

中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	8
2.4	信息披露方式 .....	9
2.5	其他相关资料 .....	9
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	9
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	9
3.2	基金净值表现 .....	10
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	13
§ 4	管理人报告 .....	13
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	13
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	17
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	18
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	18
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	19
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	19
§ 5	托管人报告 .....	20
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	20
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	20
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	20
§ 6	审计报告 .....	20
6.1	审计报告基本信息 .....	20
6.2	审计报告的基本内容 .....	20
§ 7	年度财务报表 .....	22
7.1	资产负债表 .....	22
7.2	利润表 .....	24
7.3	净资产变动表 .....	25
7.4	报表附注 .....	26
§ 8	投资组合报告 .....	54
8.1	期末基金资产组合情况 .....	54
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	55
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	58
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	58
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12	投资组合报告附注 .....	59
§ 9	基金份额持有人信息 .....	60
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	61
§ 10	开放式基金份额变动 .....	61
§ 11	重大事件揭示 .....	61
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	61
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	62
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4	基金投资策略的改变 .....	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8	其他重大事件 .....	66
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§ 13	备查文件目录 .....	68
13.1	备查文件目录 .....	68
13.2	存放地点 .....	68
13.3	查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中信保诚创新成长混合	
基金主代码	006392	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 01 月 30 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	568,099,384.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
下属分级基金的交易代码	006392	016258
报告期末下属分级基金的份额总额	548,097,187.58 份	20,002,196.47 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极投资于具有较高成长性和较强创新能力的上市公司股票,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上,动态优化调整国内依法发行上市的股票、港股、债券、现金等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 创新成长主题的界定</p> <p>本基金注重挖掘具备较强创新能力、具备创新可持续性、或具备较高成长性的上市公司。本基金将着重挖掘:能够通过产品创新、服务创新、技术创新、流程创新、管理创新或商业模式创新等方式提升创新能力,从而提升生产运营效率、降低成本、提高产品质量或提升客户服务水平,进而提升长期竞争优势或盈利能力的上市公司;或能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司;同时,本基金还将着重挖掘能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。</p> <p>1) 本基金注重挖掘具备较强创新能力的上市公司。</p> <p>①产品创新、服务创新、技术创新:产品创新包括创造某种新产品</p>

	<p>或对某一新或老产品的功能进行创新。服务创新指使潜在用户感受到不同于从前的崭新内容，包括新的设想、新的技术手段转变成新的或者改进的服务方式。技术创新包括开发新技术，或者将已有的技术进行应用创新。企业通过上述创新方式可以进入蓝海，降低成本、提高产品质量、提高企业生产效率、提升客户服务水平等从而提升企业长期竞争优势和盈利能力。</p> <p>②流程创新：包括利用云技术、大数据、机器人、人工智能等技术进行智能化流程改造，提高精准制造和柔性敏捷制造的能力，发展基于互联网的个性化定制、云制造等新型制造模式，从而提升企业制造创新和盈利能力。</p> <p>③管理创新：管理创新指企业把新管理方法、管理工具、管理模式、管理制度等要素组合引入企业管理系统以更有效地实现企业的运作，包括引入外部战略投资者、股权激励、制度创新等。企业通过管理创新，可以提升企业运作效率，解放生产力，从而最终提高盈利能力。</p> <p>④商业模式创新：指企业创造价值的基本逻辑发生了变化。商业模式的创新通常通过改变收入模式、改变企业模式和改变产业模式进行。改变收入模式包括企业重新定位并更好地满足客户需求从而改善企业收入；改变企业模式包括企业重新定位产业链中的位置，通过垂直整合等方式实现盈利模式的改变；改变产业模式包括企业重新定义本产业，进入或者创造一个新产业，从而使企业具备竞争优势。</p> <p>2) 本基金注重挖掘具备创新可持续性的上市公司。本基金重点关注能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司。企业能够通过在产品、技术、材料、工艺、标准等方面的研究和投入，改善竞争能力，增强在市场中的话语权和盈利能力。具体而言，本基金将重点关注研发费用每年超过 2 亿元人民币或研发费用占比销售收入高于 2% 的具备较强创新可持续性的上市公司。</p> <p>3) 本基金注重挖掘具备较高成长性的上市公司。本基金重点关注能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。</p> <p>①对于内生增长型公司，这类公司通常资产盈利能力较强，具备内生增长特质。本基金将重点关注在所属行业或细分行业中主营业务收入增速高于行业平均水平或大于 20% 的上市公司，同时将考察其所处行业的竞争格局、业务模式、经营管理效率、未来成长预期及股票的估值水平，从而做出投资判断和决定。</p> <p>②对于外延增长型公司，这类公司主要通过并购重组等方式实现经营规模扩张的公司。本基金将通过深入的研究，综合评估并购重组企业的行业增长前景；以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应，包括通过并购重组方式实现公司的经营规模扩张、经营效率改善、利润水平大幅提高等，从而做出投资判断和决定。</p> <p>(2) 个股精选</p> <p>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：自上而下地分析</p>
--	---

