

# 信诚四季红混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 26 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2023 年 08 月 25 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
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	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49

7.12	投资组合报告附注 .....	49
§ 8	基金份额持有人信息 .....	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	51
§ 9	开放式基金份额变动 .....	51
§ 10	重大事件揭示 .....	51
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4	基金投资策略的改变 .....	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8	其他重大事件 .....	53
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
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 .....	54
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
§ 12	备查文件目录 .....	55
12.1	备查文件目录 .....	55
12.2	存放地点 .....	55
12.3	查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚四季红混合型证券投资基金
基金简称	信诚四季红混合
基金主代码	550001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 04 月 29 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	563,888,347.37 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效配置资产的基础上,精选投资标的,追求在稳定分红的基础上,实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	<p>(1) 资产配置</p> <p>本基金在充分借鉴英国保诚集团的资产配置理念和方法的基础上,建立了适合国内市场的资产配置体系。本基金的资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。</p> <p>本基金采用保诚集团在全球投资所采用的战术性资产配置体系(TAA Pack),结合国内资本市场的特点,建立了适应国内市场的战术性资产配置的TAA体系。该体系根据各大类资产相对无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产。</p> <p>(2) 股票投资策略</p> <p>本基金的股票配置采用自上而下与自下而上相结合,并落实到自下而上的个股研究为主的投资策略。一方面通过宏观经济分析和行业分析,确定股票研究的行业重点和方向;另一方面通过深入研究个股的基本面和估值水平,最终确定投资标的,决定个股仓位,控制行业权重风险,完成股票组合配置。</p> <p>(3) 债券投资策略</p> <p>本产品债券组合投资于国内依法公开发行的各类债券,包括在银行间债券市场和交易所债券市场上市交易的各种国债、金融债、企业债和可转债。</p> <p>本产品采用自上而下的投资方法,通过整体债券配置、类属配置和个券选择三个层次进行积极投资、控制风险、增加投资收益,提高整体组合的收益率水平,追求债券资产的长期稳定增值。</p> <p>(4) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,深入研究基础证券投资价值,选择投资价值较高的存托凭证进行投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*62.5%+中债综合财富(总值)指数收益率

	*37.5%
风险收益特征	作为一只混合型基金, 本基金的资产配置中线(股票 62.5%, 债券 32.5%)确立了本基金在平衡型基金中的中等风险定位, 因此本基金在证券投资基金中属于中等风险。同时, 通过严谨的研究和稳健的操作, 本基金力争在严格控制风险的前提下谋求基金资产的中长期稳定增值。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	秦一楠
	联系电话	021-68649788	010-66060069
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95599
传真		021-50120895	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69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大楼9层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		涂一锴	谷澍

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	上海证券报
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)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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（2023年01月01日至2023年06月30日）
本期已实现收益	-15,967,814.91
本期利润	-8,922,170.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0155
本期加权平均净值利润率	-1.88%
本期基金份额净值增长率	-2.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023年06月30日）
期末可供分配利润	-121,478,772.75
期末可供分配基金份额利润	-0.2154
期末基金资产净值	442,409,574.62
期末基金份额净值	0.7846
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023年06月30日）
基金份额累计净值增长率	287.13%

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

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	-0.53%	0.77%	0.90%	0.54%	-1.43%	0.23%
过去三个月	-4.76%	0.90%	-2.60%	0.52%	-2.16%	0.38%
过去六个月	-2.00%	0.90%	0.60%	0.52%	-2.60%	0.38%
过去一年	-14.52%	0.97%	-7.56%	0.61%	-6.96%	0.36%
过去三年	-8.20%	1.28%	4.00%	0.73%	-12.20%	0.55%
自基金合同生效起至今	287.13%	1.51%	197.00%	1.04%	90.13%	0.47%

### 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



## § 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、英国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 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 75 只，分别为：信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、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信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、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、信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）、信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、信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)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信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)、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信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、信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、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信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、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信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、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信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、信诚稳泰债券型证券投资基金、信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、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信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、中信保诚远见成长混合型证券投资基金。

#### 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		
吴昊	研究部总监、基金经理	2019年01月31日	-	16	吴昊先生，经济学硕士，CFA。曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司，从事研究工作。2010年11月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总监。现任研究部总监，中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金的基金经理。
夏明月	基金经理	2019年03月18日	2023年02月13日	18	夏明月女士，经济学硕士。曾任职于华富基金管理有限公司，担任研究员；于金元比联基金管理有限公司，担任研究员；2011年9月加入中信保诚基金管理有限公司，担任高级研究员。现任信诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）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《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》、《信诚四季红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 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》,以及公司拟定的《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》,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《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》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(完全复制的指数基金除外)。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 年上半年,A 股市场先涨后跌,上半年整体基本持平,沪深 300 指数下跌 0.8%、创业板指下跌 5.6%、科创 50 上涨 4.7%,成长风格略强于价值风格。分行业来看,泛 AI 类资产领涨市场,通

