

中信保诚远见成长混合型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 年 06 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 07 月 18 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中信保诚远见成长混合 |
| 基金主代码 | 018618 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 06 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,429,884,376.52 份 |
| 投资目标 | 本基金在有效控制投资组合风险的前提下，精选具有成长空间的行业和优质上市公司，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或上市的股票、港股通标的股票、债券、现金、金融衍生品等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。</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通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的</p> |

股票。

2、股票投资策略

本基金将关注行业的发展空间，优选符合社会经济发展趋势，具有广阔清晰发展空间，行业渗透率有望快速提高，产业进程有望进入成长期或成熟期的行业。此外，符合国家产业发展方向，受到一定产业政策扶持的具有较高成长性的行业也将是本基金关注的重点。

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。

（1）自上而下的行业选择

本基金将自上而下对行业的生命周期、商业模式、竞争格局、风险因素等进行分析，优选行业景气度向上或平稳、景气周期相对较长、具有良好的商业模式和成长空间、政策中长期支持的行业。

（2）自下而上的个股选择

本基金将通过定量和定性相结合的方法自下而上地精选具有长期持续成长能力、良好的公司治理、可辨识的竞争壁垒、优秀的财务指标（ROE、现金流）、估值与内生成成长性相匹配的优质个股。

1) 定量方面

① 企业基本面分析：本基金重点关注企业成长能力指标，包括主营业务收入增长率、净利润增长率、每股收益增长率、股权投资回报率增长等。这些指标都综合反映企业的利润增长趋势和效益稳定程度，较好地体现了企业的发展状况和成长能力。

另外，本基金将辅以企业盈利能力指标、营运能力指标、偿债能力指标对企业盈利状况、资金利用效率、企业流动性状况进行考量。

② 估值水平：本基金将结合上市公司的行业及公司本身的特点，选择合适的估值方法，包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市销率法（P/S）、市盈率对盈利增长率的比率（PEG）、企业价值倍数（EV/EBITDA）、研发支出占比等，力争挑选出价值被低估的股票。

2) 定性方面

本基金将重点分析公司的长期成长潜力，包括企业的商业模式、竞争优势、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、市场占有率增长、企业研发能力、行业所处地位等。

此外，本基金也将考量公司股权结构、信息透明度、公司治理情况、公司发展战略、公司资信程度等方面状况。

(3) 港股通标的股票投资策略

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，本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法，严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。

3、债券投资策略

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。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。

4、证券公司短期公司债券投资策略

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。

5、可转换债券及可交换债券的投资策略

可转换债券和可交换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的投资优势，并有利于从资产整体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将采用期权定价模型等数量化估值工具，选择基础证券基本面优良的可转换债券、可交换债券，评定其投资价值并以合理价格买入，充分发掘投资价值，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投资收益。本基金持有的可转换债券、可交换债券可以转换、交换为股票。

6、资产支持证券投资策略

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。

7、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>8、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，以套期保值为目的，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，力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。</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，以套期保值为主要目的，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。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>中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%</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。</p> <p>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> | |
| 基金管理人 | <p>中信保诚基金管理有限公司</p> | |
| 基金托管人 | <p>中信银行股份有限公司</p> | |
| 下属分级基金的基金简称 | <p>中信保诚远见成长混合 A</p> | <p>中信保诚远见成长混合 C</p> |
| 下属分级基金的交易代码 | <p>018618</p> | <p>018619</p> |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>430,787,794.14 份</p> | <p>999,096,582.38 份</p> |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 04 月 01 日-2024 年 06 月 30 日） | |
|-----------------|--|----------------|
| | 中信保诚远见成长混合 A | 中信保诚远见成长混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -12,152,744.45 | -29,281,116.89 |
| 2. 本期利润 | -13,154,405.49 | -31,510,223.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0294 | -0.0306 |
| 4. 期末基金资产净值 | 365,235,292.71 | 841,927,424.73 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8478 | 0.8427 |

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。

3.2 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

中信保诚远见成长混合 A

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | -3.47% | 0.95% | -0.16% | 0.64% | -3.31% | 0.31% |
| 过去六个月 | -11.15% | 1.19% | 0.69% | 0.81% | -11.84% | 0.38% |
| 过去一年 | -15.23% | 0.90% | -7.11% | 0.76% | -8.12% | 0.14% |
| 自基金合同生效起 至今 | -15.22% | 0.90% | -7.58% | 0.76% | -7.64% | 0.14% |

中信保诚远见成长混合 C

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | -3.61% | 0.95% | -0.16% | 0.64% | -3.45% | 0.31% |
| 过去六个月 | -11.42% | 1.19% | 0.69% | 0.81% | -12.11% | 0.38% |
| 过去一年 | -15.74% | 0.91% | -7.11% | 0.76% | -8.63% | 0.15% |
| 自基金合同生效起 至今 | -15.73% | 0.90% | -7.58% | 0.76% | -8.15% | 0.14% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金建仓期自 2023 年 06 月 26 日至 2023 年 12 月 26 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2023 年 06 月 26 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、中信保诚景气优选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《证券投资基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