	<p>行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。</p> <p>由于本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，因而本基金将在前述股票投资策略的基础上严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。</p> <p><b>(3) 灵活调整股票资产配置比例</b></p> <p>本基金主要通过考量盈利增速与估值的匹配程度来灵活调整股票资产的配置比例。具体而言，本基金将采用沪深 300 指数作为市场的代表性指数，基于上市公司定期报告数据或市场预期数据，计算沪深 300 指数的市场市盈率对盈利增长率的比率（PEG），并以此为准调整本基金的股票资产比例配置。当沪深 300 指数的 PEG 大于 3 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 0-50%；当沪深 300 指数的 PEG 大于 2 且小于等于 3 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 40%-80%；当沪深 300 指数的 PEG 小于等于 2 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 50%-95%。基金管理人应当自上述条件触发之日的下一工作日起 10 个交易日内将本基金股票资产比例调整至符合上述比例范围。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <p>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。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，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主动投资。</p> <p><b>4、证券公司短期公司债券投资策略</b></p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p><b>5、资产支持证券投资策略</b></p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p><b>6、股指期货投资策略</b></p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p>
--	--

	<p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>8、权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。</p> <p>9、股票期权投资策略</p> <p>本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>10、融资投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的，本基金将从其最新规定。</p> <p>11、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	<p>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%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	021-60637228
传真	021-50120895	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪	北京市西城区金融大街 25 号



	大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	
办公地址	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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	涂一锴	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
本期已实现收益	-128,223,975.71	-5,500,016.64	-418,562,561.65	-807,792.03	297,185,633.51	-
本期利润	-190,463,858.91	-12,486,185.37	-840,284,968.16	-1,724,950.88	418,269,359.66	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3226	-0.6077	-1.2081	-0.4556	1.2132	-
本期加权平均净值利润率	-11.35%	-21.53%	-38.29%	-15.38%	34.81%	-
本期基金	-11.80%	-12.32%	-24.94%	-15.21%	49.71%	-

份额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
期末可供分配利润	770,606,517.68	27,666,648.65	992,561,711.71	14,265,747.75	1,971,638,583.52	-
期末可供分配基金份额利润	1.4060	1.3832	1.6299	1.6226	2.2211	-
期末基金资产净值	1,374,284,483.53	49,729,577.28	1,731,145,828.42	24,931,373.32	3,361,995,911.02	-
期末基金份额净值	2.5074	2.4862	2.8428	2.8357	3.7874	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
基金份额累计净值增长率	150.74%	-25.66%	184.28%	-15.21%	278.74%	-

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚创新成长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.43%	1.10%	-3.10%	0.53%	-2.33%	0.57%
过去六个月	-15.99%	1.02%	-5.42%	0.56%	-10.57%	0.46%
过去一年	-11.80%	0.99%	-5.35%	0.56%	-6.45%	0.43%

过去三年	-0.89%	1.33%	-17.31%	0.70%	16.42%	0.63%
自基金合同生效起至今	150.74%	1.38%	4.38%	0.71%	146.36%	0.67%

中信保诚创新成长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.58%	1.10%	-3.10%	0.53%	-2.48%	0.57%
过去六个月	-16.25%	1.02%	-5.42%	0.56%	-10.83%	0.46%
过去一年	-12.32%	0.99%	-5.35%	0.56%	-6.97%	0.43%
自基金合同生效起至今	-25.66%	1.07%	-9.49%	0.64%	-16.17%	0.43%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

