

中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金
2025 年中期报告

2025 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 08 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 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	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8	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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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 ..	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3	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	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6	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	59
7.7	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	59
7.8	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	59
7.9	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
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59

7.12	投资组合报告附注	60
§ 8	基金份额持有人信息	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3	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
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9	开放式基金份额变动	62
§ 10	重大事件揭示	62
10.1	基金份额持有人大会决议	62
10.2	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
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8	其他重大事件	64
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1	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	65
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12	备查文件目录	66
12.1	备查文件目录	66
12.2	存放地点	66
12.3	查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中信保诚新锐混合	
基金主代码	001415	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 06 月 11 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	184,146,151.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混合 B
下属分级基金的交易代码	001415	002046
报告期末下属分级基金的份额总额	175,696,311.91 份	8,449,839.76 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绝对回报。
投资策略	1、资产配置策略 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。 2、股票投资策略 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。 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。 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。主要的债券投资策略有:利率预期策略、收益率曲线策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略。 4、股指期货、权证等投资策略 本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。 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

	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。 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。 5、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。 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中债新综合全价（1-3 年）指数收益率*20%
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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	方圆
	联系电话	021-68649788	95559
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-666-0066	95559
传真		021-50120895	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		涂一锴	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混合 B
本期已实现收益	2,619,782.72	297,945.88
本期利润	3,402,527.43	1,558,862.40
加权平均基金份额本期利润	0.0322	0.0826
本期加权平均净值利润率	3.14%	7.43%
本期基金份额净值增长率	1.50%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混合 B
期末可供分配利润	1,794,303.62	720,143.07
期末可供分配基金份额利润	0.0102	0.0852
期末基金资产净值	186,192,988.18	9,665,330.02
期末基金份额净值	1.0597	1.1438
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混合 B
基金份额累计净值增长率	19.18%	31.64%

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

中信保诚新锐混合 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
过去一个月	3.27%	0.58%	2.00%	0.47%	1.27%	0.11%
过去三个月	2.29%	1.05%	3.47%	0.40%	-1.18%	0.65%
过去六个月	1.50%	0.75%	4.62%	0.28%	-3.12%	0.47%
过去一年	4.20%	0.54%	6.96%	0.20%	-2.76%	0.34%
过去三年	-1.15%	0.38%	16.25%	0.11%	-17.40%	0.27%
自基金合同生效起至今	19.18%	0.31%	49.19%	0.06%	-30.01%	0.25%

中信保诚新锐混合 B

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
过去一个月	3.27%	0.58%	2.00%	0.47%	1.27%	0.11%
过去三个月	2.22%	1.04%	3.47%	0.40%	-1.25%	0.64%
过去六个月	1.40%	0.75%	4.62%	0.28%	-3.22%	0.47%
过去一年	3.98%	0.54%	6.96%	0.20%	-2.98%	0.34%
过去三年	-1.65%	0.38%	16.25%	0.11%	-17.90%	0.27%
自基金合同生 效起至今	31.64%	0.28%	46.90%	0.06%	-15.26%	0.22%

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

中信保诚新锐混合 A



中信保诚新锐混合 B



注：根据《关于中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金降低托管费、变更业绩比较基准、调整基金份额精度并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2025 年 4 月 28 日起，变更业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*80%+中债新综合全价（1-3 年）指数收益率*20%。

§ 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 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 89 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）、中信保诚中证基建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、中信保诚景气优选混合型证券投资基金、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚 90 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚周期优选混合型发起式证券投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚乾元 30 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚汇利债券型证券投资基金、中信保诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

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		
杨立春	基金经理	2016 年 07 月 26 日	2025 年 02 月 05 日	14	杨立春先生，经济学博士。曾任职于江苏省社会科学院，从事研究工作。2011 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任固定收益分析师。现任中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚三得益债券型证券投资基金的基金经理。
王颖	量化投资部副总监 （主持工作）、基金经 理	2020 年 01 月 08 日	-	12	王颖女士，经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司，担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、基金经理助理。现任量化投资部副总监（主持工作），中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、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》中关于证券投资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, 未发现有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 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

2025 年上半年，经济数据基本符合预期，关税对经济扰动较大，地产影响明显，消费韧性较强，国内经济运行总体平稳。

市场方面，上半年 A 股市场震荡上行。从行业表现上看，军工、有色、传媒涨幅居前，煤炭、食品饮料、石油石化等板块跌幅较大。从量化角度看，成长、量价类因子表现较强，贡献正收益，估值类因子表现较去年有所回撤；低波、低换手类因子在小盘股内表现强势，但在中大盘内贡献负超额。

报告期内基金股票部分维持高仓位运作。本基金的股票资产以基本面选股为原则，基于多策略模型持续投资于景气度处于上行周期或向上拐点，长期空间和成长性的确定性较强，同时估值具备安全边界的行业和个股。在市场波动中，依据经济基本面变化、估值和交投数据，对股票组合的行业和个股配置进行了积极的调整，同时，在满足持仓市值要求的情况下，积极参与科创板、创业板新股申购，争取收益增厚。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚新锐混合 A 份额净值增长率为 1.50%，同期业绩比较基准收益率为 4.62%；中信保诚新锐混合 B 份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准收益率为 4.62%。

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 2025 年下半年，7 月，中央财经委员会第六次会议再次提出“反内卷”，伴随部分行业政策出台，市场对未来流动性宽松和经济向好的预期有所回升，A 股市场 7 月走出连续上涨行情。长期来看，政策利好频发下，宽松预期有利于 A 股市场整体活跃度的提升，利好 A 股市场整体行情；伴随基本面改善和新技术的出现，部分行业有超额收益的空间。从量化角度看，伴随市场波动率的提升，部分风险因子可能走出不同与过去低流动性情况下的表现，从去年以来，我们也观察到不同因子在不同股票上表现的差异性，我们将持续观察不同策略和大类因子表现的变化，拉长因子观察周期，并及时对投资策略进行优化。

4.6 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委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。估值委员会由主管运营的公司领导、投资、研究、会计和风控等岗位资深人员组成。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，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程人员均具备相应的专业胜任能力及相关工作经历。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。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。

4.7 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。

4.8 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

本基金自 2023 年 7 月 25 日起至 2025 年 3 月 26 日基金资产净值低于五千万元,已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。截至本报告期末,本基金资产净值已不低于五千万元。

自 2024 年 7 月 1 日至 2025 年 3 月 27 日,本基金如涉及信息披露费、审计费、持有人大会费用、银行间账户维护费、注册登记费等固定费用,由管理人承担,不再从基金资产中列支。

§ 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,基金托管人在中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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,中信保诚基金管理有限公司在中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金投

资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中信保诚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	23,441,560.25	371,097.60
结算备付金		2,870,740.53	872,613.56
存出保证金		1,455,307.14	1,591.97
交易性金融资产	6.4.7.2	176,984,338.99	9,191,553.04
其中：股票投资		173,013,638.39	992,730.00
基金投资		-	-
债券投资		3,970,700.60	8,198,823.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	1,000,124.66
应收清算款		3,268,158.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		49.93	1,236.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	9,300.00
资产总计		208,020,154.92	11,447,516.99
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		11,893,182.08	10,174.92
应付管理人报酬		117,575.92	5,908.60
应付托管费		19,595.98	1,969.51
应付销售服务费		1,971.88	543.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,394.19	0.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	113,116.67	36,897.46
负债合计		12,161,836.72	55,493.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	184,146,151.67	10,464,149.91
未分配利润	6.4.7.8	11,712,166.53	927,873.34
净资产合计		195,858,318.20	11,392,023.25
负债和净资产总计		208,020,154.92	11,447,516.99

