

中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 01 月 21 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 20 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 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	中信保诚创新成长
基金主代码	006392
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 01 月 30 日
报告期末基金份额总额	887,686,531.10 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极投资于具有较高成长性和较强创新能力的上市公司股票，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、港股、债券、现金等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p>

2、股票投资策略

(1) 创新成长主题的界定

本基金注重挖掘具备较强创新能力、具备创新可持续性、或具备较高成长性的上市公司。本基金将着重挖掘：能够通过产品创新、服务创新、技术创新、流程创新、管理创新或商业模式创新等方式提升创新能力，从而提升生产运营效率、降低成本、提高产品质量或提升客户服务水平，进而提升长期竞争优势或盈利能力的上市公司；或能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司；同时，本基金还将着重挖掘能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。

1) 本基金注重挖掘具备较强创新能力的上市公司。

①产品创新、服务创新、技术创新：产品创新包括创造某种新产品或对某一新或老产品的功能进行创新。服务创新指使潜在用户感受到不同于从前的崭新内容，包括新的设想、新的技术手段转变成新的或者改进的服务方式。技术创新包括开发新技术，或者将已有的技术进行应用创新。企业通过上述创新方式可以进入蓝海，降低成本、提高产品质量、提高企业生产效率、提升客户服务水平等从而提升企业长期竞争优势和盈利能力。

②流程创新：包括利用云技术、大数据、机器人、人工智能等技术进行智能化流程改造，提高精准制造和柔性敏捷制造的能力，发展基于互联网的个性化定制、云制造等新型制造模式，从而提升企业制造创新和盈利能力。

③管理创新：管理创新指企业把新管理方法、管理工具、管理模式、管理制度等要素组合引入企业管理系统以更有效地实现企业的运作，包括引入外部战略投资者、股权激励、制度创新等。企业通过管理创新，可以提升企业运作效率，解放生产力，从而最终提高盈利能力。

④商业模式创新：指企业创造价值的基本逻辑发生了变化。商业模式的创新通常通过改变收入模式、改变企业模式和改变产业模式进行。改变收入模式包括企业重新定位并更好地满足客户需求从而改善企业收入；改变企业模式包括企业重新定位产业链中的位置，通过垂直整合等方式实现盈利模式的改变；改变产业模式包括企业重新定义本产业，进入或者创造一个新产业，从而使企业具备核心竞争优势。2) 本基金注重挖掘具备创新可持续性的上市公司。

本基金重点关注能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司。企业能够通过在产品、技术、材料、工艺、标准等方面的研究和投入，改善竞争能力，增强在市场中的话语权

和盈利能力。具体而言，本基金将重点关注研发费用每年超过 2 亿元人民币或研发费用占比销售收入高于 2% 的具备较强创新可持续性的上市公司。

3) 本基金注重挖掘具备较高成长性的上市公司。

本基金重点关注能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。

①对于内生增长型公司，这类公司通常资产盈利能力较强，具备内生增长特质。本基金将重点关注在所属行业或细分行业中主营业务收入增速高于行业平均水平或大于 20% 的上市公司，同时将考察其所处行业的竞争格局、业务模式、经营管理效率、未来成长预期及股票的估值水平，从而做出投资判断和决定。

②对于外延增长型公司，这类公司主要通过并购重组等方式实现经营规模扩张的公司。本基金将通过深入的研究，综合评估并购重组企业的行业增长前景；以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应，包括通过并购重组方式实现公司的经营规模扩张、经营效率改善、利润水平大幅提高等，从而做出投资判断和决定。

(2) 个股精选

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成长前景、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。

由于本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，因而本基金将在前述股票投资策略的基础上严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。

(3) 灵活调整股票资产配置比例

本基金主要通过考量盈利增速与估值的匹配程度来灵活调整股票资产的配置比例。具体而言，本基金将采用沪深 300 指数作为市场的代表性指数，基于上市公司定期报告数据或市场预期数据，计算沪深 300 指数的市场市盈率对盈利增长率的比率（PEG），并以此为基准调整本基金的股票资产比例配置。当沪深 300 指数的 PEG 大于 3 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 0-50%；当沪深 300 指数的 PEG 大于 2 且小于等于 3 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 40%-80%；当沪深 300 指数的 PEG 小于等于 2 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 50%-95%。基金管理人应当自上述条件

触发之日的下一工作日起 10 个工作日内将本基金股票资产比例调整至符合上述比例范围。

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、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。