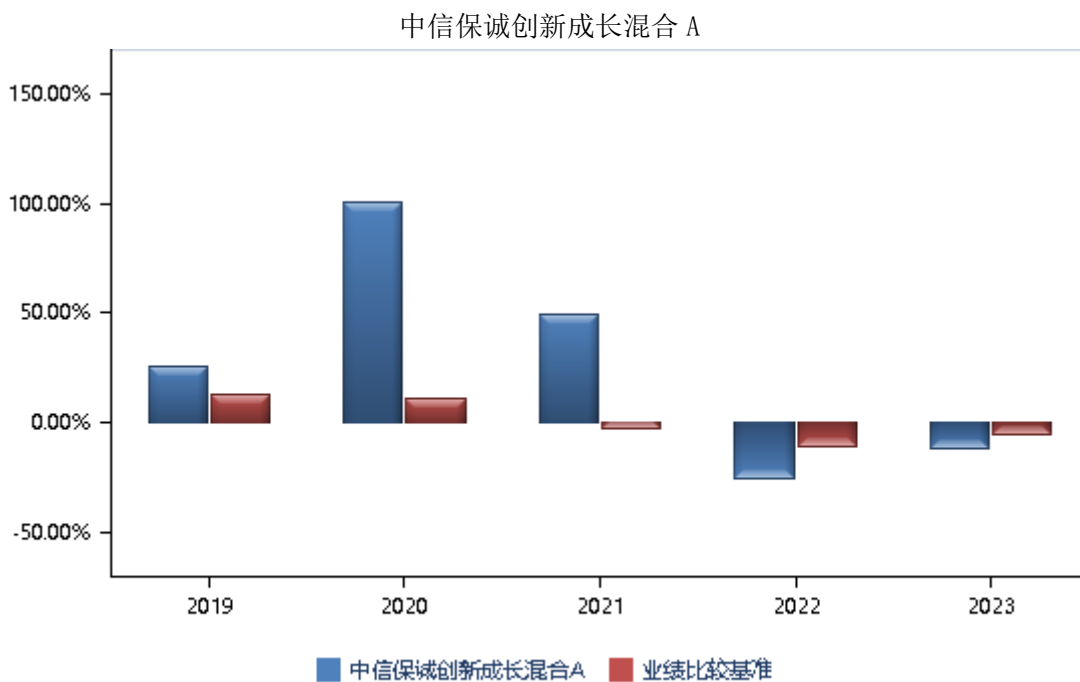
中信保诚创新成长混合 A



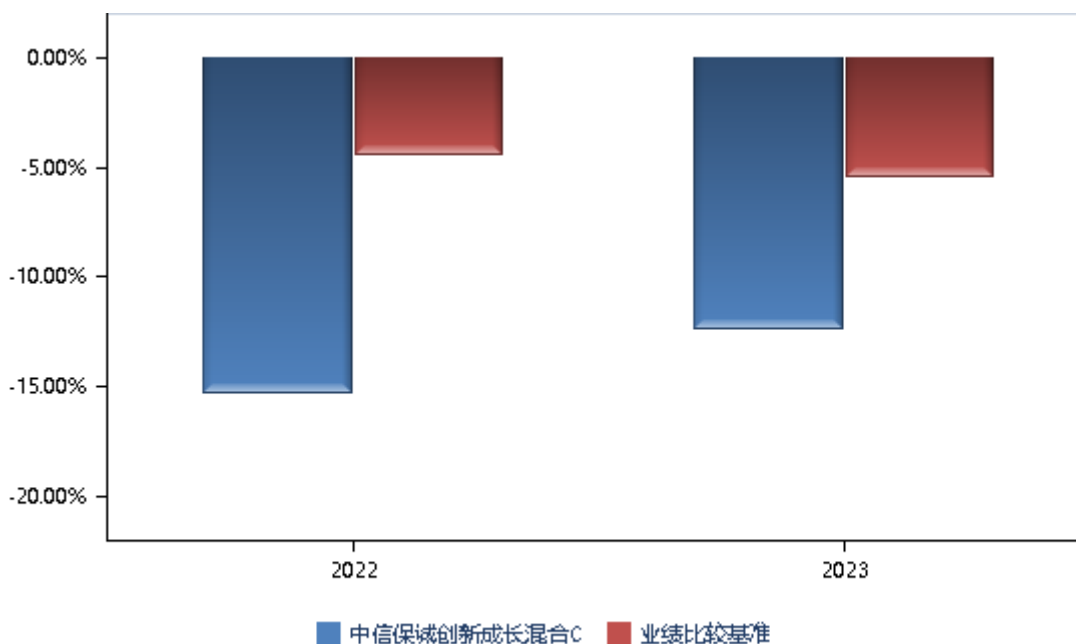
中信保诚创新成长混合 C



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



中信保诚创新成长混合 C



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、保诚集团股份有限公司和新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人管理的运作中基金为 80 只，分别为：中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价

值混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证建筑工程指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金、中信保诚薪金宝货币市场基金、中信保诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳健债券型证券投资基金、中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳悦债券型证券投资基金、中信保诚稳鑫债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、中信保诚稳泰债券型证券投资基金、中信保诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金、中信保诚先

进制造混合型证券投资基金、中信保诚远见成长混合型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王睿	权益投资部总监、基金经理	2019 年 01 月 30 日	-	14	王睿先生，经济学硕士。曾任职于上海甫瀚咨询管理有限公司，担任咨询师；于美国国际集团（AIG），担任投资部研究员。2009 年 10 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、专户投资经理、研究副总监、权益投资部副总监。现任权益投资部总监，中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚远见成长混合型证券投资基金的基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法规

的规定以及基金合同、招募说明书的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司已制订公平交易及异常交易管理相关规定(以下简称公平交易制度)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、资产管理计划),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,对反向交易等进行价差分析。同时,合规及内部审计人员会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司公平交易及异常交易管理相关规定,公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,研究分析方面,公司通过统一的研究平台发布研究成果,并构建投资备选库、



交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资组合经理出具情况说明后签字确认。报告期内，本基金与公司旗下管理的其它产品之间未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每月对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内，未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年 A 股市场整体呈现下跌态势，其中价值股成分较多的上证指数全年下跌 3.7%，相对均衡的沪深 300 全年下跌 11.4%，而代表成长股的创业板指全年下跌接近 20%，中小板指下跌 18%。开年市场出现了一波较为明显的上涨，随后经济的疤痕效应逐渐显现，经济数据低于之前过高的预期，指数出现回调；到下半年，市场预期更为悲观，加之海外通胀迟迟居高不下带来的资金行为，指数进一步下跌。风格上看，包括银行、石油石化、煤炭、电力等高股息类资产全年表现较好；新能源、军工、医药等为代表的成长股下跌较多；传媒、计算机、电子通讯为代表的科技股二季度在海外 AI 浪潮的映射下出现过较大幅度的上涨，但下半年大部分股票回吐了二季度的涨幅。

2023 年国内经济中规中矩，全年 GDP 增长 5.2%，即使考虑到特殊情况带来的基数因素，也算是中高速增长。传统经济中地产链对于经济增长的影响比较明显，无论是新房销售还是地产投资，过去一年都在一个持续下行的通道，四季度包括一线城市在内的各地方政府纷纷放松了对于购房的政策限制，但短期还没有看到对于销售的明显拉动；出口对经济的拉动较 2022 年有所下行，从结构上

