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，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	中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金	中证红利指数收益率*85%+恒生指数收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*10%	中证红利指数收益率*85%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率*5%+中债-综合财富（1-3年）指数收益率*10%
2	中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金	中证国有企业红利指数收益率*85%+恒生指数收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*10%	中证国有企业红利指数收益率*85%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率*5%+中债-综合财富（1-3年）指数收益率*10%
3	中信保诚成长动力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%	中国战略新兴产业成份指数收益率*65%+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*15%
4	中信保诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）	上证180指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证800价值指数收益率*80%+中债-综合财富（总值）指数收益率*20%
5	中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金	沪深300指数收益率*40%+恒生指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*40%	沪深300指数收益率*45%+恒生指数收益率*35%+中证综合债指数收益率*20%
6	中信保诚周期优选混合型发起式证	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	中证周期100指数收益率*80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债

	券投资基金	率*20%	-综合财富（总值）指数收益率*10%
7	中信保诚四季红混合型证券投资基金	沪深 300 指数收益率*62.5%+中债综合财富（总值）指数收益率*37.5%	中证红利指数收益率*80%+中债-综合财富（总值）指数收益率*20%
8	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率	中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中债-综合财富（总值）指数收益率*20%
9	中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金	30%*沪深 300 指数收益率+70%*中证综合债指数收益率	中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中债-综合财富（总值）指数收益率*20%
10	中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%	中证新兴产业指数收益率*90%+中债-综合财富（总值）指数收益率*10%
11	中信保诚景气优选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%	中证全指指数收益率*80%+恒生指数收益率*5%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*15%
12	中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%	中证全指指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*20%
13	中信保诚新选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%	中证 800 指数收益率*80%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%
14	中信保诚至裕灵活配置混合型证券投资基金	30%*沪深 300 指数收益率+70%*中证综合债指数收益率	中证综合债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
15	中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）	中证综合债指数收益率	中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
16	中信保诚 90 天持有期债券型证券投	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%	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		
17	中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金	中债综合财富（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%	中债-综合财富（3-5 年）指数收益率*85%+中证全指指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
18	中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）	中证综合债指数收益率	中债-综合财富（1-3 年）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%
19	中信保诚优质纯债债券型证券投资基金	中证综合债指数收益率	中证可转换债券指数收益率*50%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*45%+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）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：400-666-0066

网址：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 10 月 31 日

附：业绩比较基准调整原因及合理性说明

1、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中证红利指数收益率*85%+恒生指数收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*10%

调整后新业绩比较基准：中证红利指数收益率*85%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率*5%+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：

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。

本基金在股票资产上重点关注红利主题相关上市公司的投资机会，基金投资于红利主题相关股票（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，本基金将权益类资产部分的基准要素恒生指数调整为中证港股通高股息投资指数（人民币）。原业绩比较基准中，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，中证港股通高股息投资指数（人民币）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、股息率高的上市公司证券作为指数样本，采用股息率加权，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。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。

本基金出于对流动性、有效利用基金资产的考量，适时对债券进行投资。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中债综合财富（总值）指数调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。调整前的中债综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。调整后的中债-综合财富（1-3 年）指数隶属于中债总指数族，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，成分券待偿期在 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。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。

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、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中证国有企业红利指数收益率*85%+恒生指数收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*10%

调整后新业绩比较基准：中证国有企业红利指数收益率*85%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率*5%+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：

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。

本基金在股票资产上重点关注国企红利主题相关上市公司的投资机会，基金投资于国企红利主题相关股票（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，本基金将权益类资产部分的基准要素恒生指数调整为中证港股通高股息投资指数（人民币）。原业绩比较基准中，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，中证港股通高股息投资指数（人民币）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、股息率高的上市公司证券作为指数样本，采用股息率加权，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。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。

本基金出于对流动性、有效利用基金资产的考量，适时对债券进行投资。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中债综合财富（总值）指数调整为中债-综合财富（1-3 年）

指数。调整前的中债综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。调整后的中债-综合财富（1-3 年）指数隶属于中债总指数族，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，成分券待偿期在 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。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。

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、中信保诚成长动力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：中国战略新兴产业成份指数收益率*65%+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*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。

本基金主要投资于代表着新一轮科技革命和未来产业的变革方向的，由于新技术、新产业、新业态或新商业模式催生的具有成长潜力的行业或关键领域中的优质上市公司。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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深 300 指数、恒生指数调整为中国战略新兴产业成份指数、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，中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、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，反映战略新兴产业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。

