

中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	18
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	18
§ 6	审计报告	18
6.1	审计报告基本信息	18
6.2	审计报告的基本内容	18
§ 7	年度财务报表	20
7.1	资产负债表	20
7.2	利润表	21
7.3	净资产变动表	22
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12	投资组合报告附注 .....	62
§ 9	基金份额持有人信息 .....	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	63
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.4	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 .....	64
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	64
§ 10	开放式基金份额变动 .....	64
§ 11	重大事件揭示 .....	64
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4	基金投资策略的改变 .....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8	其他重大事件 .....	66
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
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 .....	68
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§ 13	备查文件目录 .....	69
13.1	备查文件目录 .....	69
13.2	存放地点 .....	69
13.3	查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	中信保诚鼎利混合 (LOF)	
场内简称	中信保诚鼎利 LOF	
基金主代码	165528	
基金运作方式	上市开放式基金 (LOF)	
基金合同生效日	2016 年 05 月 24 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,449,792.23 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016 年 08 月 31 日	
下属分级基金的基金简称	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中信保诚鼎利 LOF	-
下属分级基金的交易代码	165528	015937
报告期末下属分级基金的份额总额	82,328,495.26 份	33,121,296.97 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策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股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。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>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上,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>本基金在进行个股筛选时,将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:</p> <p>1) 定性分析:根据对行业的发展情况和盈利状况的判断,从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2) 定量分析:主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标,选取具备选成长</p>

	<p>性好, 估值合理的股票, 主要采用的指标包括但不限于: 公司收入、未来公司利润增长率等; ROE、ROIC、毛利率、净利率等; PE、PEG、PB、PS 等。</p> <p>3、固定收益投资策略 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。</p> <p>4、股指期货投资策略 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据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 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>5、权证投资策略 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>6、资产支持证券投资策略 对于资产支持证券, 本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素, 研究资产支持证券的收益和风险匹配情况, 采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势, 在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p> <p>7、存托凭证投资策略 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>
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。
风险收益特征	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, 属于较高风险、较高预期收益的品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	95588
传真	021-50120895	010-66105798
注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	大楼 9 层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	涂一锴	陈四清

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“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。

## 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	
	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C
本期已实现收益	-30,661,657.06	-18,497,929.37	-12,903,822.54	-925,087.97	17,709,613.83	-
本期利润	-24,095,927.53	-24,191,228.40	-17,142,242.66	-2,763,471.75	3,779,962.22	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3264	-0.9134	-0.4638	-0.3168	0.0912	-
本期加权平均净值利润率	-26.74%	-74.21%	-36.21%	-25.61%	6.05%	-
本期基金份额净值增长率	-6.95%	-7.54%	-28.11%	-1.83%	5.96%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	中信保诚鼎	中信保诚鼎	中信保诚鼎	中信保诚鼎	中信保诚鼎	中信保诚

	利混合 (LOF) A	利混合 (LOF) C	利混合 (LOF) A	利混合 (LOF) C	利混合 (LOF) A	鼎利混合 (LOF) C
期末可供分配利润	6,776,279.86	2,396,627.19	6,883,641.80	3,290,592.21	20,987,727.42	-
期末可供分配基金份额利润	0.0823	0.0724	0.1631	0.1598	0.6179	-
期末基金资产净值	89,104,775.12	35,517,924.16	49,094,345.10	23,884,892.50	54,951,859.18	-
期末基金份额净值	1.0823	1.0724	1.1631	1.1598	1.6180	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	8.23%	-9.23%	16.31%	-1.83%	61.80%	-

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

中信保诚鼎利混合 (LOF) 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	-1.89%	1.45%	-2.88%	0.40%	0.99%	1.05%
过去六个月	-21.30%	1.49%	-4.44%	0.42%	-16.86%	1.07%
过去一年	-6.95%	1.77%	-3.41%	0.42%	-3.54%	1.35%
过去三年	-29.12%	1.82%	-12.38%	0.55%	-16.74%	1.27%
过去五年	37.00%	1.57%	21.05%	0.60%	15.95%	0.97%
自基金合同生效起至今	8.23%	1.36%	26.25%	0.57%	-18.02%	0.79%