注：截止本报告期末，基金份额总额 184,146,151.67 份。其中：中信保诚新锐混合 A 的基金份额净值 1.0597 元，基金份额总额 175,696,311.91 份；中信保诚新锐混合 B 的基金份额净值 1.1438 元，基金份额总额 8,449,839.76 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		5,475,446.89	-61,895.44
1. 利息收入		39,826.15	22,558.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	37,512.81	20,513.21
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		2,313.34	2,045.15
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,304,376.60	-276,318.68
其中：股票投资收益	6.4.7.10	724,147.35	-381,469.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	35,651.02	93,006.06
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	351,573.74	-
股利收益	6.4.7.14	2,193,004.49	12,144.36
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,043,661.23	191,823.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	87,582.91	41.56
减：二、营业总支出		514,057.06	110,592.66
1. 管理人报酬		380,434.99	47,092.51
2. 托管费		84,782.16	15,697.47
3. 销售服务费		10,219.41	4,243.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4.40	26.61
其中：卖出回购金融资产支出		4.40	26.61
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,270.98	-
8. 其他费用	6.4.7.18	37,345.12	43,533.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,961,389.83	-172,488.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,961,389.83	-172,488.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,961,389.83	-172,488.10

6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,464,149.91	927,873.34	11,392,023.25
二、本期期初净资产	10,464,149.91	927,873.34	11,392,023.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	173,682,001.76	10,784,293.19	184,466,294.95
（一）、综合收益总额	-	4,961,389.83	4,961,389.83
（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）	173,682,001.76	5,822,903.36	179,504,905.12
其中：1. 基金申购款	239,688,621.43	11,689,571.28	251,378,192.71
2. 基金赎回款	-66,006,619.67	-5,866,667.92	-71,873,287.59
（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	184,146,151.67	11,712,166.53	195,858,318.20
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,601,224.05	1,204,370.73	17,805,594.78
二、本期期初净资产	16,601,224.05	1,204,370.73	17,805,594.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,921,092.84	-430,124.68	-4,351,217.52
（一）、综合收益总额	-	-172,488.10	-172,488.10
（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）	-3,921,092.84	-257,636.58	-4,178,729.42
其中：1. 基金申购款	138,305.90	7,005.56	145,311.46
2. 基金赎回款	-4,059,398.74	-264,642.14	-4,324,040.88
（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	12,680,131.21	774,246.05	13,454,377.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>董元星</u>	<u>桂思毅</u>	<u>刘卓</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金(原名为信诚新锐回报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[2015]1021 号《关于准予信诚新锐回报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《信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,939,402.59 元。经向中国证监会备案，《信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,939,434.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 32.03 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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。

根据《信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 25 日起根据认购费、申购费、销售服务费等费率收费差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 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，信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金于 2023 年 9 月 12 日公告后更名为中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚新锐回报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、资产支持证券及其他中国证监会允许投资的债券）、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）。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。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%；基金持有全部权证的市场价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，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。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*80%+中债新综合全价（1-3 年）指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	23,441,560.25
等于：本金	23,438,944.60
加：应计利息	2,615.65
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	23,441,560.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		171,168,709.76	-	173,013,638.39	1,844,928.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,923,305.00	57,520.60	3,970,700.60	-10,125.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,923,305.00	57,520.60	3,970,700.60	-10,125.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		175,092,014.76	57,520.60	176,984,338.99	1,834,803.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	11,412,522.00	-	-	-
IF2507	4,598,496.00	-	-	-
IF2509	3,426,426.00	-	-	-
IF2512	3,387,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,412,522.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2507	IF2507	4.00	4,689,360.00	90,864.00
IF2509	IF2509	3.00	3,498,300.00	71,874.00
IF2512	IF2512	3.00	3,470,940.00	83,340.00
合计				246,078.00
减：可抵销期货暂收款				246,078.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	29,788.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	46,516.99
其中：交易所市场	46,516.99

银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	11,712.55
应付信息披露费	15,798.95
应付账户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	113,116.67

6.4.7.7 实收基金

中信保诚新锐混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,942,251.17	4,942,251.17
本期申购	204,740,702.93	204,740,702.93
本期赎回（以“-”号填列）	-33,986,642.19	-33,986,642.19
本期末	175,696,311.91	175,696,311.91

中信保诚新锐混合 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,521,898.74	5,521,898.74
本期申购	34,947,918.50	34,947,918.50
本期赎回（以“-”号填列）	-32,019,977.48	-32,019,977.48
本期末	8,449,839.76	8,449,839.76

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）。

6.4.7.8 未分配利润

中信保诚新锐混合 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	-23,863.90	242,947.25	219,083.35
本期期初	-23,863.90	242,947.25	219,083.35
本期利润	2,619,782.72	782,744.71	3,402,527.43
本期基金份额交易产生的变动数	-801,615.20	7,676,680.69	6,875,065.49
其中：基金申购款	-592,347.36	9,429,849.60	8,837,502.24
基金赎回款	-209,267.84	-1,753,168.91	-1,962,436.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,794,303.62	8,702,372.65	10,496,676.27

中信保诚新锐混合 B

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	387,116.35	321,673.64	708,789.99
本期期初	387,116.35	321,673.64	708,789.99
本期利润	297,945.88	1,260,916.52	1,558,862.40
本期基金份额交易产生的变动数	35,080.84	-1,087,242.97	-1,052,162.13
其中：基金申购款	2,468,065.68	384,003.36	2,852,069.04
基金赎回款	-2,432,984.84	-1,471,246.33	-3,904,231.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	720,143.07	495,347.19	1,215,490.26

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	24,565.11
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	8,440.29
其他	4,507.41
合计	37,512.81

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	62,860,515.76
减：卖出股票成本总额	61,951,782.88
减：交易费用	184,585.53
买卖股票差价收入	724,147.35

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益—利息收入	64,477.32
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-28,826.30

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	35,651.02

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,308,086.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,298,340.30
减：应计利息总额	38,572.02
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-28,826.30

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益--其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股指期货投资收益	351,573.74

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,193,004.49
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	2,193,004.49

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,805,610.63
--股票投资	1,869,400.33
--债券投资	-63,789.70
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	246,078.00
--权证投资	-
--期货投资	246,078.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	8,027.40
合计	2,043,661.23

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	87,582.91
合计	87,582.91

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	11,712.55
信息披露费	15,798.95
证券出借违约金	-
银行费用	120.00
账户维护费	9,400.00
其他	313.62
合计	37,345.12

注：本基金处于“迷你基金”期间的信息披露费、审计费、持有人大会费用、银行间账户维护费、注册登记费等固定费用由本基金的基金管理人承担。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.6 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	380,434.99	47,092.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	38,849.06	20,467.83
应支付基金管理人的净管理费	341,585.93	26,624.68

注：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 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,782.16	15,697.47

注：于本报告期内及上年度可比期间，截至 2025 年 4 月 27 日止，支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

根据《关于中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金降低托管费、变更业绩比较基准、调整基金份额精度并修改基金合同及托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 4 月 28 日起，支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

6.4.10.2.3 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混 合 B	合计

中信保诚基金管理有限公司	-	5,266.62	5,266.62
合计	-	5,266.62	5,266.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混合 B	合计
中信保诚基金管理有限公司	-	1.11	1.11
合计	-	1.11	1.11

注：本基金中信保诚新锐混合 A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚新锐混合 B 基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