6、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、国债期货投资策略

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

8、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

	<p>内在价值，构建交易组合。</p> <p>9、股票期权投资策略 本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>10、融资投资策略 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 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	沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*40%。
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。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。
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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（2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	81,542,965.95
2. 本期利润	201,535,030.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3008
4. 期末基金资产净值	3,361,995,911.02
5. 期末基金份额净值	3.7874

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。

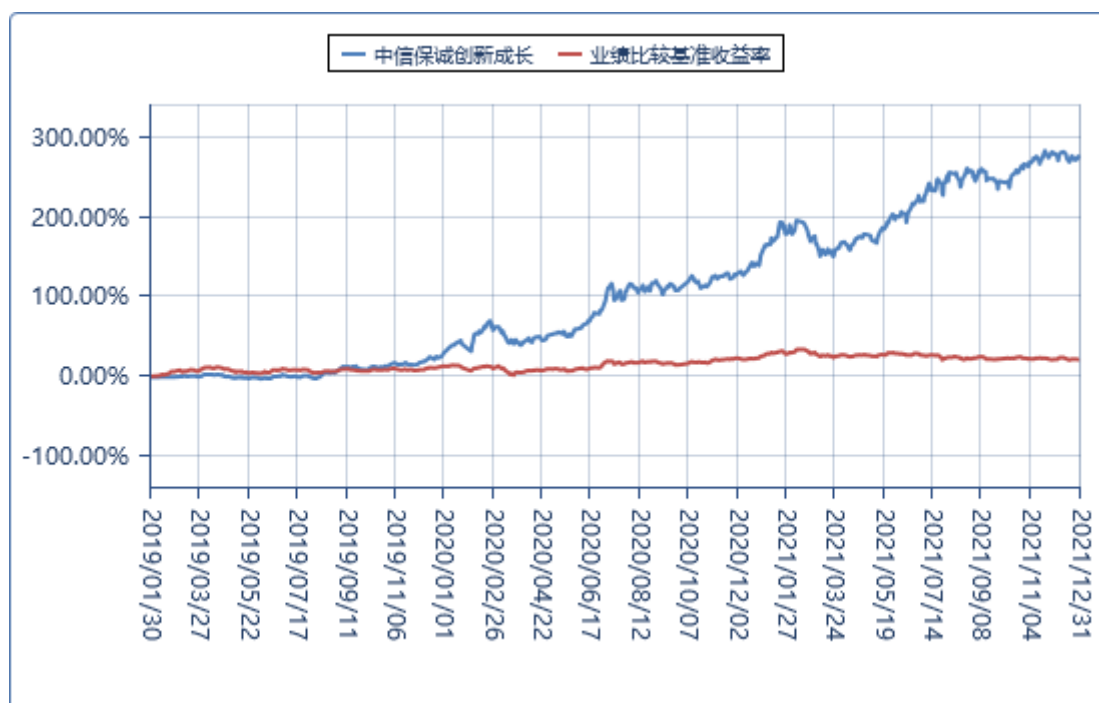
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	9.43%	1.02%	0.20%	0.46%	9.23%	0.56%
过去六个月	15.49%	1.36%	-4.88%	0.60%	20.37%	0.76%
过去一年	49.71%	1.47%	-2.58%	0.65%	52.29%	0.82%
自基金合同生效起 至今	278.74%	1.45%	22.98%	0.70%	255.76%	0.75%

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



§ 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	本基金基金经理、权益投资部总监	2019 年 01 月 30 日	-	12	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, 信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、信诚新兴产业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、信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. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金合同》、《中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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》，以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》，公司采取了一系列的行动实际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，投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境；交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以了严格的行为监控，分析评估以及报告与信息披露。当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

本报告期内，未发现本基金与其它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。报告期内，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（完全复制的指数基金除外）。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

