

## 中信保诚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，中信保诚基金管理有限公司（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，同时对基金管理人信息及基金托管人信息（如需）进行更新。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	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*80%+中债新综合全价（1-3 年）指数收益率*20%	沪深 300 指数收益率*90%+中债-新综合全价（1-3 年）指数收益率*10%
2	中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金	一年期银行定期存款利率（税后）+3%	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
3	中信保诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金	30%*沪深 300 指数收益率+70%*中债综合（全价）指数收益率	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
4	中信保诚弘远混合型证券投资基金	中证 800 指数收益率*60%+恒生指数收益率*20%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%	中证 A500 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合财富（总值）指数收益率*20%
5	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率*20%+中债综合财富（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（人民币）收益率*10%+中债-综合财富（总值）指数收益率*20%
6	中信保诚 60 天持有期债券型证券投资	中债综合全价（总值）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*80%+一年期定期存款基准利率*20%

	资基金		
7	中信保诚稳泰债券型证券投资基金	中证综合债指数收益率	中债-国债及政策性银行债财富(3-5年)指数收益率*95%+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。基金管理人将一并更新招募说明书、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、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.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）发布。

## 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：400-666-0066

网址：[www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.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，也不保证最低收益和本金安全。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。

中信保诚基金管理有限公司

2026年6月27日

## 附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

### 1、中信保诚新锐回报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\*80%+中债新综合全价(1-3 年) 指数收益率\*20%

**调整后新业绩比较基准：**沪深 300 指数收益率\*90%+中债-新综合全价(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：**

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

基于本基金近年来股票资产的平均仓位，并结合基金合同约定的投资比例限制和产品定位，将业绩比较基准中的股票资产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设置为 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。

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。

### 2、中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金

**(1) 当前业绩比较基准：**一年期银行定期存款利率（税后）+3%

**调整后新业绩比较基准：**沪深 300 指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

#### **(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。

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格的匹配度，兼顾基准指数的表征性和认可度，以及指数市值覆盖、行业与个股分布等，本基金新增沪深 300 指数为股票资产对应的基准指数。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。指数样本量大，行业覆盖面广，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。调整后的业绩比较基准与基金实际投资运作更为匹配，能够更好地反映本基金的产品定位。

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，兼顾基准指数的表征性和认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金将新增中证综合债指数为债券资产对应的基准指数。中证综合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 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，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，将本基金业绩比较基准中的股票资产对应的基准要素权重调整至 50%，债券资产对应的基准要素权重调整至 50%。

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。

### 3、中信保诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金

**(1) 当前业绩比较基准：**30%\*沪深 300 指数收益率+70%\*中债综合（全价）指数收益率

**调整后新业绩比较基准：**沪深 300 指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

#### **(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指数、基准要素权重调整。

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。本基金将债券类资产部分的基准要素从中债综合（全价）指数调整为中证综合债指数。调整前的中债综合（全价）指数隶属于中债总指数族系，成分券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）；调整后的中证综合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 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。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，兼顾基准指数的表征性和认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，调整后的中证综合债指数与基金投资策略更为匹配，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

基于本基金近年来股票资产的平均仓位、投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，将本基金业绩比较基准中的股票资产对应的基准要素权重由 30%调整至 50%，债券资产对应的基准要素权重由 70%调整至 50%。

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。

#### 4、中信保诚弘远混合型证券投资基金

**(1) 当前业绩比较基准：**中证 800 指数收益率\*60%+恒生指数收益率\*20%+中债综合财富（总值）指数收益率\*20%

**调整后新业绩比较基准：**中证 A500 指数收益率\*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率\*20%+中债-综合财富（总值）指数收益率\*20%

##### **(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指数调整，不涉及基准要素权重调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合。综合考虑基准指数与产品定位、投资策略的匹配度，兼顾基准指数的表征性和认可度等，本基金将权益类资产部分的基准要素从中证 800 指数、恒生指数调整为中证 A500 指数、中证港股通综合指数（人民币）。原业绩比较基准中，中证 800 指数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；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，亦包括 H 股及红筹股，反映香港股票市场主要上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现；中证港股通综合指数（人民币）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。调整后的业绩比较基准要素与基金的投资目标和投资策略相匹配，能够更好地反映本基金的产品定位。

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。

#### 5、中信保诚龙腾精选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%+恒生指数收益率

\*20%+中债综合财富（总值）指数收益率\*20%

**调整后新业绩比较基准：**中证 800 指数收益率\*70%+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\*20%

**（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，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合。综合考虑基准指数与产品定位、投资策略的匹配度，兼顾基准指数的表征性和认可度等，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深 300 指数、恒生指数调整为中证 800 指数、中证港股通综合指数（人民币）。原业绩比较基准中，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；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，亦包括 H 股及红筹股，反映香港股票市场主要上市公司的整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中证 800 指数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（人民币）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。调整后的业绩比较基准要素与基金的投资目标和投资策略相匹配，能够更好地反映本基金的产品定位。

基于本基金近年来股票资产的平均仓位、投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，将本基金业绩比较基准中的 A 股股票部分的基准要素权重由 60%调整至 70%，港股通标的股票部分的基准要素权重由 20%调整至 10%。

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。

## **6、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金**

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

**调整后新业绩比较基准：**中债-综合全价（1-3 年）指数收益率\*80%+一年期定期存款基准利率\*20%

**（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指数调整，并按照要求对业绩比较基准表述进行了规范。

本基金在债券资产上主要采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行投资管理。原业绩比较基准中，中债综合全价（总值）指数成分券涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）；调整后的新业绩比较基准中，中债-综合全价（1-3年）指数成分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，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价格走势情况。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，兼顾基准指数的表征性和认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，调整后的中债-综合全价（1-3年）指数与基金投资策略更为匹配，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。

## 7、中信保诚稳泰债券型证券投资基金

**（1）当前业绩比较基准：**中证综合债指数收益率

**调整后新业绩比较基准：**中债-国债及政策性银行债财富（3-5年）指数收益率\*95%+活期存款基准利率\*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指数、基准要素权重调整。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金在债券资产上主要通过投资于精选的优质债券，力求实现基金资产的长期稳定增值及超越业绩比较基准的收益。调整前的中证综合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-国债及政策性银行债财富（3-5年）指数隶属于中债总指数族，成份券由在全国银行间债券市场上市且公开发行的国债和政策性银行债组成，成份券待偿期在3-5年（含3年），反映境内人民币中等久期国债及政策性银行债市场的整体表现。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，兼顾基准指数的表

征性和认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，调整后的中债-国债及政策性银行债财富（3-5年）指数与基金投资策略更为匹配，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。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。

基于基金合同约定的投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，将本基金业绩比较基准中的债券类资产、现金类资产对应的基准要素权重分别调整至 95%、5%，从而使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投资比例限制相匹配。

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。