A 股在一季度经历了较大幅度的波动后，二季度呈现先强后弱的窄幅弱震荡格局。2024 年第二季度，上证指数下跌 2.43%，沪深 300 下跌 2.14%。结构上看，银行、公用事业、保险等稳定红利方向延续了一季度的较强趋势，资源领域中煤炭板块表现也较好；电子板块在大基金三期成立和苹果手机销量回升的带动下也出现了阶段行情。而商贸零售、社会服务、轻工制造，以及计算机、传媒等板块则表现相对较弱；中游制造业在经历了一轮补库预期带来的上涨后股价也明显回落。

海外方面，地缘政治的不稳定性依然是影响 A 股的重要变量。一方面是全球大选年背景下，欧美等经济体的贸易保护主义氛围愈发浓重，针对我国部分制造业产品出口设置了更高的贸易壁垒，对我国的出口前景构成一定的挑战；另一方面，俄乌和中东地区的紧张局势对风险偏好仍然是偏压制。美联储维持利率不变则符合市场预期。

国内方面，各项宏观政策稳步推进落实中。在 4 月政治局会议定调“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”后，二季度房地产领域政策不断，包括一线城市进一步放松限购政策、央行放款首付比例限制和贷款利率下限限制、地方政府收储存量房等。消费和投资方面，设备更新改造和消费品以旧换新政策也在持续落地。新质生产力方面，国家集成电路产业投资基金三期股份有限公司注册成立，多家国有银行参与出资；低空，车路协同等新兴方向也有持续政策跟进。

本基金二季度仍然主要布局在新兴成长方向，根据产业和公司发展调整了部分持仓，增持了消费电子，食品饮料和机械，降低了软件，传媒等短期业绩承压行业的权重。

我们仍然认为当下的市场点位和定价反映了过度悲观的预期，下半年存在较大的修正可能。与全球权益资产相比，A 股被显著低估；随着下半年财政支出下放带来的实物工作量抬升以及地产政策放松后数据潜在转好的可能，经济增长可能会超预期；同时电动车，军工，医药，新能源等成长方向下半年也陆续会迎来业绩向上的拐点，在目前较低的估值水平下，有望迎来一个中长期较佳的布局时点。目前市场面临的主要风险仍然来自于选举大年地缘政治和贸易政策的不确定性，我们会密切关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚远见成长混合 A 份额净值增长率为-3.47%，同期业绩比较基准收益率为-0.16%；中信保诚远见成长混合 C 份额净值增长率为-3.61%，同期业绩比较基准收益率为-0.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,068,207,507.76 | 87.81 |
| | 其中：股票 | 1,068,207,507.76 | 87.81 |
| 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 | 147,383,857.06 | 12.12 |
| 8 | 其他资产 | 866,077.46 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 1,216,457,442.28 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 20,422,355.85 元，占资产净值比例为 1.69%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 819,854,018.34 | 67.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 13,061,200.00 | 1.08 |
| 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 | 22,977,793.92 | 1.90 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 65,428,612.75 | 5.42 |
| J | 金融业 | 82,415,526.90 | 6.83 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,920,000.00 | 0.90 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | 33,128,000.00 | 2.74 |
| 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 | 1,047,785,151.91 | 86.80 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|---------------|--------------|
| 公用事业 | 20,422,355.85 | 1.69 |
| 合计 | 20,422,355.85 | 1.69 |

注：以上分类采用全球行业分类系统(GICS)提供的国际通用分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 1,600,000 | 45,968,000.00 | 3.81 |
| 2 | 002273 | 水晶光电 | 2,550,000 | 43,299,000.00 | 3.59 |
| 3 | 000568 | 泸州老窖 | 300,000 | 43,047,000.00 | 3.57 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 200,000 | 36,006,000.00 | 2.98 |
| 5 | 002179 | 中航光电 | 899,990 | 34,244,619.50 | 2.84 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 1,900,000 | 31,350,000.00 | 2.60 |
| 7 | 600309 | 万华化学 | 380,600 | 30,775,316.00 | 2.55 |
| 8 | 603345 | 安井食品 | 400,000 | 29,724,000.00 | 2.46 |
| 9 | 689009 | 九号公司 | 800,000 | 29,448,000.00 | 2.44 |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 4,000,000 | 26,600,000.00 | 2.20 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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，以套期保值为目的，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，力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 299,649.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 527,048.58 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 39,379.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 866,077.46 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中信保诚远见成长混合 A | 中信保诚远见成长混合 C |
|---------------------------|----------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 465,027,216.33 | 1,065,764,255.17 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,005,861.12 | 4,564,058.91 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 35,245,283.31 | 71,231,731.70 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 430,787,794.14 | 999,096,582.38 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | | | | | | | |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中信保诚远见成长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、中信保诚远见成长混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚远见成长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

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

10.3 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。

中信保诚基金管理有限公司
2024 年 07 月 18 日