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80%调整至 85%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 60%调整至 65%，港股通标的股票部分的基准要素权重保持不变），债券资产对应的基准要素权重由 20%调整至 15%。

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、中信保诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）

（1）当前业绩比较基准：上证 180 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证 800 价值指数收益率*80%+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。

本基金的个股选择以自下而上为主，主要投资于市场价格低于其内在价值的股票。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，本基金将权益类资产部分的基准要素从上证 180 指数调整为中证 800 价值指数。原业绩比较基准中，上证 180 指数从沪市证券中选取市值规模较大、流动性较好的 180 只证券作为样本，反映上海证券市场核心上市公司证券整体表现。调整后的新业绩比较基准中，中证 800 价值指数以中证 800 指数为样本空间，根据价值因子计算风格评分，选取价值得分最高的 250 只证券构成中证 800 价值指数。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。

本基金采用自上而下的投资方法，通过整体债券配置、类属配置和个券选择三个层次进行积极投资。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（总值）指数。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。调整后的中债-综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。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。

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、中信保诚新蓝筹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*40%+恒生指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*40%

调整后新业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*45%+恒生指数收益率*35%+中证综合债指数收益率*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要素权重调整，不涉及基准指数调整。

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 60%调整至 80%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 40%调整至 45%，港股通标的股票部分的基准要素权重由 20%调整至 35%），债券资产对应的基准要素权重由 40%调整至 20%。

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：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：中证周期 100 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*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。

本基金在股票资产上主要通过判断经济周期所处阶段，结合各类资产与宏观经济的联动性，重点配置景气度较高、政策和技术壁垒高、长期竞争格局持续优化的标的。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，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周期 100 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，中证周期 100 指数从沪深市场的周期性行业中选取较具代表性的 100 只上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场周期性行业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。

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 80%调整至 90%（其中 A 股股票部分的基准要素权重由 60%调整至 80%，港股通标的股票部分的基准要素权重由 20%调整至 10%），债券资产对应的基准要素权重由 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。

7、中信保诚四季红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*62.5%+中债综合财富（总值）指数收益率*37.5%

调整后新业绩比较基准：中证红利指数收益率*80%+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。

本基金的股票资产重点投资治理结构完善、基本面和成长性好的公司股票，并优先选择持续分红、股息收益率较高的公司股票。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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深 300 指数调整为中证红利指数。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。调整后的新业绩比较基准中，中证红利指数选取 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。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。

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 62.5%调整至 80%，债券资产对应的基准要素权重由 37.5%调整至 20%。

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。

8、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

（1）当前业绩比较基准：50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+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。

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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深 300 指数调整为中国战略新兴产业成份指数。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。调整后的新业绩比较基准中，中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、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，反映战略新兴产业上市公司证券的整体表现。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（总值）指数。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。调整后的中债-综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。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。

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 50%调整至 80%，债券资产对应的基准要素权重由 50%调整至 20%。

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。

9、中信保诚至利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%*中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+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。

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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深 300 指数调整为中国战略新兴产业成份指数。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。调整后的新业绩比较基准中，中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、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，反映战略新兴产业上市公司证券的整体表现。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（总值）指数。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。调整后的中债-综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。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。

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 80%，债券资产对应的基准要素权重由 70%调整至 20%。

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。

10、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）

（1）当前业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%

调整后新业绩比较基准：中证新兴产业指数收益率*90%+中债-综合财富

（总值）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同时涉及基准指数、基准要素权重调整。

本基金将在行业配置的基础上，分别采取相应策略，对周期类行业与稳定类行业内的个股进行精选。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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深300指数调整为中证新兴产业指数。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。调整后的新业绩比较基准中，中证新兴产业指数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。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。

本基金采用久期控制下的债券积极投资策略，满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（总值）指数。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。调整后的中债-综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。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。

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80%调整至90%，债券资产对应的基准要素权重由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。

11、中信保诚景气优选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：中证全指指数收益率*80%+恒生指数收益率*5%+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：

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。

本基金优选在未来一段时间内行业景气度向上或维持高位，景气周期相对较长的行业和产业方向，并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，本基金将权益类资产部分的基准要素从中证 800 指数调整为中证全指指数。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。调整后的新业绩比较基准中，中证全指指数由上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的股票和存托凭证组成样本，具有较高的市场代表性，反映上交所、深交所和北交所市场上市公司的整体表现。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中债综合财富（总值）指数调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。调整前的中债综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。调整后的中债-综合财富（1-3 年）指数隶属于中债总指数族，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，成分券待偿期在 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。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。