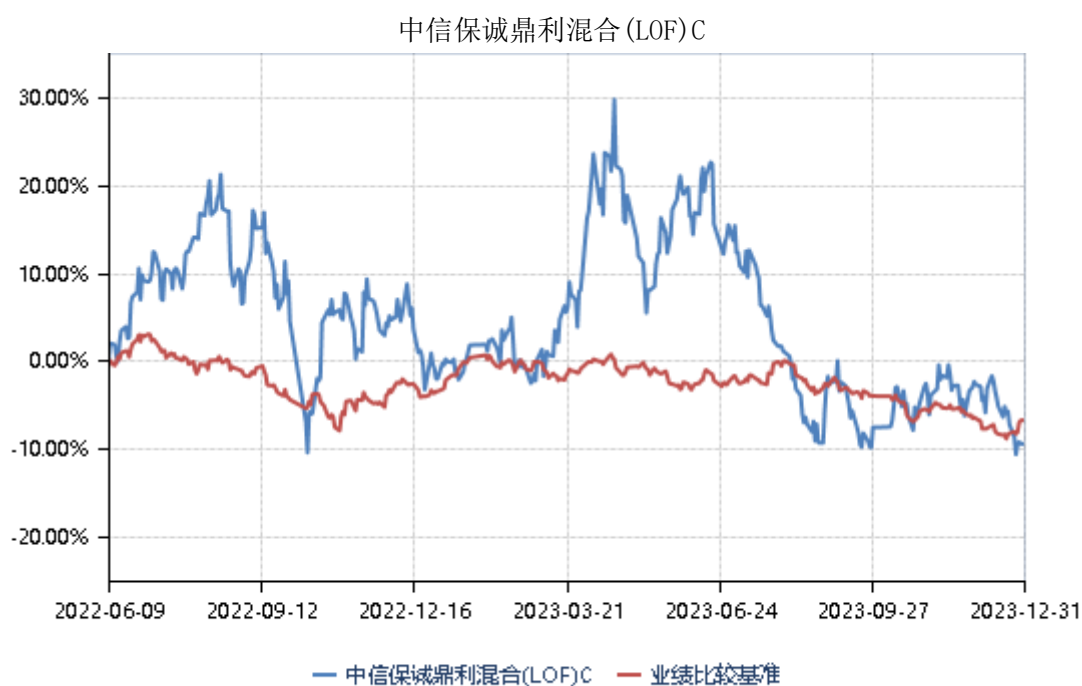
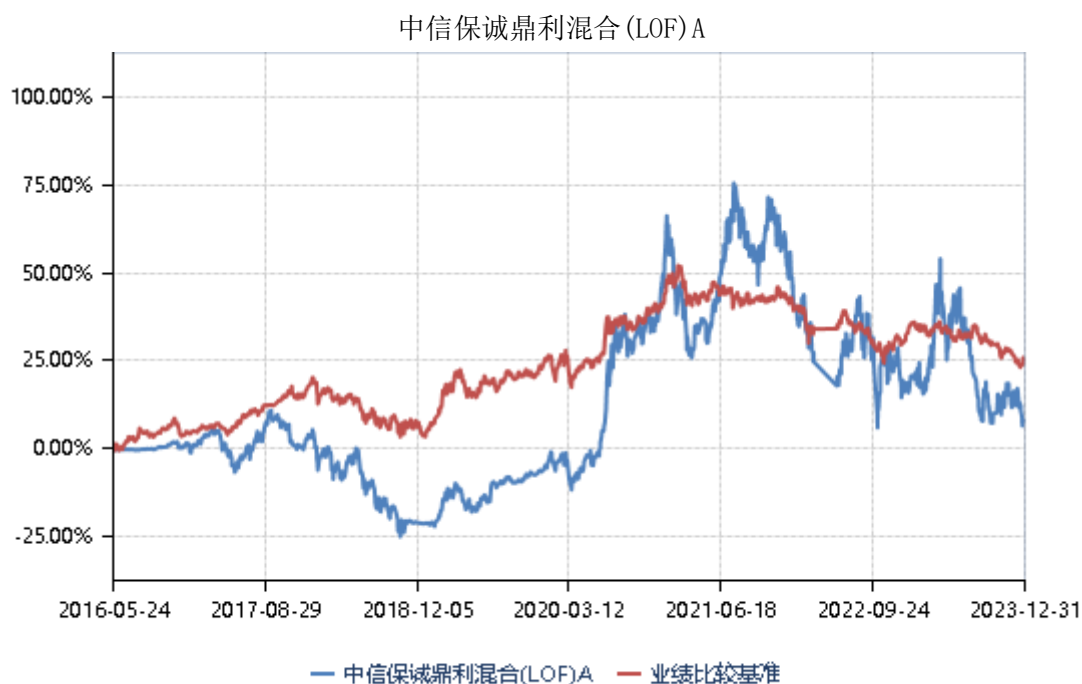
中信保诚鼎利混合 (LOF) C

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	-2.03%	1.45%	-2.88%	0.40%	0.85%	1.05%

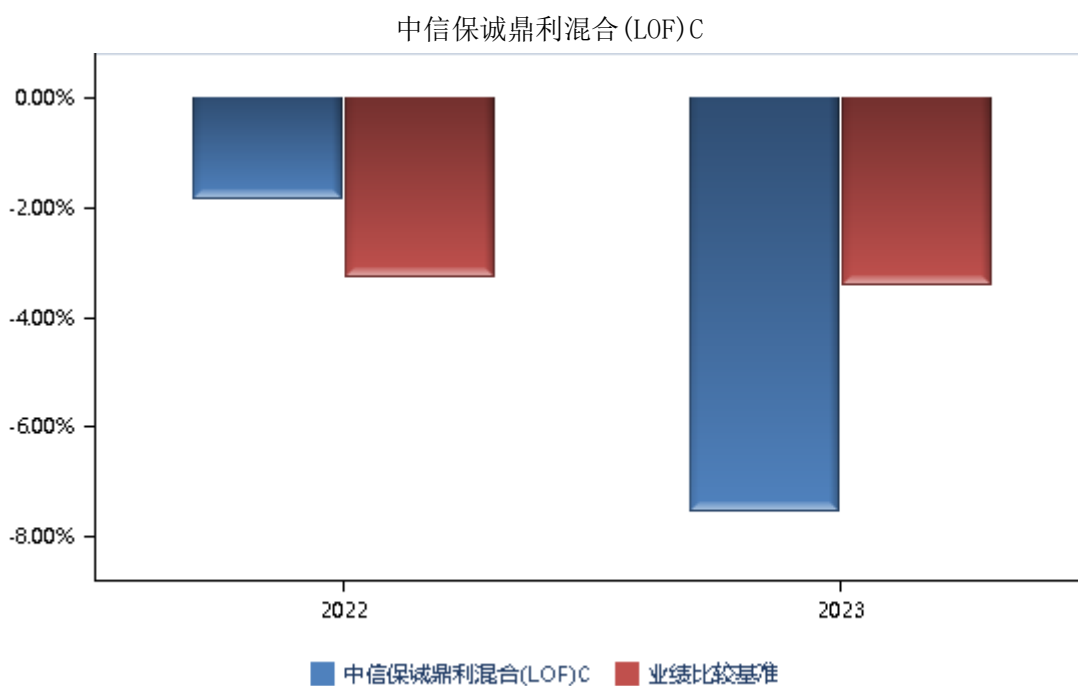
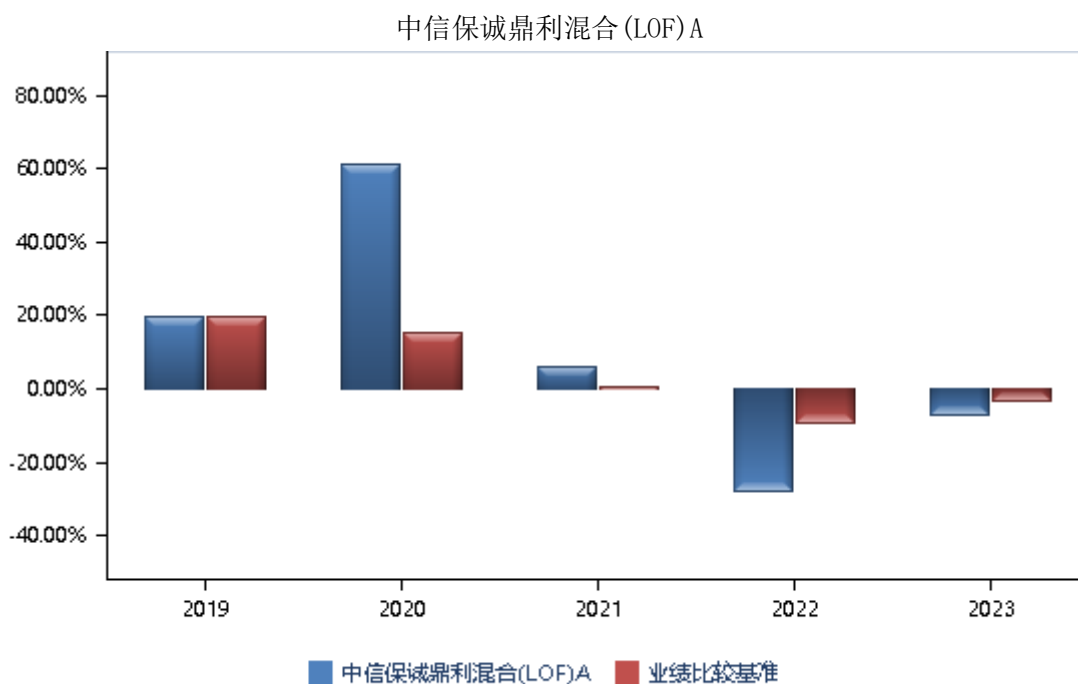


