业指数（指数代码 000964）从沪深市场中选取节能环保产业、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的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场较具代表性的新兴产业上市公司证券的整体表现。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

20、长城大健康混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证健康产业指数收益率} \times 70\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证医药卫生指数收益率} \times 60\% + \text{恒生医疗保健指数收益率} \times 25\% + \text{中债-综合财富（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产围绕大健康投资方向，筛选优质企业进行组合投资，在控制风险的前提下，力争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、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，将业绩比较基准中 A 股股票部分所对应的基准指数从中证健康产业指数调整为中证医药卫生指数，港股通标的股票部分所对应的基准指数从中证港股通综合指数调整为恒生医疗保健指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利

率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 85%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 70%调低至 60%，港股通标的股票部分的基准要素权重由 10%调升至 25%），将债券资产所对应的基准要素权重由 20%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，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。

原业绩比较基准中，中证健康产业指数（指数代码 H30344）选取医疗保健、食品安全、环保等三大产业中市值最大的 100 只证券作为指数样本，反映 A 股中医疗保健、食品安全、环保等行业的整体状况和走势。中证港股通综合指数（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；调整后的新业绩比较基准中，中证医药卫生指数（指数代码 000933）由中证 800 指数的 800 只样本股中全部医药卫生行业成份股编制而成，反映 A 股范围内该行业上市公司证券的整体表现；恒生医疗保健指数（指数代码 HSHCI）反映恒生综合指数里主要经营医疗保健业务成份股公司的表现。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

21、长城价值领航混合型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 70\% + \text{中债综合全价指数收益率} \times 20\% + \text{中证港股通综合指数收益率（人民币）} \times 10\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中证 800 价值指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率} \times 15\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

（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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过积极主动的研究，发现那些基本面优良的公司，以好的价格买入好公司，长期投资优质领先公司，

同时考虑宏观经济趋势及行业景气变化，优化投资组合配置，力争实现长期稳健收益。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，以及指数盘别、市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，将业绩比较基准中 A 股股票部分所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中证 800 价值指数，将港股通标的股票部分的基准要素由中证港股通综合指数调整为中证港股通高股息投资指数(人民币)，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 80%调升至 85%（其中 A 股股票部分的基准要素权重 70%保持不变，港股通标的股票部分的基准要素权重由 10%调升至 15%），将债券资产所对应的基准要素权重由 20%调低至 10%，同时基准要素增加 5%的现金类资产，使其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中，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，中证港股通综合指数（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，以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 800 价值指数（指数代码 H30356）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，能够反映中证 800 指数样本中具有价值特征的上市公司证券的整体表现。中证港股通高股息投资指数（人民币）（指数代码 930915）从符合港股通条件的香港上市公司证券中选取 30 只流动性好、连续分红、股息率高的上市公司证券作为指数样本，采用股息率加权，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，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金

份额持有人利益产生实质性不利影响。

22、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 50\% + \text{中债综合财富指数收益率} \times 50\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中信成长风格指数收益率} \times 85\% + \text{中债-综合财富(总值)指数收益率} \times 10\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，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，本基金的股票资产重点投资在我国经济转型过程中具有良好成长性的创新型上市公司，在严格控制投资风险的基础上，力求实现超过业绩比较基准的收益。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，将业绩比较基准中股票部分所对应的基准指数从中证 800 指数调整为中信成长风格指数，调整后的业绩比较基准要素能够更真实、准确地反映本基金股票投资情况，代表性更强。同时，新增活期存款基准利率作为现金类资产的业绩比较基准要素。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中股票资产所对应的基准要素权重由 50%调升至 85%，将债券资产所对应的基准要素权重由 50%调低至 10%，将现金类资产所对应的基准要素权重设定为 5%，使其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中，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；调整后的新业绩比较基准中，中信成长风格指数（指数代码 CI005920）由中信证券股份有限公司编制，以中信证券三级行业分类标准为基础，选取成长风格标签的三级行业中的所有成份股，可以较好地反映成长风格上市公司股票的整体表现。同时，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

