

## 关于中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）修改基金合同、 托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，以及《中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，为进一步优化中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）业绩比较基准，提高基金的资金清算效率，中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，自2025年3月15日起，变更本基金的业绩比较基准，修改《中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）托管协议》（以下简称“托管协议”）清算相关条款。本次基金合同、托管协议修订同时根据实际情况更新了基金管理人住所信息。现将相关事项公告如下：

### 一、变更业绩比较基准

业绩比较基准由“标准普尔高盛商品总收益指数（S&P GSCI Commodity Total Return Index）”变更为“中证CME中国商品消费指数（人民币）收益率”，相应修改基金合同相关内容，同时更新基金管理人住所信息，具体如下：

章节	修改前	修改后
	内容	内容
九、基金合同当事人及其权利义务	(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层	(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 住所：中国（上海）自由贸易试验区 <u>银城路16号19层</u>
十五、基金的投资	(五) 业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为标准普尔高盛商品总收益指数	(五) 业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为 <u>中证CME中国商品消费指数(人民</u>

<p>(S&amp;P GSCI Commodity Total Return Index)。</p> <p>标普高盛商品系列指数于1991年开始发布, 具有较长的编制历史。该系列指数分为现货收益指数、超额收益指数和总收益指数, 其中总收益指数衡量了在保证金全额投资于美国国库券的假定下指数标的期货合约所获得的总收益。标普高盛商品总收益指数是当前国际市场上跟踪资金量最大的商品指数之一, 具有较强的知名度和权威性。</p> <p>该指数的标的资产由流动性高、交投活跃的实物商品期货合约构成。根据现行编制方法, 标准普尔公司每年确定该年被收入指数的合约数量, 合约的筛选标准包括一般胜任条件和交易金额条件。每种商品合约的权重主要根据该商品在过去</p>	<p>币)收益率。</p> <p><b>中证 CME 中国商品消费指数由中证指数有限公司编制, 该指数选取在芝加哥商业交易所集团上市交易的天然气、原油、玉米、大豆、铜、黄金和白银为样本, 以除黄金、白银外的 5 个品种的中国进口量和黄金、白银的中国消费量来确定权重, 以反映在中国经济发展过程中, 与中国市场紧密相关的几类主要商品的综合表现。根据本基金的投资范围和投资比例, 选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。</b></p> <p>如果今后法律法规发生变化, 或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时, 经与基金托</p>
---	--

5年全球的平均生产量计算,用以反映该商品在世界经济中的地位。

该指数目前包含了24种商品,覆盖能源、基础金属、贵金属、农产品四个类别。按照2010年12月31日的美元标价计算,各类商品在标普高盛商品总收益指数的权重如下:

类别	美元权重
能源	66.5%
基础金属	8.3%
贵金属	3.4%
农产品	21.7%
合计	100%

数据来源:标准普尔,截至2010年12月31日

本基金选择标普高盛商品总收益指数作为业绩基准的原因如下:

1、业绩比较基准与基金的投资

管人协商一致,本基金可以在报监管机构备案后变更业绩比较基准并及时公告。

	<p>风格和方法一致。本基金主要投资于全球范围内的商品类基金，而标普高盛商品总收益指数包含的成分及其权重与本基金的投资范围和资产配置具有较好的一致性，能够比较公允地反映基金管理人的投资管理能力；</p> <p>2、指数具有较好的投资可复制性。标普高盛商品总收益指数一般假定持有流动性最强的近月合约，这种编制方法保证了基金管理人所赖以衡量业绩的基准是符合投资现实的；</p> <p>3、业绩比较基准的数据可以合理的频率获取。由于该指数由标准普尔公司公开披露，易于观察和计算，投资人能够以合理的频率获取，保证了基金业绩评价的透明性。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编</p>	
--	--	--

	<p>制该指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报监管机构备案后变更业绩比较基准并及时公告。</p>	
--	--	--

## 二、调整托管协议清算条款

调整托管协议清算相关条款，同时更新基金管理人住所信息，具体如下。

章节	修改前	修改后
	内容	内容
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人</p> <p>名称：中信保诚基金管理有限公司</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>名称：中信保诚基金管理有限公司</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区<u>银城路16号19层</u></p>
八、交易及清算交收	<p>(三) 申购、赎回和基金转换的资金清算</p> <p>2、基金管理人应要求注册登记机</p>	<p>(三) 申购、赎回和基金转换的资金清算</p> <p>2、基金管理人应要求注册登记机</p>

<p><b>安排</b></p>	<p>构开立并管理专门用于办理基金申购赎回等款项清算的“基金清算账户”。基金托管账户与“基金清算账户”间的资金清算遵循“净额清算、净额交收”的原则，即按照托管账户应收资金（包括T+3日申购资金及开放转入转出公告中约定时间进行的基金转换业务的转入款）与托管账户应付额（包括T+8日赎回资金及扣除归基金财产的赎回费、开放转入转出公告中约定时间进行的基金转换业务的转出款及扣除归基金财产的转换费）的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。</p>	<p>构开立并管理专门用于办理基金申购赎回等款项清算的“基金清算账户”。基金托管账户与“基金清算账户”间的资金清算遵循“净额清算、净额交收”的原则，即按照托管账户应收资金（包括申购资金及基金转换业务的转入款）与托管账户应付额（包括赎回资金及扣除归基金财产的赎回费、基金转换业务的转出款及扣除归基金财产的转换费）的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。</p>
------------------	---	---

本次根据上述调整方案对基金合同、托管协议作出的修订对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，属于基金合同约定的无需召开基金份额持有人大会的情形。修订后的基金合同及托管协议自本公告发布之日起生效。

投资者可访问中信保诚基金管理有限公司网站([www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn))或拨打客户服务电话（400-666-0066）咨询相关情况。

本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议；招募说明书、基金产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证

券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

本公告仅对本基金本次调整有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）及相关法律文件。

风险提示：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。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对上述基金表现的保证。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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资人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，全面认识基金的风险收益特征，在了解基金情况及听取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。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

二〇二五年三月十五日