过去六个月	-21.54%	1.49%	-4.44%	0.42%	-17.10%	1.07%
过去一年	-7.54%	1.77%	-3.41%	0.42%	-4.13%	1.35%
自基金合同生效起至今	-9.23%	1.93%	-6.55%	0.47%	-2.68%	1.46%

### 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



### 3.2.3 过去五年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



### 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中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

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	2021 年 08 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

					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。
吴振华	基金经理	2022 年 01 月 05 日	-	7	吴振华先生, 管理学硕士。历任埃森哲(中国)有限公司分析师, 中国证券登记结算有限责任公司工程师, 方正证券研究所研究员。2017 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司, 担任研究员。现任中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚新机遇混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚成长动力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，未发现有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 年全年 GDP 增长 5.2%。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，但我们认为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。

本报告期内，本基金主要关注泛科技行业，聚焦于半导体、人工智能、消费电子等板块。

在当前位置上，我们所关注的部分泛科技成长股的基本面在 2024 年有望出现基本面的反转。同时，这些资产目前的估值水平相对较低，后续如果基本面反转的预期得到兑现，这些成长股或将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比较合理的位置，在对整体市场相对乐观的情况下，这类资产的上涨也值得期待。我们对目前 A 股市场的前景保持乐观的态度，同时积极寻找符合逻辑框架的投资机会，争取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，中信保诚鼎利混合 (LOF) A 份额净值增长率为-6.95%，同期业绩比较基准收益率为-3.41%；中信保诚鼎利混合 (LOF) C 份额净值增长率为-7.54%，同期业绩比较基准收益率为-3.41%。

#### 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缓解。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超出了预期，但如果 2024 年美联储降息，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，政策低位特征明显。目前国内权益市场整体的估值水平处在历史低位，反映了资本市场相对悲观的预期；结合海内外基本面的改善，在此位置上国内权益市场隐含的预期回报率是比较有吸引力的。

#### 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，本基金自 2023 年 2 月 17 日起至 2023 年 3 月 31 日止基金资产净值低于五千万元。截至本报告期末，本基金资产净值不低于五千万元。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内,本基金的管理人--中信保诚基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人依法对中信保诚基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

# § 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 21709 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	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (原信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF), 以下简称“中信保诚鼎利混合基金 (LOF)”) 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> <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鼎利混合基金 (LOF) 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	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。

	按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信保诚鼎利混合基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。
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>中信保诚鼎利混合基金 (LOF) 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鼎利混合基金 (LOF) 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鼎利混合基金 (LOF)、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鼎利混合基金 (LOF) 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, 就可能对中信保诚鼎利混合基金 (LOF) 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鼎利混合基金 (LOF) 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: 中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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	47,252,153.76	8,605,768.96
结算备付金		470,803.29	645,147.01
存出保证金		130,775.51	45,734.73
交易性金融资产	7.4.7.2	93,925,767.56	65,047,162.26
其中: 股票投资		63,407,770.41	65,047,162.26
基金投资		-	-
债券投资		30,517,997.15	-
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	12,452,000.00	-
应收清算款		-	984,713.99

应收股利		-	-
应收申购款		44,548.54	2,790.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		154,276,048.66	75,331,317.81
<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		28,562,726.36	1,837,574.12
应付赎回款		340,405.36	5,803.13
应付管理人报酬		134,180.91	97,752.50
应付托管费		22,363.47	16,292.10
应付销售服务费		20,053.81	12,832.35
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	7.4.7.6	573,619.47	381,826.01
负债合计		29,653,349.38	2,352,080.21
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	115,449,792.23	62,805,003.59
未分配利润	7.4.7.8	9,172,907.05	10,174,234.01
净资产合计		124,622,699.28	72,979,237.60
负债和净资产总计		154,276,048.66	75,331,317.81

注：截止本报告期末，基金份额总额 115,449,792.23 份。其中：中信保诚鼎利混合 (LOF) A 的基金份额净值 1.0823 元，基金份额总额 82,328,495.26 份；中信保诚鼎利混合 (LOF) C 的基金份额净值 1.0724 元，基金份额总额 33,121,296.97 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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>		-45,914,963.11	-18,787,775.62
1. 利息收入		82,655.77	42,515.44

其中：存款利息收入	7.4.7.9	82,655.77	37,916.40
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		-	4,599.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-47,083,118.06	-12,782,472.84
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-47,397,689.29	-12,882,767.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	4,996.94	20,470.14
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	309,574.29	79,824.84
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	872,430.50	-6,076,803.90
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	213,068.68	28,985.68
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,372,192.82</b>	<b>1,117,938.79</b>
1. 管理人报酬		1,687,935.67	800,485.72
2. 托管费		281,322.58	133,414.31
3. 销售服务费		189,996.57	36,301.76
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.18	212,938.00	147,737.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-48,287,155.93</b>	<b>-19,905,714.41</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-48,287,155.93</b>	<b>-19,905,714.41</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-48,287,155.93</b>	<b>-19,905,714.41</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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	62,805,003.59	10,174,234.01	72,979,237.60
二、本期期初净资产	62,805,003.59	10,174,234.01	72,979,237.60