23、长城久稳债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准：中债综合指数(总财富)收益率 $\times$ 90%+1 年期定期存款利率(税后) $\times$ 10%

调整后新业绩比较基准：中债-综合财富（1-3 年）指数收益率 $\times$ 95%+活期存款基准利率 $\times$ 5%

(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涉及基准要素及其权重调整，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，且基于过往实际运作情况，组合久期整体偏向于中短久期。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，将基准要素中债券资产所对应的基准指数从中债综合指数(总财富)调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。基于流动性管理需求，将基准中的现金类资产的基准要素从 1 年期定期存款利率(税后)调整为活期存款基准利率。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中债券指数要素权重由 90%调升至 95%，现金类资产基准要素权重从 10%调低至 5%，使其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中，中债综合指数(总财富)（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。调整后的业绩比较基准中，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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

24、长城月月鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金

(1) 当前业绩比较基准： $\text{中债综合全价指数收益率} \times 80\% + \text{一年期定期存款利率(税后)} \times 20\%$

调整后新业绩比较基准： $\text{中债-综合全价(1-3 年)指数收益率} \times 95\% + \text{活期存款基准利率} \times 5\%$

(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涉及基准要素及其权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

基于本基金投资目标、投资范围和投资策略，在债券类资产上通过大类资产配置策略、组合久期配置策略、信用债（含资产支持证券）投资策略、骑乘策略、杠杆投资策略等进行投资组合管理，且基于过往债券配置情况，组合久期整体偏向于中短久期。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，将基准要素中债券资产所对应的基准指数从中债综合全价指数调整为中债-综合全价（1-3 年）指数。基于流动性管理需求，将基准中的现金类资产的基准要素从 1 年期定期存款利率(税后)调整为活期存款基准利率。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中债券指数要素权重由 80%调升至 95%，现金类资产基准要素权重从 20%调低至 5%，使其与产品的长期定位相匹配，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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中，中债综合全价指数（指数代码 CBA00203）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，反映境内人民币债券市场整体表现。调整

后的业绩比较基准中，中债-综合全价（1-3 年）指数（指数代码 CBA00223）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 1-3 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。

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，使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。

25、长城三个月滚动持有债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 90%+一年期定期存款利率 $\times$ 10%

调整后新业绩比较基准：中债-综合全价（1-3 年）指数收益率 $\times$ 90%+中证可转换债券指数收益率 $\times$ 5%+活期存款基准利率 $\times$ 5%

（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涉及基准要素及其权重调整，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，主要通过债券类属配置、期限配置、久期偏离、信用策略、收益率曲线策略、可转换债券、可交换债券投资策略等进行投资管理，且基于过往债券配置情况，组合久期整体偏向于中短久期。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，将基准要素中债券资产所对应的基准指数从中债综合全价（总值）指数调整为中债-综合全价（1-3 年）指数、中证可转换债券指数。基于流动性管理需求，将基准中的现金类资产的基准要素从 1 年期定期存款利率（税后）调整为活期存款基准利率。

基于本基金资产配置策略、基金投资比例以及过往资产配置比例中枢，将业绩比较基准中债券指数要素权重由 90%调升至 95%，其中，将债券资产中的利率债及信用债的基准要素权重设置为 90%，新增可转债的基准要素，并将权重设置为 5%，现金类资产基准要素权重从 10%调低至 5%，使其与产品的长期定位相匹

配,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投资策略和基金过往实际投资运作等相匹配。

原业绩比较基准中,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,反映境内人民币债券市场整体表现。调整后的业绩比较基准中,中债-综合全价(1-3 年)指数(指数代码 CBA00223)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,适合作为本基金利率债及信用债部分的业绩比较基准要素。中证可转换债券指数(指数代码 000832)由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成,以反映境内市场可转换债券的总体表现,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,使基准能够更好地反映基金的风险收益特征。该调整不会对基金的投资运作、基金份额持有人利益产生实质性不利影响。