看，汽车和机电产品成为新的增长点，对欧美出口占比下降，一路一带国家的占比在提升；2023 年消费对于 GDP 增长的贡献较大，我们认为消费在中国经济中很难成为原生变量，消费的增长更多会随经济增长预期的波动而波动，2023 年国内消费整体平稳，旅游出行等日常消费相对景气，高端奢侈消费有下行趋势。中东地区局势的动荡使得油价和运价居高不下，通胀见顶和美联储降息的时间被推后，美元继续维持相对强势，这也压制了全球风险资产的估值水平。

过去一年成长股的整体表现不尽如人意，也给我们的组合造成了比较明显的损失。在此位置上，我们认为所关注的部分成长股的基本面在 2024 年或有望出现基本面的反转，同时这些资产目前的估值水平是非常低的，很多成长股目前的静态估值甚至比一部分价值股还低；一旦我们对于基本面反转的预期兑现，这些成长股有望存在戴维斯双击的机会。同时，我们也关注到一部分大市值白马股在经历了两到三年维度的调整后定价水平已经接近或者达到相对合理的位置，在对整体市场乐观的情况下，这类资产的或有的上涨机会也很值得期待。我们对目前 A 股市场的前景保持乐观的态度，同时会积极的去寻找符合我们逻辑框架的投资机会，争取通过我们的努力为持有人创造更多的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚创新成长混合 A 份额净值增长率为-11.80%，同期业绩比较基准收益率为-5.35%；中信保诚创新成长混合 C 份额净值增长率为-12.32%，同期业绩比较基准收益率为-5.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，我们认为 2023 年所面临的一些风险因素将有所缓和。国内经济增长相对稳定，一系列政策出台后地产链在销售端和投资端的压力都有望有所缓解；目前中央财政也存在较大的操作空间，我们认为最终实际的财政赤字率有望超过 3%，对于经济增长起到一定保障作用。在政策陆续发力预期兑现以及高基数效应过后，下半年通胀率也有望温和上行。尽管通胀和美元在高位延续的时间的超出了预期，但 2024 年美联储降息是个大概率的事件，这将有效缓解 A 股以及全球风险资产的估值压力。从资本市场自身的角度看，2023 年下半年监管层陆续出台了一系列呵护市场的措施，或显政策底部特征。目前国内权益市场整体的估值水平处在历史相对低位，其中一部分行业的估值甚至处在过去 10 年很低的位置，反映了资本市场过于悲观的预期；结合海内外基本面的改善，我们认为，在此位置上国内权益市场可能隐含的预期回报率是非常有吸引力的。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管要求，将保护基金份额持有人的合法权益放在首位，继续致力于完善公司内部控制机制与合规管理体系，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求，结合公司业务发展实际情况推进公司内控制度建设，完善公司内控制度体系；对产品合同及各类法律文书进行审核；对基金募集、投资过程进行合规检查与提示，规范公司运作与所管理的各类投资组合运作过程中的关联交易，防范不正当关联交易和利益输送，防范内幕交易和利用未公开信息交易，切实维护基金份额持有人、股东和本公司的合法权益；完成各项法定信息披露工作及文档合规检查；根据审计工作计划开展内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作；开展合规培训、法规咨询、更新法规汇编；根据监管部门要求完成各项反洗钱工作，贯彻落实反洗钱监管要求；依法依规完成向监管部门的各项数据报送工作等。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、审慎勤勉的原则管理和运用基金资产，继续加强公司内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、海外投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

在每个估值日，本基金管理人使用估值政策确定的估值方法，确定证券投资基金的份额净值，托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数

量不满二百人的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21700 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中信保诚创新成长混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

	<p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了中信保诚创新成长混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于中信保诚创新成长混合基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中信保诚创新成长混合基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估中信保诚创新成长混合基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算中信保诚创新成长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信保诚创新成长混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风</p>

	<p>险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信保诚创新成长混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信保诚创新成长混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波   俞伟敏
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	164,549,395.08	228,202,098.34
结算备付金		875,376.83	1,084,527.92

存出保证金		169,171.41	378,994.12
交易性金融资产	7.4.7.2	1,261,486,930.43	1,531,463,954.52
其中：股票投资		1,261,486,930.43	1,531,463,954.52
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		374,609.31	685,473.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,427,455,483.06	1,761,815,048.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		798,859.18	1,846,944.81
应付管理人报酬		1,449,033.41	2,291,076.46
应付托管费		241,505.59	381,846.09
应付销售服务费		24,262.30	11,044.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	9.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	927,761.77	1,206,926.02
负债合计		3,441,422.25	5,737,846.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	568,099,384.05	617,760,557.28
未分配利润	7.4.7.8	855,914,676.76	1,138,316,644.46
净资产合计		1,424,014,060.81	1,756,077,201.74
负债和净资产总计		1,427,455,483.06	1,761,815,048.60

注：截止本报告期末，基金份额总额 568,099,384.05 份。其中：中信保诚创新成长混合 A 的基金份额净值 2.5074 元，基金份额总额 548,097,187.58 份；中信保诚创新成长混合 C 的基金份额净值 2.4862 元，基金份额总额 20,002,196.47 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-173,733,168.18	-802,972,190.63
1. 利息收入		918,735.36	1,246,088.19
其中：存款利息收入	7.4.7.9	777,535.50	1,246,088.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		141,199.86	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-107,489,797.77	-387,634,049.65
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-121,205,767.87	-402,840,157.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	2,096,530.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	13,715,970.10	13,109,577.52
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-69,226,051.93	-422,639,565.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,063,946.16	6,055,336.19
<b>减：二、营业总支出</b>		29,216,876.10	39,037,728.41
1. 管理人报酬		24,557,981.72	33,229,741.04
2. 托管费		4,092,997.01	5,538,290.22
3. 销售服务费		346,452.31	30,273.13
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	5.50
8. 其他费用	7.4.7.18	219,445.06	239,418.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-202,950,044.28	-842,009,919.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-202,950,044.28	-842,009,919.04
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-202,950,044.28	-842,009,919.04