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	52,644,788.64	-1,001,326.96	51,643,461.68
（一）、综合收益总额	-	-48,287,155.93	-48,287,155.93
（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）	52,644,788.64	47,285,828.97	99,930,617.61
其中：1. 基金申购款	205,461,857.12	74,754,564.47	280,216,421.59
2. 基金赎回款	-152,817,068.48	-27,468,735.50	-180,285,803.98
（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	115,449,792.23	9,172,907.05	124,622,699.28
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	33,964,131.76	20,987,727.42	54,951,859.18
二、本期期初净资产	33,964,131.76	20,987,727.42	54,951,859.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	28,840,871.83	-10,813,493.41	18,027,378.42
（一）、综合收益总额	-	-19,905,714.41	-19,905,714.41
（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）	28,840,871.83	9,092,221.00	37,933,092.83
其中：1. 基金申购款	36,276,821.26	11,330,986.77	47,607,808.03
2. 基金赎回款	-7,435,949.43	-2,238,765.77	-9,674,715.20
（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	62,805,003.59	10,174,234.01	72,979,237.60

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

中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (原名为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)，以下简称“本基金”)是根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，由原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转型而来。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金为契约型基金，封闭期是 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)起至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日的期间。封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交

易所转让基金份额。2017 年 11 月 24 日封闭期届满后, 信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)。自 2017 年 11 月 27 日起, 原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金更名为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,236,504,477.82 元, 已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为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”), 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》, 经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准, 公司名称由“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”, 并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2016]第 573 号文审核同意, 本基金 408,791,677.00 份基金份额于 2016 年 8 月 31 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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 6 月 9 日发布的《关于旗下信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》, 自 2022 年 6 月 9 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、深圳证券交易所(以下简称“深交所”)关于基金证券简称相关规则的规定及基金合同的约定, 信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 于 2023 年 9 月 12 日公告后更名为中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围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、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、次级债、可转换债券、可交换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、权证、股指期货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)。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%; 基金持有全部权证的市



值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券，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×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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》、《中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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或金融负债。

###### (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合同现金流量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。其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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 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。

#### 7.4.4.13 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[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]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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(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	47,252,153.76	8,605,768.96
等于：本金	47,248,674.87	8,604,873.48
加：应计利息	3,478.89	895.48
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	47,252,153.76	8,605,768.96

#### 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		63,649,737.63	-	63,407,770.41	-241,967.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	29,998,340.00	514,997.15	30,517,997.15	4,660.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,998,340.00	514,997.15	30,517,997.15	4,660.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		93,648,077.63	514,997.15	93,925,767.56	-237,307.22
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		66,156,899.98	-	65,047,162.26	-1,109,737.72
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	66,156,899.98	-	65,047,162.26	-1,109,737.72

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,452,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	12,452,000.00	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 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	50.93	1.92
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	389,268.54	262,524.09
其中：交易所市场	389,268.54	262,524.09
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
应付审计费	55,000.00	60,000.00
应付信息披露费	120,000.00	50,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
其他	300.00	300.00
合计	573,619.47	381,826.01

#### 7.4.7.7 实收基金

中信保诚鼎利混合 (LOF) 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	42,210,703.30	42,210,703.30
本期申购	85,120,972.11	85,120,972.11
本期赎回 (以“-”号填列)	-45,003,180.15	-45,003,180.15
本期末	82,328,495.26	82,328,495.26

中信保诚鼎利混合 (LOF) 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	20,594,300.29	20,594,300.29
本期申购	120,340,885.01	120,340,885.01
本期赎回 (以“-”号填列)	-107,813,888.33	-107,813,888.33
本期末	33,121,296.97	33,121,296.97

注：1、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)。

2、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

基金代码	基金名称	本报告期末		上年度末	
		场内	场外	场内	场外
155828	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	6,233,167.00	76,096,328.26	6,742,842.00	35,467,861.30
015937	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	-	33,121,296.97	-	20,594,300.29

#### 7.4.7.8 未分配利润

中信保诚鼎利混合 (LOF) 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	16,693,281.86	-9,809,640.06	6,883,641.80
本期期初	16,693,281.86	-9,809,640.06	6,883,641.80
本期利润	-30,661,657.06	6,565,729.53	-24,095,927.53
本期基金份额交易产生的变动数	24,432,620.05	-444,054.46	23,988,565.59
其中：基金申购款	36,616,316.86	-3,165,869.31	33,450,447.55

基金赎回款	-12,183,696.81	2,721,814.85	-9,461,881.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,464,244.85	-3,687,964.99	6,776,279.86

中信保诚鼎利混合 (LOF) 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	8,074,051.55	-4,783,459.34	3,290,592.21
本期期初	8,074,051.55	-4,783,459.34	3,290,592.21
本期利润	-18,497,929.37	-5,693,299.03	-24,191,228.40
本期基金份额交易产生的变动数	14,327,794.90	8,969,468.48	23,297,263.38
其中：基金申购款	45,636,135.20	-4,332,018.28	41,304,116.92
基金赎回款	-31,308,340.30	13,301,486.76	-18,006,853.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,903,917.08	-1,507,289.89	2,396,627.19

#### 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	62,779.35	30,898.59
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	14,772.33	5,981.95
其他	5,104.09	1,035.86
合计	82,655.77	37,916.40

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	1,313,117,177.86	492,373,228.97
减：卖出股票成本总额	1,356,767,379.59	503,847,197.23
减：交易费用	3,747,487.56	1,408,799.56
买卖股票差价收入	-47,397,689.29	-12,882,767.82

#### 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	4,996.94	17.61
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	20,452.53
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	4,996.94	20,470.14

#### 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	-	50,470.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	30,000.00
减：应计利息总额	-	17.62
减：交易费用	-	0.05
买卖债券差价收入	-	20,452.53

#### 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	309,574.29	79,824.84
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	309,574.29	79,824.84