A 股市场 21 年四季度处在一个区间震荡的状态，12 月之前创业板为代表的科技成长更强，进入 12 月后上证指数略强一些，整个四季度，创业板指收涨 2.4%，上证指数收涨 2%；市场整体风格上呈现出行情扩散和市值下沉的特征，四季度代表中小市值股票的中证 1000 和国证 2000 指数分别上涨了 8% 和 11%。伴随着行情的扩散，市场的交易相对活跃，两市成交量在绝大部分时间内都维持在 1 万亿以上。从行业和主题的角度，前三季度非常活跃的电动车，半导体等在四季度出现了比较明显的回调，而汽车行业的另一个方向性的变化智能化则受到了市场的追捧。元宇宙也是四季度相对活跃的主题，低位的传媒股估值在短期得到了较快的修复。与汽车智能化以及 VR 相关的消费电子，通讯等反弹的幅度也比较明显。四季度另一个比较重大的变化来自于传统经济领域，恒大等地产公司的负债问题进一步暴露；利空出尽叠加保增长预期，反而给相关产业链的股票带来了上涨的机会。

目前宏观经济整体的压力是比较大的，市场对于经济下行的预期也比较一致。四季度央行实施了降

准等宽松措施，但目前看仍然没法改变经济运行的方向。应对这种状况，相对宽松的货币信用环境可能会是接下来比较大概率的方向；同时，基建也会发力，我们预计 5G 网络，电网设备等新型基建会是主要的发力方向。新冠病毒在四季度又给经济复苏带来了一些影响，新的变异大大提升了感染率，导致海外的感染人数再创新高，同时国内零星的爆发也给地方经济以及全国的通行带来负面影响；22 年变异后病毒对全球的影响仍然是个未知但重要的变量。

四季度本基金仍然坚持价值成长的理念，兑现了一部分涨幅较大的电动车，智能汽车的收益，努力在科技和成长领域布局了一些更具性价比的标的，以期从两到三年的维度获得满意的收益率。我们目前仍然看好几个成长行业的短期景气和长期空间，包括电动车，汽车智能化，军工，财富管理等；但鉴于这些行业 21 年的涨幅相对较大，部分个股的估值也相对高，新一年这些行业的投资可能面临更大的波动，我们会从中选择符合我们预期回报的公司进行配置。同时，22 年我们也关注一些底部或者低估值品种的拐点机会，比如消费电子，医疗健康，云计算等。战略上我们长期坚持价值成长的理念，在科技和成长领域进行深耕；战术上新的一年我们可能会做适度的分散化和市值下沉，关注更多具备长期潜力的隐形冠军和细分龙头。希望通过我们的努力，能够让持有人分享到中国经济转型及科技发展带来的长期机遇。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 9.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%。

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（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	2,735,233,872.29	80.22
	其中：股票	2,735,233,872.29	80.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,385,000.00	2.06
	其中：债券	70,385,000.00	2.06

	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	589,891,567.73	17.30
8	其他资产	14,121,755.51	0.41
9	合计	3,409,632,195.53	100.00

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	6,815.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,249,678,581.67	66.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,550,473.13	1.12
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	1,164,300.02	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.00
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	165,059,059.34	4.91
J	金融业	238,389,749.68	7.09
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	43,216,363.83	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	70,610.91	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,735,233,872.29	81.36

5.2.2 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。

5.3 报告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	002129	中环股份	3,199,943	133,597,620.25	3.97
2	300059	东方财富	3,500,000	129,885,000.00	3.86
3	300073	当升科技	1,400,000	121,618,000.00	3.62
4	300033	同花顺	750,000	108,435,000.00	3.23
5	600885	宏发股份	1,400,000	104,496,000.00	3.11
6	300316	晶盛机电	1,400,000	97,300,000.00	2.89
7	002001	新和成	2,999,840	93,355,020.80	2.78
8	600570	恒生电子	1,400,000	87,010,000.00	2.59
9	601567	三星医疗	5,000,000	81,550,000.00	2.43
10	002180	纳思达	1,700,000	81,192,000.00	2.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,385,000.00	2.09
	其中：政策性金融债	70,385,000.00	2.09
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	70,385,000.00	2.09

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150209	15 国开 09	700,000	70,385,000.00	2.09

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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将根风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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均没有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。

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	608,678.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,207,505.37
5	应收申购款	11,305,571.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,121,755.51

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

报告期期初基金份额总额	496,937,115.32
报告期期间基金总申购份额	544,070,098.84

减：报告期期间基金总赎回份额	153,320,683.06
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	887,686,531.10

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,451,130.66
报告期期间买入/申购总份额	1,310,834.91
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,761,965.57
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.31

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	基金转换 （入）	2021 年 11 月 24 日	1,310,834.91	4,999,000.00	0.00
合计			1,310,834.91	4,999,000.00	

§ 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

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、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照

- 3、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

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
2022 年 01 月 21 日