

中金基金管理有限公司

关于中金睿见优选股票型证券投资基金更新业绩比较基准 相关内容并相应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，中金基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人长沙银行股份有限公司协商一致，对中金睿见优选股票型证券投资基金（A类份额基金代码：026374，C类份额基金代码：026375，以下简称“本基金”）业绩比较基准设定的原因，业绩比较基准要素所涉及的发布机构、代码、查询途径，业绩比较基准收益率的计算方法，管理投资偏离业绩比较基准的方法及未来可能变更业绩比较基准的情况和程序等内容进行补充说明，更新基金管理人、基金托管人信息，并相应修订基金合同等法律文件。

一、更新内容

《中金睿见优选股票型证券投资基金》（以下简称“《基金合同》”）“第十二部分 基金的投资”之“五、业绩比较基准”内容更新如下：

“五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{中证800指数收益率} \times 85\% + \text{恒生指数收益率} \times 5\% + \text{中债-综合全价（总值）指数收益率} \times 10\%$

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于A股股票、港股通股票、债券等资产，相应选取与之匹配的A股指数、港股指数、债券指数作为基准要素。同时基于股票资产占基金资产的比例为80%~95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过全部股票资产的50%等投资比例限制，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90%与10%，其中将股票资产中的A股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别设置为85%与5%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易，基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，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获取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，本基金选取中证 800 指数和恒生指数分别作为 A 股股票和港股通股票部分的基准要素。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数，该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，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

恒生指数是由恒生指数有限公司编制发布，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，具有良好的市场代表性，适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

(3) 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，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-综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-综合全价（总值）指数由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，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投资的业绩比较基准。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素所涉及的发布机构、代码、查询途径

中证 800 指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 000906，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：<https://www.csindex.com.cn>。

恒生指数由恒生指数有限公司编制发布，指数代码为 HSI，指数具体信息详见恒生指数有限公司网站，网址：<https://www.hsi.com.hk>。

中债-综合全价（总值）指数由中债金融估值中心有限公司编制发布，指数

代码为 CBA00203，指数具体信息详见中国债券信息网，网址：
<https://www.chinabond.com.cn>。

3、业绩比较基准收益率的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算业绩比较基准中中证 800 指数、恒生指数、中债-综合全价（总值）指数的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。其中，恒生指数收益率采用估值汇率进行调整，由港元计价折算为人民币计价后，再纳入计算。

4、管理投资偏离业绩比较基准的方法

本基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，在监测业绩比较基准偏离过程中，可以采用合适的基金业绩表现类指标（信息比率、跟踪误差、超额收益、卡玛比率等）。对于股票资产，可以采用股票配置偏离限额（仓位、行业等）、基准成份券覆盖率、主动比率等指标；对于债券资产，可以采用久期中枢、信用风险暴露集中度、含权资产（如有）仓位与结构、最大回撤等指标。以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券外的证券。本基金投资组合相对业绩比较基准要素成份证券和权重可能存在偏离。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

(2) 调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

(3) 中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

(1) 基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的；

(2) 其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。”

二、重要提示

1、《基金合同》的上述修订为根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》规定进行修订，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程序，结合《基金合同》的约定，本基金更新上述业绩比较基准相关内容无需召开基金份额持有人大会。

2、修订后的《基金合同》自 2026 年 6 月 29 日起生效。本公司根据《基金合同》修订内容，同时更新本基金招募说明书及基金产品资料概要相关内容。

3、投资者可以登录基金管理人网站（www.ciccfund.com）或拨打基金管理人的客户服务电话 400-868-1166 咨询有关详情。

2、本公司承诺以诚实信用、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。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

中金基金管理有限公司

2026 年 6 月 27 日