中信保诚新锐混合 B 的销售服务费按前一日中信保诚新锐混合 B 资产净值的 0.10%年费率计提。

计算公式为：中信保诚新锐混合 B 基金日销售服务费=中信保诚新锐混合 B 基金份额前一日资产净值×0.10%/当年天数

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	23,441,560.25	24,565.11	3,429,612.24	3,667.69

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

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末 2025 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	6 个月	锁定期股票	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
00139	古麒	2025 年	6 个月	锁定期	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-

0	绒材	05 月 21 日		股票						
301590	优优绿能	2025 年 05 月 28 日	6 个月	锁定期股票	89.60	139.48	59	5,286.40	8,229.32	—
301595	太力科技	2025 年 05 月 12 日	6 个月	锁定期股票	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	—
301678	新恒汇	2025 年 06 月 13 日	6 个月	锁定期股票	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	—
603014	威高血净	2025 年 05 月 12 日	6 个月	锁定期股票	26.50	32.68	133	3,524.50	4,346.44	—
603049	中策橡胶	2025 年 05 月 27 日	6 个月	锁定期股票	46.50	42.85	119	5,533.50	5,099.15	—
603382	海阳科技	2025 年 06 月 05 日	6 个月	锁定期股票	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	—
603400	华之杰	2025 年 06 月 12 日	6 个月	锁定期股票	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	—
688755	汉邦科技	2025 年 05 月 09 日	6 个月	锁定期股票	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	—
688775	影石创新	2025 年 06 月 04 日	6 个月	锁定期股票	47.27	124.16	207	9,784.89	25,701.12	—

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	—	—
未评级	3,970,700.60	8,198,823.04
合计	3,970,700.60	8,198,823.04

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。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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、流通受限制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公司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 6.4.12。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 日	1 个月内	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	23,441,560.25	-	-	-	-	-	23,441,560.25
结算备付金	2,870,740.53	-	-	-	-	-	2,870,740.53
存出保证金	56,275.14	-	-	-	-	1,399,032.00	1,455,307.14
交易性金融资产	-	1,936,421.70	2,034,278.90	-	-	173,013,638.39	176,984,338.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	3,268,158.08	3,268,158.08

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	49.93	49.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,368,575.92	1,936,421.70	2,034,278.90	-	-	177,680,878.40	208,020,154.92
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	-	-	-	-	-	11,893,182.08	11,893,182.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	117,575.92	117,575.92
应付托管费	-	-	-	-	-	19,595.98	19,595.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,971.88	1,971.88
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	16,394.19	16,394.19
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	113,116.67	113,116.67
负债总计	-	-	-	-	-	12,161,836.72	12,161,836.72
利率敏感度缺口	26,368,575.92	1,936,421.70	2,034,278.90	-	-	165,519,041.68	195,858,318.20
上年度末 2024 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	371,097.60	-	-	-	-	-	371,097.60
结算备付金	872,613.56	-	-	-	-	-	872,613.56
存出保证金	1,591.97	-	-	-	-	-	1,591.97
交易性金融资产	-	-	4,662,265.09	1,439,771.51	2,096,786.44	992,730.00	9,191,553.04

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,000,124.66	-	-	-	-	-	1,000,124.66
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,236.16	1,236.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	9,300.00	9,300.00
资产总计	2,245,427.79	-	4,662,265.09	1,439,771.51	2,096,786.44	1,003,266.16	11,447,516.99
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	-	-	-	-	-	10,174.92	10,174.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,908.60	5,908.60
应付托管费	-	-	-	-	-	1,969.51	1,969.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	543.21	543.21
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.04	0.04
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	36,897.46	36,897.46
负债总计	-	-	-	-	-	55,493.74	55,493.74
利率敏感度缺口	2,245,427.79	-	4,662,265.09	1,439,771.51	2,096,786.44	947,772.42	11,392,023.25

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 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(2025 年 06 月 30 日)	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	-	63,987.12
	市场利率上升 25 个基点	-	-62,781.79

注：于本报告期末，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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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公司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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	173,013,638.39	88.34	992,730.00	8.71
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	173,013,638.39	88.34	992,730.00	8.71

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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(2025 年 06 月 30 日)	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	5,842,957.06	-
	沪深 300 指数下降 5%	-5,842,957.06	-

注：于上年度末，本基金持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债的比例较低。因此其他价格风险的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	172,916,101.47	992,730.00
第二层次	3,986,086.14	8,198,823.04
第三层次	82,151.38	-
合计	176,984,338.99	9,191,553.04

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：无）。

6.4.14.4 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	173,013,638.39	83.17
	其中：股票	173,013,638.39	83.17
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,970,700.60	1.91
	其中：债券	3,970,700.60	1.91
	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	26,312,300.78	12.65
8	其他各项资产	4,723,515.15	2.27
9	合计	208,020,154.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,763,452.00	0.90
B	采矿业	8,611,158.00	4.40

C	制造业	87,840,744.54	44.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,485,310.00	3.31
E	建筑业	3,324,929.00	1.70
F	批发和零售业	429,648.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	6,195,211.00	3.16
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,426,607.45	4.30
J	金融业	44,783,768.40	22.87
K	房地产业	1,135,292.00	0.58
L	租赁和商务服务业	1,623,237.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	1,900,073.00	0.97
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	494,208.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	173,013,638.39	88.34

7.2.2 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。

7.3 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	600519	贵州茅台	5,200	7,329,504.00	3.74
2	300750	宁德时代	22,400	5,649,728.00	2.88
3	601318	中国平安	93,088	5,164,522.24	2.64
4	600036	招商银行	107,100	4,921,245.00	2.51
5	300059	东方财富	145,732	3,370,781.16	1.72
6	600900	长江电力	105,800	3,188,812.00	1.63
7	000333	美的集团	41,800	3,017,960.00	1.54
8	601166	兴业银行	126,200	2,945,508.00	1.50
9	002594	比亚迪	7,700	2,555,707.00	1.30
10	601899	紫金矿业	126,000	2,457,000.00	1.25

11	601398	工商银行	297,800	2,260,302.00	1.15
12	600276	恒瑞医药	37,900	1,967,010.00	1.00
13	000858	五 粮 液	16,500	1,961,850.00	1.00
14	601211	国泰海通	96,000	1,839,360.00	0.94
15	000651	格力电器	38,800	1,742,896.00	0.89
16	601288	农业银行	271,300	1,595,244.00	0.81
17	600887	伊利股份	54,700	1,525,036.00	0.78
18	002475	立讯精密	43,900	1,522,891.00	0.78
19	688981	中芯国际	16,866	1,487,075.22	0.76
20	603259	药明康德	21,300	1,481,415.00	0.76
21	601816	京沪高铁	249,400	1,434,050.00	0.73
22	600919	江苏银行	114,700	1,369,518.00	0.70
23	300033	同花顺	4,900	1,337,749.00	0.68
24	000725	京东方 A	317,600	1,267,224.00	0.65
25	600000	浦发银行	89,800	1,246,424.00	0.64
26	002371	北方华创	2,800	1,238,188.00	0.63
27	601881	中国银河	70,000	1,200,500.00	0.61
28	300760	迈瑞医疗	5,200	1,168,700.00	0.60
29	601088	中国神华	28,000	1,135,120.00	0.58
30	300308	中际旭创	7,700	1,123,122.00	0.57
31	688041	海光信息	7,862	1,110,821.98	0.57
32	601601	中国太保	29,100	1,091,541.00	0.56
33	688256	寒武纪	1,812	1,089,918.00	0.56
34	300502	新易盛	8,420	1,069,508.40	0.55
35	300124	汇川技术	16,000	1,033,120.00	0.53
36	601728	中国电信	131,900	1,022,225.00	0.52
37	601668	中国建筑	175,500	1,012,635.00	0.52
38	600016	民生银行	210,900	1,001,775.00	0.51
39	002352	顺丰控股	20,500	999,580.00	0.51
40	000001	平安银行	82,400	994,568.00	0.51
41	002714	牧原股份	23,600	991,436.00	0.51
42	601127	赛力斯	7,100	953,672.00	0.49
43	002230	科大讯飞	19,600	938,448.00	0.48
44	603501	豪威集团	7,200	919,080.00	0.47
45	600031	三一重工	50,400	904,680.00	0.46
46	601229	上海银行	84,500	896,545.00	0.46
47	000063	中兴通讯	27,400	890,226.00	0.45
48	603019	中科曙光	12,400	872,960.00	0.45
49	002415	海康威视	31,400	870,722.00	0.44
50	600309	万华化学	16,000	868,160.00	0.44
51	600941	中国移动	7,700	866,635.00	0.44