### 7.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	617,760,557.28	1,138,316,644.46	1,756,077,201.74
二、本期期初净资产	617,760,557.28	1,138,316,644.46	1,756,077,201.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,661,173.23	-282,401,967.70	-332,063,140.93
（一）、综合收益总额	-	-202,950,044.28	-202,950,044.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-49,661,173.23	-79,451,923.42	-129,113,096.65
其中：1. 基金申购款	247,743,271.63	491,652,711.97	739,395,983.60
2. 基金赎回款	-297,404,444.86	-571,104,635.39	-868,509,080.25
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	568,099,384.05	855,914,676.76	1,424,014,060.81
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	887,686,531.10	2,474,309,379.92	3,361,995,911.02
二、本期期初净资产	887,686,531.10	2,474,309,379.92	3,361,995,911.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-269,925,973.82	-1,335,992,735.46	-1,605,918,709.28
（一）、综合收益总额	-	-842,009,919.04	-842,009,919.04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-269,925,973.82	-493,982,816.42	-763,908,790.24
其中：1. 基金申购款	521,242,494.30	1,197,262,406.30	1,718,504,900.60
2. 基金赎回款	-791,168,468.12	-1,691,245,222.72	-2,482,413,690.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	617,760,557.28	1,138,316,644.46	1,756,077,201.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

董元星

桂思毅

刘卓

基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1372号《关于准予中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 315,317,855.27 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0020 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 315,410,558.63 份基金份额,其中认购资金利息折合 92,703.36 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2022 年 7 月 15 日发布的《关于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》以及修改后的《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,自 2022 年 7 月 15 日起,本基金增设 C 类基金份额,原有基金份额转为 A 类基金份额。其中,在投资人申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人申购时不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%—95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%,投资于创新成长主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金

或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：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%。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以

公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交



易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于2023年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息

红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8

月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	164,549,395.08	228,202,098.34
等于：本金	164,534,865.85	228,178,593.35
加：应计利息	14,529.23	23,504.99
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	164,549,395.08	228,202,098.34

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,609,824,462.68	-	1,261,486,930.43	-348,337,532.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,609,824,462.68	-	1,261,486,930.43	-348,337,532.25
项目	上年度末			

		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,810,575,434.84	-	1,531,463,954.52	-279,111,480.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,810,575,434.84	-	1,531,463,954.52	-279,111,480.32

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	834.18	3,922.11
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	722,427.59	978,503.91
其中：交易所市场	722,427.59	978,503.91
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	80,000.00	100,000.00

应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	927,761.77	1,206,926.02

#### 7.4.7.7 实收基金

中信保诚创新成长混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	608,968,664.41	608,968,664.41
本期申购	206,623,598.84	206,623,598.84
本期赎回（以“-”号填列）	-267,495,075.67	-267,495,075.67
本期末	548,097,187.58	548,097,187.58

中信保诚创新成长混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,791,892.87	8,791,892.87
本期申购	41,119,672.79	41,119,672.79
本期赎回（以“-”号填列）	-29,909,369.19	-29,909,369.19
本期末	20,002,196.47	20,002,196.47

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

#### 7.4.7.8 未分配利润

中信保诚创新成长混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	992,561,711.71	129,615,452.30	1,122,177,164.01
本期期初	992,561,711.71	129,615,452.30	1,122,177,164.01
本期利润	-128,223,975.71	-62,239,883.20	-190,463,858.91
本期基金份额交易产生的变动数	-93,731,218.32	-11,794,790.83	-105,526,009.15
其中：基金申购款	332,478,589.70	79,777,918.57	412,256,508.27
基金赎回款	-426,209,808.02	-91,572,709.40	-517,782,517.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	770,606,517.68	55,580,778.27	826,187,295.95

中信保诚创新成长混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,265,747.75	1,873,732.70	16,139,480.45
本期期初	14,265,747.75	1,873,732.70	16,139,480.45

本期利润	-5,500,016.64	-6,986,168.73	-12,486,185.37
本期基金份额交易产生的变动数	18,900,917.54	7,173,168.19	26,074,085.73
其中：基金申购款	64,892,170.88	14,504,032.82	79,396,203.70
基金赎回款	-45,991,253.34	-7,330,864.63	-53,322,117.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,666,648.65	2,060,732.16	29,727,380.81

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
活期存款利息收入	746,313.71	1,177,035.94
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	23,210.92	48,424.00
其他	8,010.87	20,628.25
合计	777,535.50	1,246,088.19

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	2,111,523,668.98	3,668,722,511.87
减：卖出股票成本总额	2,226,758,731.53	4,061,137,946.48
减：交易费用	5,970,705.32	10,424,722.91
买卖股票差价收入	-121,205,767.87	-402,840,157.52

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
债券投资收益—利息收入	-	832,892.37
债券投资收益—买卖债券（债转股及 债券到期兑付）差价收入	-	1,263,637.98
债券投资收益—赎回差价收入	-	-