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	872,430.50	-6,076,803.90
-- 股票投资	867,770.50	-6,076,803.90
-- 债券投资	4,660.00	-
-- 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	872,430.50	-6,076,803.90

#### 7.4.7.16 其他收入

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
基金赎回费收入	212,542.98	28,726.86
转换费收入	525.70	258.82
合计	213,068.68	28,985.68

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 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 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
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	738.00	537.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	212,938.00	147,737.00

#### 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	1,687,935.67	800,485.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	389,331.98	296,478.10
应支付基金管理人的净管理费	1,298,603.69	504,007.62

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	281,322.58	133,414.31

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工商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工商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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

### 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		
	中信保诚鼎利混 合 (LOF) A	中信保诚鼎利混 合 (LOF) C	合计
中信保诚基金	-	115,591.60	115,591.60
合计	-	115,591.60	115,591.60
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		
	中信保诚鼎利混 合 (LOF) A	中信保诚鼎利混 合 (LOF) C	合计
中信保诚基金	-	33,120.54	33,120.54
合计	-	33,120.54	33,120.54

注：本基金中信保诚鼎利混合 (LOF) A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚鼎利混合 (LOF) C 基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

中信保诚鼎利混合 (LOF) C 的销售服务费按前一日中信保诚鼎利混合 (LOF) C 资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算公式为：中信保诚鼎利混合 (LOF) C 基金日销售服务费 = 中信保诚鼎利混合 (LOF) 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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行, 本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	47,252,153.76	62,779.35	8,605,768.96	30,898.59

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商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 and 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,517,997.15	-
合计	30,517,997.15	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 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。

本基金持有有一定比例的交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 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	47,252,153.76	-	-	-	-	-	47,252,153.76

结算备付金	470,803.29	-	-	-	-	470,803.29	
存出保证金	130,775.51	-	-	-	-	130,775.51	
交易性金融资产	17,941,951.12	12,576,046.03	-	-	63,407,770.41	93,925,767.56	
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	
买入返售金融资产	12,452,000.00	-	-	-	-	12,452,000.00	
应收清算款	-	-	-	-	-	-	
应收股利	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	-	-	-	-	44,548.54	44,548.54	
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	
其他资产	-	-	-	-	-	-	
资产总计	78,247,683.68	12,576,046.03	-	-	63,452,318.95	154,276,048.66	
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	-	-	-	-	28,562,726.36	28,562,726.36	
应付赎回款	-	-	-	-	340,405.36	340,405.36	
应付管理人报酬	-	-	-	-	134,180.91	134,180.91	
应付托管费	-	-	-	-	22,363.47	22,363.47	
应付销售服务费	-	-	-	-	20,053.81	20,053.81	
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	-	-	-	-	573,619.47	573,619.47	
负债总计	-	-	-	-	29,653,349.38	29,653,349.38	
利率敏感度缺口	78,247,683.68	12,576,046.03	-	-	33,798,969.57	124,622,699.28	
上年度末 2022年12月31	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

日							
资产							
货币资金	8,605,768.96	-	-	-	-	-	8,605,768.96
结算备付金	645,147.01	-	-	-	-	-	645,147.01
存出保证金	45,734.73	-	-	-	-	-	45,734.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	65,047,162.26	65,047,162.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	984,713.99	984,713.99
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,790.86	2,790.86
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,296,650.70	-	-	-	-	66,034,667.11	75,331,317.81
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	-	-	-	-	-	1,837,574.12	1,837,574.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,803.13	5,803.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	97,752.50	97,752.50
应付托管费	-	-	-	-	-	16,292.10	16,292.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,832.35	12,832.35
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	-	-	-	-	-	381,826.01	381,826.01
负债总计	-	-	-	-	-	2,352,080.21	2,352,080.21
利率敏感度缺口	9,296,650.70	-	-	-	-	63,682,586.90	72,979,237.60

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

假设	除市场利率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)
	市场利率下降 25 个基点	11,695.33	-
市场利率上升 25 个基点	-11,679.54	-	

注：于上年度末，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	63,407,770.41	50.88	65,047,162.26	89.13
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	63,407,770.41	50.88	65,047,162.26 89.13

#### 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)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	4,852,618.06	2,789,572.64
	业绩比较基准中的股票指数下降5%	-4,852,618.06	-2,789,572.64

#### 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	63,407,770.41	65,047,162.26
第二层次	30,517,997.15	-
第三层次	-	-
合计	93,925,767.56	65,047,162.26

###### 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	16,182.12	16,182.12
转出第三层次	-	16,733.13	16,733.13
当期利得或损失总额	-	551.01	551.01
其中：计入损益的利得或损失	-	551.01	551.01
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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
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	-	-	-

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。

#### 7.4.14.3 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	63,407,770.41	41.10
	其中：股票	63,407,770.41	41.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,517,997.15	19.78
	其中：债券	30,517,997.15	19.78
	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	12,452,000.00	8.07
	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	47,722,957.05	30.93
8	其他各项资产	175,324.05	0.11
9	合计	154,276,048.66	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	58,388,664.84	46.85
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,019,105.57	4.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	63,407,770.41	50.88

### 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	688361	中科飞测	72,296	5,380,991.28	4.32
2	688072	拓荆科技	22,492	5,202,399.60	4.17
3	300782	卓胜微	36,500	5,146,500.00	4.13
4	688012	中微公司	32,785	5,035,776.00	4.04
5	688099	晶晨股份	80,139	5,019,105.57	4.03
6	603501	韦尔股份	46,715	4,984,957.65	4.00
7	688037	芯源微	28,657	3,828,861.77	3.07
8	688120	华海清科	20,280	3,806,556.00	3.05
9	603290	斯达半导	18,900	3,420,900.00	2.75

10	688200	华峰测控	25,715	3,157,802.00	2.53
11	688213	思特威	49,325	2,740,497.00	2.20
12	688347	华虹公司	58,508	2,502,387.16	2.01
13	605111	新洁能	66,040	2,498,293.20	2.00
14	300373	扬杰科技	67,900	2,491,930.00	2.00
15	688981	中芯国际	44,032	2,334,576.64	1.87
16	688220	翱捷科技	27,770	1,956,118.80	1.57
17	688041	海光信息	18,783	1,333,217.34	1.07
18	688249	晶合集成	75,128	1,295,958.00	1.04
19	688372	伟测科技	16,211	1,270,942.40	1.02