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80%调整至85%（其中A股股票部分的基准要素权重由60%调整至80%，港股通标的股票部分的基准要素权重由20%调整至5%），债券资产对应的基准要素权重由20%调整至15%。

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。

12、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

（1）当前业绩比较基准：沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

调整后新业绩比较基准：中证全指指数收益率*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：

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。

本基金将灵活运用二级市场定增策略、价值策略、成长策略、主题投资策略进行投资。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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深300指数调整为中证全指指数。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。调整后的新业绩比较基准中，中证全指指数由上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的股票和存托凭证组成样本，具有较高的市场代表性，反映上交所、深交所和北交所市场上市公司的整体表现。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为

中债-综合财富（1-3 年）指数。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。调整后的中债-综合财富（1-3 年）指数隶属于中债总指数族，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，成分券待偿期在 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。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。

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 50%调整至 80%，债券资产对应的基准要素权重由 50%调整至 20%。

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。

13、中信保诚新选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：中证 800 指数收益率*80%+中债-综合全价（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。

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，本基金新增中证 800 指数为股票资产对应的基准指数。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。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，本基金将新增中债-综合全价（总值）指数为债券资产对应的

基准指数。中债-综合全价（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，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 80%，债券资产对应的基准要素权重调整至 20%。

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。

14、中信保诚至裕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%*中证综合债指数收益率

调整后新业绩比较基准：中证综合债指数收益率*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：

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。

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 10%，债券资产对应的基准要素权重由 70%调整至 90%。

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。

15、中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）

（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-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+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同时涉及基准指数、基准要素权重调整。

本基金在债券资产上主要采取跨市场套利、收益率曲线策略和类属配置策

略等对个券进行选择，在严格控制固定收益品种的流动性和信用等风险的基础上，获取超额收益。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（总值）指数。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。调整后的中债-综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。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。

本基金在股票资产上主要通过综合考虑宏观经济趋势、行业发展前景以及个股基本面情况等方面进行投资。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，以及指数市值覆盖、行业与个股分布等，本基金新增沪深 300 指数作为股票部分的基准要素。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，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金新增活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素，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、本基金近年来股票资产的平均仓位，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、股票类资产、现金类资产对应的基准要素权重分别调整至 85%、10%、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。

16、中信保诚 90 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*90%+一年期定期存款利率（税后）*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*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、个券选择策略等策略进行主动投资。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中债-综合全价（总值）指数调整为中债-综合全价（1-3 年）指数。调整前的中债-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。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。

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 80%、20%，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。

17、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金

（1）当前业绩比较基准：中债综合财富（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%

调整后新业绩比较基准：中债-综合财富（3-5 年）指数收益率*85%+中证全指指数收益率*10%+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。

本基金的债券资产主要通过目标久期控制、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主动投资。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，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金将债券类资产部分的基准要素从中债-综合财富（总值）指数调整为中债-综合财富（3-5 年）指数。调整前的中债-综合财富（总值）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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。调整后的中债-综合财富（3-5 年）指数隶属于中债总指数族，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，成分券待偿期在 3-5 年（含 3 年），反映境内人民币中等久期债券市场价格走势情况。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。

本基金的权益资产主要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，本基金将权益类资产部分的基准要素从沪深 300 指数调整为中证全指指数。调整前的沪深 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。调整后的中证全指指数由上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的股票和存托凭证组成样本，具有较高的市场代表性，反映上交所、深交所和北交所市场上市公司的整体表现。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。

基于基金合同约定的投资比例限制、本基金近年来股票资产的平均仓位，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、股票类资产对应的基准要素权重分别调整至 85%、10%，现金类资产对应的基准要素权重保持 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。

18、中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）

（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-综合财富（1-3 年）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%

（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、相对价值配置等策略进行投资管理。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。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。调整后的中债-综合财富（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，成分券待偿期在 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。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。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金新增可转换债券类基准要素及现金类基准要素。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，采用市值加权计算，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。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、可转换债券类资产、现金类资产对应的基准要素权重分别调整至 85%、10%、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。

19、中信保诚优质纯债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：中证可转换债券指数收益率*50%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*45%+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同时涉及基准指数、基准要素权重调整。

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金新增可转换债券类基准要素及现金类基准要素。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，采用市值加权计算，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。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业绩比较基准要素。

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、流动性管理、相对价值配置等策略进行投资。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，本基金将债券类资产部分的基准要素从中证综合债指数调整为中债-综合财富（1-3 年）指数。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。调整后的中债-综合财富（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，成分券待偿期在 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。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。

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可转换债券类资产、纯债债券类资产、现金类资产对应的基准要素权重分别调整至 50%、45%、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。