52	601169	北京银行	125,800	859,214.00	0.44
53	601857	中国石油	98,000	837,900.00	0.43
54	300274	阳光电源	12,300	833,571.00	0.43
55	601919	中远海控	53,600	806,144.00	0.41
56	688008	澜起科技	9,773	801,386.00	0.41
57	600690	海尔智家	31,900	790,482.00	0.40
58	600660	福耀玻璃	13,600	775,336.00	0.40
59	601688	华泰证券	43,500	774,735.00	0.40
60	601012	隆基绿能	51,500	773,530.00	0.39
61	300498	温氏股份	45,200	772,016.00	0.39
62	002142	宁波银行	28,100	768,816.00	0.39
63	600406	国电南瑞	34,100	764,181.00	0.39
64	601766	中国中车	105,200	740,608.00	0.38
65	600809	山西汾酒	4,100	723,199.00	0.37
66	601138	工业富联	33,700	720,506.00	0.37
67	000568	泸州老窖	6,300	714,420.00	0.36
68	600050	中国联通	132,800	709,152.00	0.36
69	603986	兆易创新	5,600	708,568.00	0.36
70	000338	潍柴动力	46,000	707,480.00	0.36
71	600028	中国石化	123,900	698,796.00	0.36
72	688012	中微公司	3,799	692,557.70	0.35
73	000100	TCL 科技	159,600	691,068.00	0.35
74	601988	中国银行	121,600	683,392.00	0.35
75	601006	大秦铁路	102,700	677,820.00	0.35
76	600926	杭州银行	39,800	669,436.00	0.34
77	601985	中国核电	71,200	663,584.00	0.34
78	601818	光大银行	157,700	654,455.00	0.33
79	601225	陕西煤业	33,000	634,920.00	0.32
80	600104	上汽集团	39,300	630,765.00	0.32
81	002027	分众传媒	85,900	627,070.00	0.32
82	600150	中国船舶	19,000	618,260.00	0.32
83	601009	南京银行	50,900	591,458.00	0.30
84	601628	中国人寿	14,200	584,898.00	0.30
85	688111	金山办公	2,029	568,221.45	0.29
86	605499	东鹏饮料	1,800	565,290.00	0.29
87	600999	招商证券	31,500	554,085.00	0.28
88	603288	海天味业	14,200	552,522.00	0.28
89	600760	中航沈飞	9,400	551,028.00	0.28
90	688271	联影医疗	4,272	545,705.28	0.28
91	600111	北方稀土	21,900	545,310.00	0.28
92	000425	徐工机械	69,900	543,123.00	0.28

93	601939	建设银行	57,100	539,024.00	0.28
94	000625	长安汽车	42,200	538,472.00	0.27
95	000792	盐湖股份	31,500	538,020.00	0.27
96	600938	中国海油	20,300	530,033.00	0.27
97	601658	邮储银行	96,000	525,120.00	0.27
98	600436	片仔癀	2,600	520,026.00	0.27
99	600905	三峡能源	121,600	518,016.00	0.26
100	600089	特变电工	42,900	511,797.00	0.26
101	601888	中国中免	8,300	506,051.00	0.26
102	603993	洛阳钼业	59,700	502,674.00	0.26
103	002050	三花智控	19,000	501,220.00	0.26
104	600547	山东黄金	15,600	498,108.00	0.25
105	300015	爱尔眼科	39,600	494,208.00	0.25
106	600048	保利发展	61,000	494,100.00	0.25
107	002463	沪电股份	11,600	493,928.00	0.25
108	600019	宝钢股份	74,500	490,955.00	0.25
109	600415	小商品城	23,700	490,116.00	0.25
110	601390	中国中铁	87,200	489,192.00	0.25
111	601825	沪农商行	50,100	485,970.00	0.25
112	002241	歌尔股份	20,800	485,056.00	0.25
113	300014	亿纬锂能	10,400	476,424.00	0.24
114	601600	中国铝业	67,400	474,496.00	0.24
115	000977	浪潮信息	8,800	447,744.00	0.23
116	600585	海螺水泥	20,400	437,988.00	0.22
117	002179	中航光电	10,800	435,888.00	0.22
118	600893	航发动力	11,300	435,502.00	0.22
119	601916	浙商银行	128,100	434,259.00	0.22
120	601838	成都银行	21,600	434,160.00	0.22
121	600570	恒生电子	12,900	432,666.00	0.22
122	600958	东方证券	44,400	429,792.00	0.22
123	603799	华友钴业	11,600	429,432.00	0.22
124	600015	华夏银行	54,100	427,931.00	0.22
125	000538	云南白药	7,600	424,004.00	0.22
126	000776	广发证券	25,100	421,931.00	0.22
127	002311	海大集团	7,100	415,989.00	0.21
128	601336	新华保险	7,100	415,350.00	0.21
129	600584	长电科技	12,200	411,018.00	0.21
130	000938	紫光股份	17,000	407,830.00	0.21
131	300408	三环集团	11,600	387,440.00	0.20
132	002028	思源电气	5,300	386,423.00	0.20
133	600438	通威股份	23,000	385,250.00	0.20

134	000166	申万宏源	76,600	384,532.00	0.20
135	300433	蓝思科技	17,200	383,560.00	0.20
136	601077	渝农商行	53,500	381,990.00	0.20
137	002049	紫光国微	5,800	381,988.00	0.20
138	000002	万 科 A	57,800	371,076.00	0.19
139	600795	国电电力	75,800	366,872.00	0.19
140	601377	兴业证券	58,700	363,353.00	0.19
141	600489	中金黄金	24,700	361,361.00	0.18
142	601669	中国电建	73,200	356,484.00	0.18
143	601995	中金公司	9,900	350,064.00	0.18
144	601689	拓普集团	7,400	349,650.00	0.18
145	600010	宝钢股份	192,400	344,396.00	0.18
146	002422	科伦药业	9,500	341,240.00	0.17
147	600009	上海机场	10,600	336,762.00	0.17
148	601100	恒立液压	4,600	331,200.00	0.17
149	600160	巨化股份	11,500	329,820.00	0.17
150	002304	洋河股份	5,100	329,205.00	0.17
151	002460	赣锋锂业	9,600	324,192.00	0.17
152	000768	中航西飞	11,800	322,612.00	0.16
153	300394	天孚通信	3,940	314,569.60	0.16
154	601186	中国铁建	39,100	313,191.00	0.16
155	688036	传音控股	3,897	310,590.90	0.16
156	600183	生益科技	10,300	310,545.00	0.16
157	600886	国投电力	20,800	306,592.00	0.16
158	000157	中联重科	42,200	305,106.00	0.16
159	601360	三六零	29,700	302,940.00	0.15
160	000963	华东医药	7,500	302,700.00	0.15
161	600989	宝丰能源	18,700	301,818.00	0.15
162	002074	国轩高科	9,200	298,632.00	0.15
163	601788	光大证券	16,600	298,468.00	0.15
164	300442	润泽科技	6,000	297,180.00	0.15
165	601058	赛轮轮胎	22,400	293,888.00	0.15
166	600115	中国东航	72,700	292,981.00	0.15
167	000807	云铝股份	17,700	282,846.00	0.14
168	002736	国信证券	24,500	282,240.00	0.14
169	002466	天齐锂业	8,800	281,952.00	0.14
170	600066	宇通客车	11,300	280,918.00	0.14
171	688169	石头科技	1,794	280,850.70	0.14
172	002001	新 和 成	13,100	278,637.00	0.14
173	000661	长春高新	2,800	277,704.00	0.14
174	601901	方正证券	35,000	276,850.00	0.14