## 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	688037	芯源微	42,917,238.74	58.81
2	688012	中微公司	42,760,272.45	58.59
3	688981	中芯国际	40,321,766.90	55.25
4	688072	拓荆科技	39,832,430.26	54.58
5	688256	寒武纪	37,740,896.18	51.71
6	002371	北方华创	37,214,610.20	50.99
7	688099	晶晨股份	34,951,466.05	47.89
8	002156	通富微电	33,551,015.19	45.97
9	600584	长电科技	33,414,521.70	45.79
10	688120	华海清科	33,171,618.83	45.45
11	688041	海光信息	31,160,988.90	42.70
12	300223	北京君正	29,509,789.56	40.44
13	688362	甬矽电子	29,171,958.53	39.97
14	688249	晶合集成	25,055,251.18	34.33
15	603986	兆易创新	23,101,523.17	31.65
16	002185	华天科技	21,626,460.67	29.63
17	688596	正帆科技	19,992,026.21	27.39
18	688123	聚辰股份	19,148,241.13	26.24
19	688403	汇成股份	18,915,953.64	25.92
20	603005	晶方科技	18,512,890.30	25.37
21	688372	伟测科技	17,227,904.58	23.61
22	688361	中科飞测	16,843,823.35	23.08
23	688082	盛美上海	16,663,054.96	22.83
24	688766	普冉股份	16,616,137.10	22.77
25	603893	瑞芯微	16,077,749.17	22.03

26	688110	东芯股份	15,870,462.90	21.75
27	300782	卓胜微	15,830,202.80	21.69
28	688047	龙芯中科	15,311,699.65	20.98
29	688352	颀中科技	15,217,936.06	20.85
30	688147	微导纳米	15,136,442.42	20.74
31	000021	深科技	14,828,616.15	20.32
32	603501	韦尔股份	14,743,724.35	20.20
33	688252	天德钰	14,232,929.87	19.50
34	688048	长光华芯	13,578,755.46	18.61
35	688018	乐鑫科技	13,291,258.18	18.21
36	301095	广立微	12,602,246.48	17.27
37	688003	天准科技	12,557,932.09	17.21
38	301308	江波龙	11,498,134.60	15.76
39	001309	德明利	11,392,364.00	15.61
40	688601	力芯微	11,035,255.25	15.12
41	688385	复旦微电	11,012,276.51	15.09
42	300604	长川科技	10,794,599.80	14.79
43	300458	全志科技	10,748,929.28	14.73
44	688049	炬芯科技	10,561,875.77	14.47
45	688608	恒玄科技	9,820,513.17	13.46
46	300613	富瀚微	9,242,329.31	12.66
47	688153	唯捷创芯	8,986,206.95	12.31
48	300567	精测电子	8,769,000.00	12.02
49	688332	中科蓝讯	8,339,440.56	11.43
50	688498	源杰科技	8,292,921.24	11.36
51	688508	芯朋微	7,982,170.79	10.94
52	688205	德科立	7,819,753.39	10.72
53	688213	思特威	7,767,953.10	10.64
54	300475	香农芯创	7,715,182.00	10.57
55	688025	杰普特	7,621,094.65	10.44
56	603061	金海通	7,482,372.50	10.25
57	688484	南芯科技	7,412,274.04	10.16
58	688798	艾为电子	7,141,697.69	9.79
59	688368	晶丰明源	7,115,778.55	9.75
60	688486	龙迅股份	7,107,220.31	9.74
61	688220	翱捷科技	7,101,332.11	9.73
62	688396	华润微	7,068,090.10	9.69
63	688711	宏微科技	6,875,298.96	9.42
64	002049	紫光国微	6,807,171.98	9.33
65	688478	晶升股份	6,256,970.63	8.57
66	688167	炬光科技	6,181,704.73	8.47

67	688661	和林微纳	5,931,409.86	8.13
68	688521	芯原股份	5,882,295.33	8.06
69	688279	峰昭科技	5,809,510.86	7.96
70	002222	福晶科技	5,670,371.00	7.77
71	001270	铖昌科技	5,551,742.40	7.61
72	301297	富乐德	5,512,918.00	7.55
73	688416	恒烁股份	5,366,531.36	7.35
74	300820	英杰电气	5,342,987.58	7.32
75	002409	雅克科技	5,272,266.00	7.22
76	002129	TCL 中环	5,218,234.00	7.15
77	300480	光力科技	5,056,315.20	6.93
78	688582	芯动联科	5,052,118.30	6.92
79	603306	华懋科技	4,919,926.12	6.74
80	688035	德邦科技	4,854,483.33	6.65
81	688627	精智达	4,792,758.91	6.57
82	688200	华峰测控	4,709,648.88	6.45
83	688381	帝奥微	4,550,058.22	6.23
84	688515	裕太微	4,386,786.58	6.01
85	300666	江丰电子	4,190,610.00	5.74
86	688045	必易微	3,938,598.12	5.40
87	688138	清溢光电	3,835,444.96	5.26
88	688595	芯海科技	3,754,492.47	5.14
89	688270	臻镭科技	3,722,358.08	5.10
90	688141	杰华特	3,627,952.80	4.97
91	002484	江海股份	3,445,090.00	4.72
92	603290	斯达半导	3,371,391.00	4.62
93	688172	燕东微	3,328,721.57	4.56
94	002079	苏州固锟	3,184,999.00	4.36
95	688262	国芯科技	3,118,698.03	4.27
96	301269	华大九天	3,048,534.00	4.18
97	002180	纳思达	2,960,993.00	4.06
98	300274	阳光电源	2,876,649.00	3.94
99	688008	澜起科技	2,808,745.68	3.85
100	603160	汇顶科技	2,752,641.00	3.77
101	600877	电科芯片	2,694,086.00	3.69
102	003043	华亚智能	2,589,102.00	3.55
103	300316	晶盛机电	2,548,744.10	3.49
104	688347	华虹公司	2,497,908.78	3.42
105	605111	新洁能	2,494,779.40	3.42
106	300373	扬杰科技	2,493,552.00	3.42
107	688603	天承科技	2,414,503.41	3.31