债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	-	2,096,530.35

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	84,213,471.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	79,972,970.00
减：应计利息总额	-	2,976,568.35
减：交易费用	-	295.42
买卖债券差价收入	-	1,263,637.98

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利收益	13,715,970.10	13,109,577.52
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,715,970.10	13,109,577.52

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-69,226,051.93	-422,639,565.36
-- 股票投资	-69,226,051.93	-423,215,035.36
-- 债券投资	-	575,470.00
-- 资产支持证券投资	-	-
-- 基金投资	-	-
-- 贵金属投资	-	-
-- 其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
-- 权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-69,226,051.93	-422,639,565.36

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,061,880.74	5,658,395.14
转换费收入	2,065.42	396,941.05
合计	2,063,946.16	6,055,336.19

注：1、本基金的场外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	100,000.00



信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,085.06	1,418.52
账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	360.00	-
合计	219,445.06	239,418.52

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司(“中信保诚基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
Prudential Corporation Holdings Limited(保诚集团股份有限公司)	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,557,981.72	33,229,741.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,273,225.42	11,060,200.63
应支付基金管理人的净管理费	15,284,756.30	22,169,540.41

注：于本报告期内及上年度可比期间，截至2023年8月27日止，支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

根据《中信保诚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致，自2023年8月28日起，支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,092,997.01	5,538,290.22

注：于本报告期内及上年度可比期间，截至2023年8月27日止支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

根据《中信保诚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致，自2023年8月28日起，支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	合计
中信保诚基金	-	105,208.30	105,208.30
合计	-	105,208.30	105,208.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C	合计
中信保诚基金	-	8,816.18	8,816.18
合计	-	8,816.18	8,816.18

注：本基金中信保诚创新成长混合 A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚创新成长混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

中信保诚创新成长混合 C 的销售服务费按前一日中信保诚创新成长混合 C 资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算公式为：中信保诚创新成长混合 C 基金日销售服务费 = 中信保诚创新成长混合 C 基金份额前一日资产净值 × 0.60% / 当年天数

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中信保诚创新成长混合 A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2019 年 01 月 30 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,761,965.57	2,761,965.57
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,761,965.57	2,761,965.57
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.49%	0.45%

注：本基金的基金管理人运用自有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	164,549,395.08	746,313.71	228,202,098.34	1,177,035.94

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末 2023 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

本基金管理人风险管理组织体系包括董事会（及其下设的风控与审计委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等。董事会下设风控与审计委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部

门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险等情况。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本报告期末,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	164,549,395.08	-	-	-	-	-	164,549,395.08



结算备付金	875,376.83	-	-	-	-	-	875,376.83
存出保证金	169,171.41	-	-	-	-	-	169,171.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,261,486,930.43	1,261,486,930.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	374,609.31	374,609.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	165,593,943.32	-	-	-	-	1,261,861,539.74	1,427,455,483.06
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	798,859.18	798,859.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,449,033.41	1,449,033.41
应付托管费	-	-	-	-	-	241,505.59	241,505.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24,262.30	24,262.30
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	927,761.77	927,761.77
负债总计	-	-	-	-	-	3,441,422.25	3,441,422.25
利率敏感度缺口	165,593,943.32	-	-	-	-	1,258,420,117.49	1,424,014,060.81
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	228,202,098.34	-	-	-	-	228,202,098.34
结算备付金	1,084,527.92	-	-	-	-	1,084,527.92
存出保证金	378,994.12	-	-	-	-	378,994.12
交易性金融资产	-	-	-	-	1,531,463,954.52	1,531,463,954.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	685,473.70	685,473.70
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	229,665,620.38	-	-	-	1,532,149,428.22	1,761,815,048.60
负债	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	1,846,944.81	1,846,944.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,291,076.46	2,291,076.46
应付托管费	-	-	-	-	381,846.09	381,846.09
应付销售服务费	-	-	-	-	11,044.07	11,044.07
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	9.41	9.41
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	1,206,926.02	1,206,926.02
负债总计	-	-	-	-	5,737,846.86	5,737,846.86
利率敏感度缺口	229,665,620.38	-	-	-	1,526,411,581.36	1,756,077,201.74

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,261,486,930.43	88.59	1,531,463,954.52	87.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,261,486,930.43	88.59	1,531,463,954.52	87.21

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023 年 12 月 31 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)

			日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	52,435,335.31	61,280,857.57
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-52,435,335.31	-61,280,857.57

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,261,486,930.43	1,531,232,943.72
第二层次	-	-
第三层次	-	231,010.80
合计	1,261,486,930.43	1,531,463,954.52

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	231,010.80	231,010.80
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	48,086.71	48,086.71
转出第三层次	-	357,128.15	357,128.15
当期利得或损失总额	-	78,030.64	78,030.64
其中：计入损益的利得或损失	-	78,030.64	78,030.64
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,111,931.47	2,111,931.47
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,117,682.68	2,117,682.68
转出第三层次	-	5,511,993.51	5,511,993.51
当期利得或损失总额	-	1,513,390.16	1,513,390.16
其中：计入损益的利得或损失	-	1,513,390.16	1,513,390.16
期末余额	-	231,010.80	231,010.80
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	28,123.33	28,123.33