175	600426	华鲁恒升	12,600	273,042.00	0.14
176	600674	川投能源	16,900	271,076.00	0.14
177	600196	复星医药	10,800	270,972.00	0.14
178	600029	南方航空	45,800	270,220.00	0.14
179	001979	招商蛇口	30,800	270,116.00	0.14
180	000975	山金国际	14,200	268,948.00	0.14
181	601800	中国交建	30,200	268,478.00	0.14
182	301236	软通动力	4,900	267,736.00	0.14
183	600011	华能国际	37,400	267,036.00	0.14
184	002236	大华股份	16,800	266,784.00	0.14
185	300661	圣邦股份	3,660	266,338.20	0.14
186	688126	沪硅产业	13,988	261,855.36	0.13
187	600346	恒力石化	17,900	255,254.00	0.13
188	601878	浙商证券	23,300	254,203.00	0.13
189	603369	今世缘	6,500	253,045.00	0.13
190	300418	昆仑万维	7,500	252,225.00	0.13
191	601111	中国国航	31,800	250,902.00	0.13
192	600372	中航机载	20,600	248,436.00	0.13
193	002648	卫星化学	14,300	247,819.00	0.13
194	003816	中国广核	68,000	247,520.00	0.13
195	002916	深南电路	2,290	246,884.90	0.13
196	601868	中国能建	110,200	245,746.00	0.13
197	600460	士兰微	9,900	245,718.00	0.13
198	002920	德赛西威	2,400	245,112.00	0.13
199	601319	中国人保	27,600	240,396.00	0.12
200	601117	中国化学	31,100	238,537.00	0.12
201	688506	百利天恒	800	236,896.00	0.12
202	600741	华域汽车	13,400	236,510.00	0.12
203	300347	泰格医药	4,400	234,608.00	0.12
204	601021	春秋航空	4,200	233,730.00	0.12
205	600588	用友网络	17,400	232,638.00	0.12
206	600176	中国巨石	20,400	232,560.00	0.12
207	002601	龙佰集团	14,200	230,182.00	0.12
208	300782	卓胜微	3,200	228,384.00	0.12
209	000786	北新建材	8,600	227,728.00	0.12
210	601633	长城汽车	10,600	227,688.00	0.12
211	300896	爱美客	1,300	227,253.00	0.12
212	600219	南山铝业	59,200	226,736.00	0.12
213	301269	华大九天	1,800	222,984.00	0.11
214	600482	中国动力	9,600	221,472.00	0.11
215	302132	中航成飞	2,500	219,850.00	0.11

216	600039	四川路桥	22,200	219,780.00	0.11
217	000630	铜陵有色	65,200	217,768.00	0.11
218	688396	华润微	4,603	217,077.48	0.11
219	600600	青岛啤酒	3,100	215,326.00	0.11
220	000895	双汇发展	8,800	214,808.00	0.11
221	002493	荣盛石化	25,800	213,624.00	0.11
222	002129	TCL 中环	27,500	211,200.00	0.11
223	603296	华勤技术	2,600	209,768.00	0.11
224	600085	同仁堂	5,800	209,148.00	0.11
225	001965	招商公路	17,400	208,800.00	0.11
226	002709	天赐材料	11,400	206,568.00	0.11
227	601877	正泰电器	9,100	206,297.00	0.11
228	600362	江西铜业	8,800	206,184.00	0.11
229	002600	领益智造	23,800	204,442.00	0.10
230	688047	龙芯中科	1,500	200,085.00	0.10
231	300122	智飞生物	10,200	199,818.00	0.10
232	603392	万泰生物	3,200	195,200.00	0.10
233	002180	纳思达	8,500	194,990.00	0.10
234	600161	天坛生物	10,100	193,819.00	0.10
235	002938	鹏鼎控股	5,900	188,977.00	0.10
236	600233	圆通速递	14,600	188,194.00	0.10
237	000301	东方盛虹	22,500	187,425.00	0.10
238	300832	新产业	3,300	187,176.00	0.10
239	000596	古井贡酒	1,400	186,410.00	0.10
240	600188	兖矿能源	15,200	184,984.00	0.09
241	300759	康龙化成	7,500	184,050.00	0.09
242	600023	浙能电力	34,200	181,260.00	0.09
243	601618	中国中冶	60,700	180,886.00	0.09
244	000876	新 希 望	19,200	180,096.00	0.09
245	000999	华润三九	5,680	177,670.40	0.09
246	688223	晶科能源	33,976	176,335.44	0.09
247	600875	东方电气	10,400	174,096.00	0.09
248	600845	宝信软件	7,300	172,426.00	0.09
249	601872	招商轮船	27,400	171,524.00	0.09
250	601898	中煤能源	15,600	170,664.00	0.09
251	002459	晶澳科技	16,900	168,662.00	0.09
252	605117	德业股份	3,100	163,246.00	0.08
253	600061	国投资本	21,700	163,184.00	0.08
254	688599	天合光能	11,103	161,326.59	0.08
255	600332	白云山	6,100	160,796.00	0.08
256	600027	华电国际	28,900	158,083.00	0.08

257	000617	中油资本	21,500	156,950.00	0.08
258	000983	山西焦煤	24,100	154,240.00	0.08
259	300316	晶盛机电	5,600	152,040.00	0.08
260	300999	金龙鱼	5,100	150,603.00	0.08
261	601799	星宇股份	1,200	150,000.00	0.08
262	300628	亿联网络	4,300	149,468.00	0.08
263	600803	新奥股份	7,900	149,310.00	0.08
264	601698	中国卫通	7,200	147,384.00	0.08
265	600025	华能水电	15,300	146,115.00	0.07
266	603260	合盛硅业	3,000	142,200.00	0.07
267	601059	信达证券	8,300	141,930.00	0.07
268	601238	广汽集团	18,800	140,812.00	0.07
269	300413	芒果超媒	6,400	139,648.00	0.07
270	600018	上港集团	24,200	138,182.00	0.07
271	601607	上海医药	7,100	126,948.00	0.06
272	600026	中远海能	11,800	121,894.00	0.06
273	688303	大全能源	5,603	119,455.96	0.06
274	603806	福斯特	8,900	115,344.00	0.06
275	688009	中国通号	22,329	114,771.06	0.06
276	688472	阿特斯	12,520	114,558.00	0.06
277	603195	公牛集团	2,340	112,905.00	0.06
278	601699	潞安环能	10,200	107,610.00	0.05
279	601865	福莱特	6,600	100,386.00	0.05
280	688187	时代电气	2,213	94,384.45	0.05
281	603833	欧派家居	1,600	90,320.00	0.05
282	688082	盛美上海	700	79,758.00	0.04
283	601808	中海油服	5,000	68,800.00	0.04
284	300979	华利集团	1,300	68,341.00	0.03
285	600377	宁沪高速	4,200	64,428.00	0.03
286	000800	一汽解放	8,400	57,624.00	0.03
287	688775	影石创新	207	25,701.12	0.01
288	001289	龙源电力	1,300	21,034.00	0.01
289	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
290	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
291	301590	优优绿能	59	8,229.32	0.00
292	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
293	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
294	603049	中策橡胶	119	5,099.15	0.00
295	603014	威高血净	133	4,346.44	0.00
296	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
297	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00