108	688182	灿勤科技	2,359,510.07	3.23
109	688502	茂莱光学	2,281,320.13	3.13
110	688599	天合光能	2,238,373.97	3.07
111	300327	中颖电子	2,104,270.60	2.88
112	688313	仕佳光子	2,093,499.00	2.87
113	300260	新莱应材	1,997,455.00	2.74
114	688308	欧科亿	1,938,926.34	2.66
115	002459	晶澳科技	1,925,116.00	2.64
116	300053	航宇微	1,914,974.00	2.62
117	688376	美埃科技	1,694,704.25	2.32
118	688234	天岳先进	1,674,581.64	2.29
119	688002	睿创微纳	1,669,340.74	2.29
120	300474	景嘉微	1,666,245.28	2.28
121	002436	兴森科技	1,650,693.00	2.26
122	688409	富创精密	1,576,858.12	2.16
123	300925	法本信息	1,486,669.10	2.04
124	001308	康冠科技	1,483,040.00	2.03
125	600536	中国软件	1,480,500.00	2.03
126	600050	中国联通	1,480,021.00	2.03

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	688981	中芯国际	42,185,484.70	57.80
2	688012	中微公司	36,412,569.12	49.89
3	688256	寒武纪	35,292,336.80	48.36
4	688037	芯源微	34,728,953.98	47.59
5	002156	通富微电	34,135,112.50	46.77
6	002371	北方华创	34,064,812.00	46.68
7	600584	长电科技	33,779,943.90	46.29
8	688099	晶晨股份	33,367,095.50	45.72
9	688072	拓荆科技	30,562,801.71	41.88
10	688362	甬矽电子	29,874,405.65	40.94
11	688041	海光信息	28,113,688.07	38.52
12	300223	北京君正	27,210,889.83	37.29
13	688120	华海清科	26,331,633.80	36.08
14	603986	兆易创新	25,537,433.30	34.99
15	688249	晶合集成	22,681,955.97	31.08
16	002185	华天科技	20,588,847.00	28.21
17	688596	正帆科技	20,104,038.44	27.55

18	688123	聚辰股份	18,211,551.20	24.95
19	688403	汇成股份	18,112,525.28	24.82
20	688766	普冉股份	17,064,858.32	23.38
21	603005	晶方科技	17,052,240.64	23.37
22	688082	盛美上海	16,316,078.14	22.36
23	688047	龙芯中科	16,262,418.01	22.28
24	688372	伟测科技	16,243,327.52	22.26
25	603893	瑞芯微	15,731,795.30	21.56
26	688110	东芯股份	15,395,698.28	21.10
27	688352	顾中科技	14,449,585.06	19.80
28	300782	卓胜微	14,447,360.00	19.80
29	688147	微导纳米	14,329,789.07	19.64
30	688252	天德钰	14,001,513.75	19.19
31	688048	长光华芯	13,923,433.64	19.08
32	000021	深科技	13,331,957.00	18.27
33	688018	乐鑫科技	12,664,117.84	17.35
34	301095	广立微	12,532,845.00	17.17
35	688003	天准科技	11,775,278.84	16.14
36	001309	德明利	11,374,329.40	15.59
37	688601	力芯微	10,999,842.75	15.07
38	688361	中科飞测	10,778,572.76	14.77
39	301308	江波龙	10,515,180.09	14.41
40	300458	全志科技	10,432,067.60	14.29
41	300604	长川科技	10,268,245.28	14.07
42	688385	复旦微电	9,932,279.76	13.61
43	688049	炬芯科技	9,918,561.70	13.59
44	688608	恒玄科技	9,898,657.77	13.56
45	688508	芯朋微	9,721,514.53	13.32
46	688498	源杰科技	9,383,212.37	12.86
47	688396	华润微	9,330,392.45	12.78
48	603501	韦尔股份	9,090,885.80	12.46
49	688153	唯捷创芯	8,686,043.26	11.90
50	300613	富瀚微	8,588,487.83	11.77
51	688008	澜起科技	8,521,737.85	11.68
52	300567	精测电子	8,332,543.00	11.42
53	300475	香农芯创	8,313,283.05	11.39
54	688381	帝奥微	8,312,746.36	11.39
55	688025	杰普特	8,255,472.85	11.31
56	300327	中颖电子	8,095,116.00	11.09
57	002049	紫光国微	7,985,933.20	10.94
58	688205	德科立	7,816,701.40	10.71

59	688332	中科蓝讯	7,643,035.35	10.47
60	688279	峰昭科技	7,461,904.26	10.22
61	688486	龙迅股份	7,328,378.59	10.04
62	688798	艾为电子	7,205,266.38	9.87
63	688368	晶丰明源	7,096,076.16	9.72
64	688484	南芯科技	6,942,345.90	9.51
65	603061	金海通	6,877,926.00	9.42
66	688711	宏微科技	6,788,591.40	9.30
67	300661	圣邦股份	6,387,519.24	8.75
68	688052	纳芯微	6,319,469.20	8.66
69	688416	恒烁股份	6,006,747.87	8.23
70	002129	TCL 中环	5,966,649.00	8.18
71	301297	富乐德	5,911,075.00	8.10
72	688167	炬光科技	5,901,996.73	8.09
73	688478	晶升股份	5,824,528.23	7.98
74	001270	铖昌科技	5,540,974.00	7.59
75	688270	臻镭科技	5,523,706.64	7.57
76	688521	芯原股份	5,469,846.35	7.50
77	002222	福晶科技	5,377,721.00	7.37
78	688045	必易微	5,243,828.18	7.19
79	688220	翱捷科技	5,227,042.01	7.16
80	300820	英杰电气	5,166,346.00	7.08
81	300480	光力科技	5,077,661.83	6.96
82	688661	和林微纳	5,056,501.46	6.93
83	002409	雅克科技	5,011,026.76	6.87
84	688582	芯动联科	4,871,050.78	6.67
85	688213	思特威	4,840,098.80	6.63
86	688627	精智达	4,504,789.47	6.17
87	603306	华懋科技	4,498,984.00	6.16
88	688035	德邦科技	4,294,166.83	5.88
89	688138	清溢光电	4,094,144.76	5.61
90	688515	裕太微	4,070,975.06	5.58
91	300666	江丰电子	3,984,481.64	5.46
92	300623	捷捷微电	3,756,755.00	5.15
93	002484	江海股份	3,682,877.00	5.05
94	688595	芯海科技	3,560,264.59	4.88
95	688141	杰华特	3,333,344.22	4.57
96	300316	晶盛机电	3,007,727.00	4.12
97	603160	汇顶科技	2,953,075.00	4.05
98	688172	燕东微	2,945,605.46	4.04
99	002079	苏州固锝	2,945,411.00	4.04