注：于本报告期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	231,010.80	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3486~0.6384	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,261,486,930.43	88.37
	其中：股票	1,261,486,930.43	88.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	165,424,771.91	11.59
8	其他各项资产	543,780.72	0.04
9	合计	1,427,455,483.06	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,008,078,581.05	70.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,720,000.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,820,291.74	6.45
J	金融业	71,518,600.00	5.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	29,667,206.64	2.08
M	科学研究和技术服务业	35,296,000.00	2.48
N	水利、环境和公共设施管理业	6,251.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,380,000.00	1.01
S	综合	-	-
	合计	1,261,486,930.43	88.59

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300316	晶盛机电	2,400,000	105,816,000.00	7.43
2	002129	TCL 中环	4,000,000	62,560,000.00	4.39
3	002179	中航光电	1,479,952	57,718,128.00	4.05

4	300750	宁德时代	324,000	52,896,240.00	3.71
5	601965	中国汽研	1,600,000	35,296,000.00	2.48
6	002025	航天电器	700,000	33,614,000.00	2.36
7	000338	潍柴动力	2,200,000	30,030,000.00	2.11
8	601208	东材科技	2,400,000	29,712,000.00	2.09
9	002594	比亚迪	150,000	29,700,000.00	2.09
10	300033	同花顺	180,000	28,236,600.00	1.98
11	600885	宏发股份	1,000,000	27,640,000.00	1.94
12	600079	人福医药	1,100,000	27,346,000.00	1.92
13	002180	纳思达	1,200,000	27,156,000.00	1.91
14	000768	中航西飞	1,200,000	26,844,000.00	1.89
15	300073	当升科技	700,000	26,740,000.00	1.88
16	600566	济川药业	800,000	25,144,000.00	1.77
17	601881	中国银河	2,000,000	24,100,000.00	1.69
18	002541	鸿路钢构	1,099,960	23,902,130.80	1.68
19	688596	正帆科技	600,000	23,778,000.00	1.67
20	600522	中天科技	1,900,000	23,731,000.00	1.67
21	603019	中科曙光	600,000	23,694,000.00	1.66
22	002050	三花智控	800,000	23,520,000.00	1.65
23	002156	通富微电	1,000,000	23,120,000.00	1.62
24	002463	沪电股份	1,000,000	22,120,000.00	1.55
25	300274	阳光电源	249,926	21,891,018.34	1.54
26	603636	南威软件	1,699,907	21,792,807.74	1.53
27	002402	和而泰	1,500,000	21,435,000.00	1.51
28	600587	新华医疗	800,000	20,632,000.00	1.45
29	002049	紫光国微	300,000	20,235,000.00	1.42
30	001311	多利科技	400,000	19,804,000.00	1.39
31	603300	华铁应急	3,000,000	19,200,000.00	1.35
32	600155	华创云信	2,300,000	19,182,000.00	1.35
33	002384	东山精密	1,000,000	18,180,000.00	1.28
34	002475	立讯精密	499,955	17,223,449.75	1.21
35	300820	英杰电气	300,000	17,184,000.00	1.21
36	688981	中芯国际	300,000	15,906,000.00	1.12
37	300496	中科创达	191,400	15,323,484.00	1.08
38	600894	广日股份	2,000,000	14,700,000.00	1.03
39	603466	风语筑	1,000,000	14,380,000.00	1.01
40	300226	上海钢联	500,000	14,245,000.00	1.00
41	002335	科华数据	500,000	13,840,000.00	0.97
42	688249	晶合集成	800,000	13,800,000.00	0.97
43	688167	炬光科技	120,000	13,680,000.00	0.96
44	688099	晶晨股份	200,000	12,526,000.00	0.88



45	688368	晶丰明源	100,000	10,794,000.00	0.76
46	688408	中信博	150,000	10,762,500.00	0.76
47	600428	中远海特	2,000,000	10,720,000.00	0.75
48	603171	税友股份	300,000	10,614,000.00	0.75
49	301102	兆讯传媒	546,876	10,467,206.64	0.74
50	688378	奥来德	200,000	9,468,000.00	0.66
51	688003	天准科技	250,083	9,383,114.16	0.66
52	002254	泰和新材	600,000	8,976,000.00	0.63
53	688372	伟测科技	100,000	7,840,000.00	0.55
54	600850	电科数字	300,000	6,525,000.00	0.46
55	688429	时创能源	300,000	6,357,000.00	0.45
56	000888	峨眉山 A	700	6,251.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300316	晶盛机电	78,244,853.50	4.46
2	600079	人福医药	52,113,082.92	2.97
3	002129	TCL 中环	51,726,472.43	2.95
4	000831	中国稀土	46,159,759.96	2.63
5	000338	潍柴动力	38,651,393.00	2.20
6	300274	阳光电源	36,544,059.74	2.08
7	601377	兴业证券	35,671,471.55	2.03
8	001311	多利科技	32,169,878.78	1.83
9	600449	宁夏建材	32,085,173.40	1.83
10	002756	永兴材料	31,810,412.21	1.81
11	688378	奥来德	31,629,071.62	1.80
12	002603	以岭药业	31,361,107.97	1.79
13	600155	华创云信	31,238,283.98	1.78
14	688596	正帆科技	31,236,751.12	1.78
15	002541	鸿路钢构	31,103,106.90	1.77
16	688981	中芯国际	31,083,405.41	1.77
17	600428	中远海特	28,651,373.32	1.63
18	603636	南威软件	28,570,332.64	1.63
19	300803	指南针	28,191,953.40	1.61
20	002025	航天电器	28,106,768.00	1.60