298	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

注：国泰海通由国泰君安与海通证券合并而成，自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起国泰君安作为合并后的存续公司，承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，2025 年 4 月 11 日其 A 股证券简称变更为国泰海通。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	10,869,747.00	95.42
2	300750	宁德时代	7,320,172.00	64.26
3	601318	中国平安	6,095,525.12	53.51
4	600036	招商银行	5,848,049.00	51.33
5	300059	东方财富	4,314,786.04	37.88
6	000333	美的集团	4,107,084.19	36.05
7	600900	长江电力	3,746,143.00	32.88
8	002594	比亚迪	3,735,397.00	32.79
9	601166	兴业银行	3,424,715.34	30.06
10	601899	紫金矿业	3,256,513.00	28.59
11	601211	国泰海通	3,249,169.00	28.52
12	000858	五 粮 液	2,828,486.00	24.83
13	601398	工商银行	2,634,933.00	23.13
14	600276	恒瑞医药	2,359,767.00	20.71
15	000651	格力电器	2,228,623.00	19.56
16	002475	立讯精密	2,200,528.00	19.32
17	600887	伊利股份	1,983,512.00	17.41
18	688981	中芯国际	1,976,077.88	17.35
19	601788	光大证券	1,964,461.00	17.24
20	601688	华泰证券	1,870,164.00	16.42
21	601816	京沪高铁	1,818,283.00	15.96
22	601288	农业银行	1,803,925.00	15.83
23	603259	药明康德	1,794,543.00	15.75
24	300033	同花顺	1,755,033.00	15.41
25	000725	京东方 A	1,683,166.00	14.77
26	300124	汇川技术	1,601,638.00	14.06
27	300760	迈瑞医疗	1,580,808.00	13.88
28	600919	江苏银行	1,535,761.00	13.48
29	601881	中国银河	1,514,492.00	13.29
30	002371	北方华创	1,484,432.00	13.03

31	688041	海光信息	1,446,109.48	12.69
32	688256	寒武纪	1,403,149.63	12.32
33	600309	万华化学	1,384,077.00	12.15
34	601088	中国神华	1,377,211.00	12.09
35	600000	浦发银行	1,348,575.26	11.84
36	601728	中国电信	1,323,968.00	11.62
37	601988	中国银行	1,277,820.00	11.22
38	600031	三一重工	1,246,699.00	10.94
39	002415	海康威视	1,239,837.00	10.88
40	603501	豪威集团	1,231,275.00	10.81
41	601668	中国建筑	1,228,692.00	10.79
42	000063	中兴通讯	1,203,849.00	10.57
43	000001	平安银行	1,202,932.00	10.56
44	601601	中国太保	1,201,136.00	10.54
45	002714	牧原股份	1,191,676.00	10.46
46	002230	科大讯飞	1,178,433.00	10.34
47	600809	山西汾酒	1,164,889.00	10.23
48	601127	赛力斯	1,142,274.00	10.03
49	002352	顺丰控股	1,121,170.00	9.84
50	600690	海尔智家	1,118,345.00	9.82
51	300274	阳光电源	1,111,985.00	9.76
52	601012	隆基绿能	1,101,954.00	9.67
53	600016	民生银行	1,089,081.00	9.56
54	000568	泸州老窖	1,065,881.00	9.36
55	600941	中国移动	1,062,147.00	9.32
56	603019	中科曙光	1,060,467.00	9.31
57	601229	上海银行	1,055,180.00	9.26
58	600660	福耀玻璃	1,020,368.00	8.96
59	601919	中远海控	1,012,217.00	8.89
60	601857	中国石油	1,006,723.00	8.84
61	300498	温氏股份	990,996.00	8.70
62	600406	国电南瑞	988,628.00	8.68
63	601169	北京银行	982,541.00	8.62
64	600050	中国联通	970,987.20	8.52
65	601766	中国中车	964,639.00	8.47
66	688008	澜起科技	960,623.17	8.43
67	600760	中航沈飞	951,074.00	8.35
68	000338	潍柴动力	950,884.00	8.35
69	300308	中际旭创	941,991.00	8.27
70	002142	宁波银行	940,633.00	8.26
71	600028	中国石化	922,407.00	8.10

72	000100	TCL 科技	911,359.00	8.00
73	688012	中微公司	891,682.65	7.83
74	601138	工业富联	860,960.00	7.56
75	601006	大秦铁路	855,413.00	7.51
76	603986	兆易创新	848,615.00	7.45
77	601225	陕西煤业	848,484.00	7.45
78	601985	中国核电	839,799.00	7.37
79	601100	恒立液压	825,948.00	7.25
80	600104	上汽集团	788,453.00	6.92
81	000425	徐工机械	782,545.00	6.87
82	002027	分众传媒	779,036.09	6.84
83	601818	光大银行	774,688.00	6.80
84	600150	中国船舶	752,644.00	6.61
85	603288	海天味业	751,769.00	6.60
86	688111	金山办公	745,153.51	6.54
87	300502	新易盛	740,181.00	6.50
88	600999	招商证券	727,319.00	6.38
89	002050	三花智控	712,946.00	6.26
90	600926	杭州银行	705,171.00	6.19
91	600019	宝钢股份	701,862.00	6.16
92	000625	长安汽车	701,602.00	6.16
93	000792	盐湖股份	690,128.00	6.06
94	002241	歌尔股份	689,635.00	6.05
95	601628	中国人寿	689,560.00	6.05
96	300015	爱尔眼科	686,437.00	6.03
97	000938	紫光股份	681,179.00	5.98
98	600089	特变电工	677,901.00	5.95
99	600426	华鲁恒升	676,376.00	5.94
100	600436	片仔癀	673,979.00	5.92
101	600938	中国海油	673,503.00	5.91
102	600905	三峡能源	669,037.80	5.87
103	601888	中国中免	667,443.00	5.86
104	600048	保利发展	665,833.00	5.84
105	688271	联影医疗	662,293.89	5.81
106	601390	中国中铁	649,882.00	5.70
107	600585	海螺水泥	648,210.00	5.69
108	601600	中国铝业	648,177.00	5.69
109	600111	北方稀土	644,703.00	5.66
110	601658	邮储银行	639,335.00	5.61
111	601939	建设银行	639,283.00	5.61
112	300014	亿纬锂能	634,035.00	5.57