100	300274	阳光电源	2,937,775.00	4.03
101	301099	雅创电子	2,916,966.00	4.00
102	688262	国芯科技	2,916,864.41	4.00
103	301269	华大九天	2,886,460.00	3.96
104	002180	纳思达	2,876,935.00	3.94
105	688313	仕佳光子	2,777,671.63	3.81
106	688182	灿勤科技	2,684,670.41	3.68
107	688502	茂莱光学	2,626,418.80	3.60
108	600877	电科芯片	2,550,213.00	3.49
109	003043	华亚智能	2,507,256.00	3.44
110	000063	中兴通讯	2,268,613.00	3.11
111	688603	天承科技	2,199,063.26	3.01
112	688599	天合光能	2,139,630.52	2.93
113	300260	新莱应材	2,066,667.00	2.83
114	688401	路维光电	2,052,348.99	2.81
115	688308	欧科亿	1,982,204.71	2.72
116	002459	晶澳科技	1,886,544.00	2.59
117	600536	中国软件	1,852,972.00	2.54
118	300053	航宇微	1,837,081.00	2.52
119	688002	睿创微纳	1,758,616.56	2.41
120	688409	富创精密	1,685,571.31	2.31
121	300925	法本信息	1,575,304.00	2.16
122	001308	康冠科技	1,540,211.07	2.11
123	688200	华峰测控	1,535,550.82	2.10
124	688376	美埃科技	1,522,998.41	2.09
125	688680	海优新材	1,521,209.86	2.08
126	002436	兴森科技	1,514,591.00	2.08
127	600050	中国联通	1,492,848.00	2.05
128	300474	景嘉微	1,487,085.00	2.04
129	688234	天岳先进	1,477,376.22	2.02

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	1,354,260,217.24
卖出股票收入（成交）总额	1,313,117,177.86

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	30,517,997.15	24.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,517,997.15	24.49

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	176,000	17,941,951.12	14.40
2	019703	23 国债 10	124,000	12,576,046.03	10.09

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 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据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

### 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	130,775.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,548.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,324.05

#### 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 鼎利混合 (LOF)A	2,043	40,297.84	39,249,434.48	47.67%	43,079,060.78	52.33%
中信保诚 鼎利混合 (LOF)C	921	35,962.32	28,741,162.67	86.78%	4,380,134.30	13.22%
合计	2,964	38,950.67	67,990,597.15	58.89%	47,459,195.08	41.11%

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 期末上市基金前十名持有人

中信保诚鼎利混合(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	金小庆	1,000,038.00	16.04%
2	李钦成	500,009.00	8.02%
3	彭美丽	300,011.00	4.81%
4	金文波	223,950.00	3.59%
5	盛秉铨	200,000.00	3.21%
6	幸世芬	196,500.00	3.15%
7	徐文芹	193,025.00	3.10%
8	吴丽华	108,514.00	1.74%
9	袁宝康	108,004.00	1.73%
10	俞群	100,200.00	1.61%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信保诚鼎利混合(LOF)A	448,550.67	0.54%
	中信保诚鼎利混合(LOF)C	11,620.03	0.04%
	合计	460,170.70	0.40%

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。

#### 9.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	10~50
	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	0~10
	中信保诚鼎利混合 (LOF) C	0
	合计	0~10

#### 9.5 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	中信保诚鼎利混合 (LOF) A	中信保诚鼎利混合 (LOF) C
基金合同生效日（2016年05月24日）基金份额总额	1,216,702,748.19	-
本报告期期初基金份额总额	42,210,703.30	20,594,300.29
本报告期基金总申购份额	85,120,972.11	120,340,885.01
减：本报告期基金总赎回份额	45,003,180.15	107,813,888.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	82,328,495.26	33,121,296.97

### § 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。



本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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 55,000.00 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

本报告期内,托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	33,715,202.67	1.26%	24,810.23	1.03%	本报告期新增
国融证券	1	45,219,928.17	1.70%	32,617.24	1.35%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	124,343,995.20	4.66%	91,505.25	3.80%	本报告期新增
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	219,905,840.94	8.25%	159,586.39	6.63%	-
中信证券	2	2,243,782,130.00	84.13%	2,100,257.83	87.19%	-

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
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	29,998,340.00	100.00%	12,452,000.00	100.00%	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2023 年 05 月 31 日
8	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2023 年 05 月 31 日
9	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2023 年 5 月)	同上	2023 年 05 月 31 日
10	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 2 季度报告	同上	2023 年 07 月 19 日
11	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
12	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年中期报告	同上	2023 年 08 月 26 日
13	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年中期报告提示性公告	同上	2023 年 08 月 26 日
14	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
15	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2023 年 08 月 26 日
16	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2023 年 08 月 26 日
17	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2023 年 08 月 29 日
18	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2023 年 08 月 29 日
19	信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2023 年 08 月 29 日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称及部分深交所基金变更证券简称事宜的公告	同上	2023 年 09 月 12 日
21	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2023 年 09 月 12 日
22	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2023 年 09 月 12 日
23	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2023 年 09 月 15 日
24	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2023 年 09 月 15 日
25	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资	同上	2023 年 09 月 15 日

	基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新		日
26	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 3 季度报告	同上	2023 年 10 月 24 日
27	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

## § 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	1	2023-04-17 至 2023-04-26	-	13,827,149.39	13,827,149.39	-	-
	2	2023-05-31 至 2023-07-04, 2023-08-09 至 2023-12-31	-	31,518,526.30	-	31,518,526.30	27.30%
	3	2023-06-01 至 2023-06-11, 2023-07-05 至 2023-08-08	-	60,873,346.63	60,873,346.63	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上 (含本数) 发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

### 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。

根据基金管理人于 2023 年 9 月 12 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称及部分深交所基金变更证券简称事宜的公告》，本基金自 2023 年 9 月 12 日起变更基金名称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、(原) 信诚鼎利定增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、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 4、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书
- 6、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