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300803	指南针	78,294,978.17	4.46
2	300059	东方财富	69,534,165.85	3.96
3	000831	中国稀土	51,447,559.61	2.93
4	300229	拓尔思	41,862,858.36	2.38
5	600449	宁夏建材	37,542,031.48	2.14
6	300037	新宙邦	37,392,007.68	2.13
7	600570	恒生电子	36,865,781.75	2.10
8	300226	上海钢联	36,412,004.84	2.07
9	000568	泸州老窖	35,621,530.35	2.03
10	002837	英维克	33,695,105.43	1.92
11	601377	兴业证券	33,638,386.13	1.92
12	300408	三环集团	33,257,487.87	1.89
13	002001	新和成	32,080,593.52	1.83
14	000951	中国重汽	31,273,342.94	1.78
15	300415	伊之密	30,793,029.00	1.75
16	002446	盛路通信	30,305,052.36	1.73
17	600905	三峡能源	29,470,463.03	1.68
18	603019	中科曙光	28,799,299.91	1.64
19	300033	同花顺	28,188,952.54	1.61
20	300316	晶盛机电	28,062,983.87	1.60

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,026,007,759.37
卖出股票收入（成交）总额	2,111,523,668.98

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查,或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	169,171.41
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	374,609.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	543,780.72

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信保诚创新成长混合 A	56,977	9,619.62	113,126,330.86	20.64%	434,970,856.72	79.36%
中信保诚创新成长混合 C	4,877	4,101.33	5,395,855.21	26.98%	14,606,341.26	73.02%
合计	61,854	9,184.52	118,522,186.07	20.86%	449,577,197.98	79.14%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	----	-----------	----------

	级别		
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚创新成长混合 A	512,008.45	0.09%
	中信保诚创新成长混合 C	3,858.90	0.02%
	合计	515,867.35	0.09%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中信保诚创新成长混合 A	0~10
	中信保诚创新成长混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚创新成长混合 A	0~10
	中信保诚创新成长混合 C	0
	合计	0~10

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
基金合同生效日（2019 年 01 月 30 日）基金份额总额	315,410,558.63	-
本报告期期初基金份额总额	608,968,664.41	8,791,892.87
本报告期基金总申购份额	206,623,598.84	41,119,672.79
减：本报告期基金总赎回份额	267,495,075.67	29,909,369.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	548,097,187.58	20,002,196.47

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,自 2023 年 1 月 10 日起,唐世春先生不再担任中信保诚基金管理有限公司(以下简称“公司”)常务副总经理职务;自 2023 年 4 月 28 日起,张翔燕女士不再担任公司总经理职务,由涂一锴先生代任总经理职务;自 2023 年 5 月 8 日起,由董元星先生担任公司总经理职务,涂一锴先生不再代任总经理职务;自 2023 年 12 月 22 日起,由刘业伟先生担任公司副总经理职务。上述变更事项已按监管要求公告并备案。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要,任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 80,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据我行审计报告,本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况,本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况;本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚,涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚,或者受到其他有权机关重大行政处罚,或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况;本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	274,124,977.51	6.63%	197,727.16	5.23%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	117,346,691.02	2.84%	110,663.46	2.93%	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	136,073,651.72	3.29%	127,351.27	3.37%	-
光大证券	1	29,618,186.68	0.72%	22,093.38	0.58%	-
广发证券	1	83,496,561.64	2.02%	78,334.15	2.07%	-
国金证券	1	1,693,149,717.33	40.93%	1,559,895.97	41.24%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	315,704,469.26	7.63%	294,935.09	7.80%	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	252,353,075.83	6.10%	235,016.94	6.21%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	289,925,925.38	7.01%	274,238.33	7.25%	-
华创证券	2	33,676,854.00	0.81%	31,026.64	0.82%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	210,171,364.09	5.08%	196,698.58	5.20%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	本报告期 退租
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	28,856,241.81	0.70%	26,874.31	0.71%	-
野村东方 国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	555,255,658.41	13.42%	517,106.53	13.67%	-
中国国际 金融	1	116,987,642.77	2.83%	110,656.88	2.93%	-
中国银河 证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-



长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国 国际 金融	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 17 日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	同上	2023 年 01 月 17 日
3	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	同上	2023 年 03 月 31 日
4	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	同上	2023 年 03 月 31 日
5	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	同上	2023 年 04 月 20 日
6	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	同上	2023 年 04 月 20 日
7	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	同上	2023 年 07 月 19 日
8	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	同上	2023 年 07 月 19 日
9	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基	同上	2023 年 08 月 26

	金 2023 年中期报告提示性公告		日
10	中信保诚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	同上	2023 年 08 月 26 日
11	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2023 年 08 月 26 日
12	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议	同上	2023 年 08 月 26 日
13	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	同上	2023 年 08 月 26 日
14	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	同上	2023 年 08 月 29 日
15	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2023 年 08 月 29 日
16	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2023 年 08 月 29 日
17	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	同上	2023 年 10 月 24 日
18	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	同上	2023 年 10 月 24 日
19	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2023 年 11 月)	同上	2023 年 11 月 30 日
20	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2023 年 11 月 30 日
21	中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2023 年 11 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

无

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2023 年 8 月 26 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 8 月 28 日起调低管理费率、托管费率并对基金合同等法律文件进行修订。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2024 年 03 月 28 日