113	601009	南京银行	629,606.00	5.53
114	000977	浪潮信息	595,325.00	5.23
115	603993	洛阳钼业	588,581.00	5.17
116	002179	中航光电	583,545.00	5.12
117	600438	通威股份	582,961.00	5.12
118	601117	中国化学	572,996.00	5.03
119	300408	三环集团	569,891.04	5.00
120	688047	龙芯中科	568,699.23	4.99
121	601825	沪农商行	561,221.00	4.93
122	600584	长电科技	555,319.00	4.87
123	000538	云南白药	551,534.80	4.84
124	600958	东方证券	550,258.00	4.83
125	302132	中航成飞	544,185.00	4.78
126	300433	蓝思科技	543,645.00	4.77
127	600015	华夏银行	538,518.00	4.73
128	002028	思源电气	538,517.00	4.73
129	301236	软通动力	532,229.00	4.67
130	000002	万 科 A	531,823.00	4.67
131	605499	东鹏饮料	529,905.00	4.65
132	600547	山东黄金	529,885.00	4.65
133	600893	航发动力	528,298.00	4.64
134	000776	广发证券	522,014.00	4.58
135	601689	拓普集团	512,892.00	4.50
136	300759	康龙化成	512,476.00	4.50
137	603799	华友钴业	510,440.00	4.48
138	002049	紫光国微	505,433.00	4.44
139	002304	洋河股份	505,068.00	4.43
140	000166	申万宏源	494,902.00	4.34
141	601916	浙商银行	488,645.00	4.29
142	601838	成都银行	479,690.00	4.21
143	002463	沪电股份	472,507.00	4.15
144	601336	新华保险	470,819.00	4.13
145	600570	恒生电子	470,227.00	4.13
146	601669	中国电建	460,288.00	4.04
147	002311	海大集团	457,113.00	4.01
148	600010	包钢股份	454,224.00	3.99
149	002422	科伦药业	454,140.00	3.99
150	688036	传音控股	451,870.60	3.97
151	601377	兴业证券	448,905.00	3.94
152	600415	小商品城	444,269.00	3.90
153	600009	上海机场	443,015.00	3.89

154	601995	中金公司	442,902.00	3.89
155	600489	中金黄金	439,795.00	3.86
156	603369	今世缘	438,703.00	3.85
157	601077	渝农商行	434,019.00	3.81
158	300442	润泽科技	431,101.00	3.78
159	600795	国电电力	430,740.00	3.78
160	601058	赛轮轮胎	427,514.00	3.75
161	601901	方正证券	424,943.00	3.73
162	002460	赣锋锂业	419,243.00	3.68
163	002600	领益智造	412,918.00	3.62
164	000157	中联重科	412,139.00	3.62
165	601186	中国铁建	411,264.00	3.61
166	002648	卫星化学	402,166.00	3.53
167	601360	三六零	400,648.00	3.52
168	688169	石头科技	390,026.00	3.42
169	000807	云铝股份	388,366.00	3.41
170	600066	宇通客车	386,364.00	3.39
171	600886	国投电力	378,809.00	3.33
172	002001	新 和 成	376,867.00	3.31
173	001979	招商蛇口	376,170.00	3.30
174	600989	宝丰能源	370,045.00	3.25
175	000768	中航西飞	369,106.00	3.24
176	002236	大华股份	367,924.00	3.23
177	601800	中国交建	362,739.00	3.18
178	600160	巨化股份	358,601.00	3.15
179	600183	生益科技	358,491.00	3.15
180	600346	恒力石化	358,380.00	3.15
181	601633	长城汽车	356,025.00	3.13
182	600115	中国东航	352,512.00	3.09
183	600196	复星医药	348,004.00	3.05
184	600029	南方航空	347,398.00	3.05
185	000963	华东医药	346,842.00	3.04
186	000661	长春高新	346,662.00	3.04
187	601878	浙商证券	346,348.00	3.04
188	600674	川投能源	344,919.00	3.03
189	000975	山金国际	343,155.00	3.01
190	002466	天齐锂业	342,619.00	3.01
191	600588	用友网络	340,210.00	2.99
192	002920	德赛西威	336,480.00	2.95
193	300418	昆仑万维	335,394.00	2.94
194	300782	卓胜微	333,185.00	2.92

195	600011	华能国际	333,061.00	2.92
196	688126	沪硅产业	332,236.97	2.92
197	600176	中国巨石	331,954.00	2.91
198	002601	龙佰集团	330,804.00	2.90
199	002736	国信证券	327,390.00	2.87
200	601868	中国能建	326,820.00	2.87
201	000786	北新建材	322,644.00	2.83
202	002129	TCL 中环	321,266.00	2.82
203	300122	智飞生物	320,839.00	2.82
204	300661	圣邦股份	320,005.00	2.81
205	003816	中国广核	315,489.00	2.77
206	600745	闻泰科技	313,774.00	2.75
207	000596	古井贡酒	313,403.00	2.75
208	600460	士兰微	310,145.00	2.72
209	300896	爱美客	308,033.00	2.70
210	600741	华域汽车	307,199.00	2.70
211	000895	双汇发展	305,840.00	2.68
212	600372	中航机载	305,423.00	2.68
213	300394	天孚通信	304,896.00	2.68
214	601111	中国国航	303,491.00	2.66
215	300803	指南针	303,335.00	2.66
216	600600	青岛啤酒	299,905.00	2.63
217	300347	泰格医药	296,018.00	2.60
218	688223	晶科能源	294,077.48	2.58
219	001965	招商公路	293,261.00	2.57
220	002493	荣盛石化	289,925.00	2.54
221	000630	铜陵有色	289,501.00	2.54
222	600219	南山铝业	289,295.00	2.54
223	601021	春秋航空	286,823.00	2.52
224	002271	东方雨虹	286,398.00	2.51
225	002916	深南电路	285,052.00	2.50
226	600845	宝信软件	284,594.00	2.50
227	301269	华大九天	282,144.00	2.48
228	601877	正泰电器	277,532.00	2.44
229	002180	纳思达	277,381.00	2.43
230	600085	同仁堂	276,152.00	2.42
231	603392	万泰生物	275,732.00	2.42
232	002709	天赐材料	275,512.00	2.42
233	600482	中国动力	271,084.00	2.38
234	002938	鹏鼎控股	269,096.00	2.36
235	605117	德业股份	268,130.00	2.35

236	600161	天坛生物	267,325.00	2.35
237	600188	兖矿能源	266,259.00	2.34
238	688396	华润微	262,913.85	2.31
239	600362	江西铜业	262,821.00	2.31
240	002459	晶澳科技	261,274.00	2.29
241	002074	国轩高科	259,272.00	2.28
242	603296	华勤技术	257,253.00	2.26
243	002555	三七互娱	256,063.00	2.25
244	300450	先导智能	252,435.00	2.22
245	600023	浙能电力	249,212.00	2.19
246	000301	东方盛虹	247,695.00	2.17
247	300832	新产业	246,741.00	2.17
248	600233	圆通速递	244,703.00	2.15
249	601618	中国中冶	243,033.00	2.13
250	601319	中国人保	240,502.00	2.11
251	000999	华润三九	238,854.00	2.10
252	000876	新希望	235,694.00	2.07
253	688599	天合光能	234,614.45	2.06
254	600039	四川路桥	232,699.00	2.04
255	300316	晶盛机电	231,814.00	2.03
256	601607	上海医药	230,924.00	2.03
257	601872	招商轮船	228,567.00	2.01

注：1、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。

2、国泰海通由国泰君安与海通证券合并而成，自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起国泰君安作为合并后的存续公司，承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，2025 年 4 月 11 日其 A 股证券简称变更为国泰海通。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	2,443,362.00	21.45
2	601211	国泰海通	1,739,874.84	15.27
3	601788	光大证券	1,711,380.00	15.02
4	300750	宁德时代	1,664,926.00	14.61
5	601318	中国平安	1,399,544.00	12.29
6	600036	招商银行	1,330,005.00	11.67
7	601688	华泰证券	1,179,247.00	10.35
8	601899	紫金矿业	1,057,470.00	9.28
9	300059	东方财富	1,039,548.00	9.13
10	600900	长江电力	868,597.00	7.62

11	000333	美的集团	857,242.00	7.52
12	601166	兴业银行	788,038.00	6.92
13	002594	比亚迪	760,664.00	6.68
14	601398	工商银行	640,386.00	5.62
15	600276	恒瑞医药	599,292.00	5.26
16	601988	中国银行	589,290.00	5.17
17	000858	五 粮 液	581,480.00	5.10
18	600760	中航沈飞	570,566.00	5.01
19	600919	江苏银行	554,304.00	4.87
20	600000	浦发银行	516,341.00	4.53
21	300124	汇川技术	482,837.00	4.24
22	000651	格力电器	469,318.00	4.12
23	601288	农业银行	459,590.00	4.03
24	601100	恒立液压	444,564.00	3.90
25	601816	京沪高铁	425,851.00	3.74
26	600887	伊利股份	424,355.00	3.73
27	688981	中芯国际	418,636.00	3.67
28	603259	药明康德	414,439.00	3.64
29	600426	华鲁恒升	404,258.00	3.55
30	688047	龙芯中科	380,463.08	3.34
31	002475	立讯精密	378,123.00	3.32
32	601881	中国银河	367,060.00	3.22
33	300760	迈瑞医疗	349,591.00	3.07
34	601117	中国化学	347,835.00	3.05
35	000725	京东方 A	345,264.00	3.03
36	300033	同花顺	332,940.00	2.92
37	302132	中航成飞	330,808.00	2.90
38	688775	影石创新	326,671.98	2.87
39	688041	海光信息	324,609.44	2.85
40	601088	中国神华	324,029.00	2.84
41	300803	指南针	311,143.00	2.73
42	601601	中国太保	309,067.00	2.71
43	300759	康龙化成	303,917.00	2.67
44	601668	中国建筑	303,575.00	2.66
45	600745	闻泰科技	297,250.00	2.61
46	600016	民生银行	296,578.00	2.60
47	601728	中国电信	296,257.00	2.60
48	002371	北方华创	293,142.00	2.57
49	002352	顺丰控股	288,561.08	2.53
50	000001	平安银行	287,863.00	2.53
51	301236	软通动力	280,140.00	2.46

52	300502	新易盛	279,178.00	2.45
53	002714	牧原股份	274,723.00	2.41
54	603501	豪威集团	264,900.00	2.33
55	601229	上海银行	263,361.00	2.31
56	300450	先导智能	262,993.00	2.31
57	600031	三一重工	262,711.00	2.31
58	002555	三七互娱	261,447.00	2.30
59	603019	中科曙光	259,398.00	2.28
60	300308	中际旭创	255,936.00	2.25
61	601127	赛力斯	255,774.00	2.25
62	601919	中远海控	254,811.00	2.24
63	600309	万华化学	253,414.00	2.22
64	000063	中兴通讯	252,935.00	2.22
65	002415	海康威视	252,794.00	2.22
66	002230	科大讯飞	248,140.00	2.18
67	688256	寒武纪	247,423.90	2.17
68	600941	中国移动	247,173.00	2.17
69	601169	北京银行	246,852.00	2.17
70	300274	阳光电源	232,215.00	2.04
71	601857	中国石油	231,984.00	2.04
72	600690	海尔智家	231,233.00	2.03
73	300498	温氏股份	230,960.00	2.03
74	600660	福耀玻璃	230,279.00	2.02
75	600809	山西汾酒	228,578.00	2.01

注：1、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。

2、国泰海通由国泰君安与海通证券合并而成，自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起国泰君安作为合并后的存续公司，承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，2025 年 4 月 11 日其 A 股证券简称变更为国泰海通。

7.4.3 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	232,103,290.94
卖出股票收入（成交）总额	62,860,515.76

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。

7.5 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	3,970,700.60	2.03
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	3,970,700.60	2.03

7.6 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	019730	23 国债 27	20,000	2,034,278.90	1.04
2	019723	23 国债 20	19,000	1,936,421.70	0.99

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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中，报告编制日前一年内，兴业银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局福建监管局处罚（闽金罚决字[2024]12 号）。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的经营状况，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,455,307.14
2	应收清算款	3,268,158.08
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	49.93
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,723,515.15

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
中信保诚新锐混合 A	925	189,941.96	171,658,442.80	97.70%	4,037,869.11	2.30%
中信保诚新锐混合 B	941	8,979.64	—	—	8,449,839.76	100.00%
合计	1,866	98,684.97	171,658,442.80	93.22%	12,487,708.87	6.78%

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。

8.2 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	中信保诚新锐混合 A	586.72	0.00%
	中信保诚新锐混合 B	28.89	0.00%
	合计	615.61	0.00%

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。

8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信保诚新锐混合 A	0~10
	中信保诚新锐混合 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放	中信保诚新锐混合	0

式基金	A	
	中信保诚新锐混合 B	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚新锐混合 A	中信保诚新锐混合 B
基金合同生效日（2015 年 06 月 11 日）基金份额总额	200,939,434.62	1,000.00
本报告期期初基金份额总额	4,942,251.17	5,521,898.74
本报告期基金总申购份额	204,740,702.93	34,947,918.50
减：本报告期基金总赎回份额	33,986,642.19	32,019,977.48
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	175,696,311.91	8,449,839.76

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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 2025 年 4 月 21 日起，刘业伟先生不再担任中信保诚基金管理有限公司副总经理职务。上述变更事项已按规定公告并向监管机构备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化，为毕马威华振会计师事务所（特

殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国金证券	2	149,843,872.75	50.87%	68,298.44	50.87%	—
华安证券	1	21,668,621.19	7.36%	9,879.39	7.36%	—
招商证券	2	123,022,896.84	41.77%	56,079.23	41.77%	—

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

10.7.2 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
国金证券	6,388,984.00	100.00%	21,300,000.00	100.00%	—	—	—	—
华安证券	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—	—	—

注：本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

10.8 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	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《证券时报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025年01月21日
2	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	同上	2025年02月06日
3	中信保诚新锐回报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	2025年02月10日
4	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025年02月10日
5	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	同上	2025年02月10日
6	中信保诚基金管理有限公司关于中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额开展直销柜台申购费率优惠活动的公告	同上	2025年03月25日
7	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	同上	2025年03月28日
8	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	同上	2025年04月21日
9	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议	同上	2025年04月28日
10	关于中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金降低托管费、变更业绩比较基准、调整基金份额精度并修改基金合同及托管协议的公告	同上	2025年04月28日
11	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2025年04月28日
12	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025年04月29日
13	中信保诚新锐回报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	同上	2025年04月29日

	更新		
14	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	同上	2025年04月29日
15	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025年05月30日
16	中信保诚新锐回报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	2025年05月30日
17	中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 5 月）	同上	2025年05月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2025-03-26 至 2025-03-26	-	18,955,289.34	-	18,955,289.34	10.29%
	2	2025-03-28 至 2025-05-22, 2025-06-13 至 2025-06-30	-	47,891,762.45	-	47,891,762.45	26.01%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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： (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； (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； (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； (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； (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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2025 年 4 月 28 日发布的《关于中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资

基金降低托管费、变更业绩比较基准、调整基金份额精度并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2025 年 4 月 28 日起降低托管费、变更业绩比较基准、调整基金份额精度并对基金合同等法律文件进行修订。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、（原）信诚新锐回报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、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚新锐回报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

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 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
2025 年 08 月 29 日