信、传媒、计算机、机械设备、家用电器分别上涨 51%、43%、28%、13%和 13%；业绩下修压力较大的资产领跌，商贸零售、房地产、美容护理、光伏设备、建筑材料分别下跌 23%、14%、14%、11%和 11%。

本基金在一季度，增持了电子、通信等行业，减持了电力设备、机械制造等行业，对计算机、建筑装饰等行业做了个股调整；在二季度，重点配置了银行、交通运输、石油石化、煤炭行业具备持续分红能力、市净率相对 ROE 定价偏低的行业龙头公司。

#### 4.4.2 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-2.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，我国经济运行面临新的困难挑战，主要是国内需求不足，一些企业经营困难，重点领域风险隐患较多，外部环境复杂严峻，一季度 GDP 同比增长 4.5%，二季度 GDP 同比增长 6.3%。展望下半年，预计政府相关部门将加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险，不断推动经济运行持续好转、内生动力持续增强、社会预期持续改善、风险隐患持续化解，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长，预计全年经济仍能实现 5%左右的增长。

2023 年上半年，全球流动性收紧，美联储累计加息 75bps；国内流动性合理充裕，6 月 MLF/LPR 调降 10bps，6 月末 M1、M2 增速分别为 3.1%、11.3%。展望下半年，我们预计将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，降准降息等总量政策仍有望推出，同时保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。对于国内我们将重点跟踪总量及结构性政策工具的落地及实施效果，观察 PPI 和库存周期的修复；对于海外将重点跟踪海外的通胀和就业变化。

2023 年上半年，市场现实抬升了经济复苏的预期，之后又担忧经济复苏不及预期，风险偏好先升后降。展望下半年，我们认为随着逆周期调节政策取得效果，市场对于全年实现 5%左右经济增长的预期重新确立，风险偏好有望企稳，如果在年底看到中外库存周期的向上共振，在 2024 年看到中外货币政策的宽松共振，风险偏好修复的高度或能进一步上修。

从市场整体定价水平来看，以沪深 300 指数为例，市净率分位数处于过去 5 年偏低的水平，市场系统性下行的风险或相对有限，同时结构性的机会可能会更加突出。政治局会议提出“活跃资本市场”，我们对此保持高度重视，将跟踪后续可能出台的配套政策，以及市场定价行为可能发生的变化。

展望下半年，我们将重点关注以下几个方向的机会：1) 受益国内经济复苏，风险补偿充分或具备长期成长空间的优质公司；2) 受益海外经济复苏，供需错配在较长时间难以修复的景气改善资产；

3) 受益国企改革, 经营效率持续改善并具备持续分红能力的低估值资产; 4) 数字经济带来的结构性机会。

#### 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及应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、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验。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 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

在托管本基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定, 对本基金基金管理人—中信保诚基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作, 进行了认真、独立

的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 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：信诚四季红混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	48,376,343.99	90,553,463.82
结算备付金		2,344,060.88	1,321,253.28
存出保证金		189,986.32	139,336.15
交易性金融资产	6.4.7.2	396,936,007.95	384,862,165.18
其中：股票投资		396,936,007.95	384,862,165.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		112,667.38	12,146.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		447,959,066.52	476,888,365.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,108,382.27	9,591,244.31
应付赎回款		66,648.76	9,000.63
应付管理人报酬		557,959.74	598,726.34
应付托管费		92,993.29	99,787.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		207,196.00	207,196.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,516,311.84	1,499,063.47
负债合计		5,549,491.90	12,005,018.48
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	563,888,347.37	580,702,070.77
未分配利润	6.4.7.8	-121,478,772.75	-115,818,724.02
净资产合计		442,409,574.62	464,883,346.75
负债和净资产总计		447,959,066.52	476,888,365.23

注：截止本报告期末，基金份额净值 0.7846 元，基金份额总额 563,888,347.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚四季红混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01 日至2023年06月 30日	上年度可比期间 2022年01月01日 至2022年06月30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,677,604.16	-112,541,015.03
1. 利息收入		253,847.41	378,647.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	253,847.41	378,647.79
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		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,980,186.19	-47,577,255.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-18,394,355.27	-51,106,820.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	116,370.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	6,414,169.08	3,413,195.42
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	7,045,643.92	-65,353,024.74
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	3,090.70	10,616.98
<b>减：二、营业总支出</b>		4,244,566.83	4,716,043.23
1. 管理人报酬		3,537,233.04	3,929,783.01
2. 托管费		589,538.79	654,963.85
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	117,795.00	131,296.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,922,170.99	-117,257,058.26
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,922,170.99	-117,257,058.26
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-8,922,170.99	-117,257,058.26

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信诚四季红混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	580,702,070.77	-	-115,818,724.02	464,883,346.75
二、本期期初净资产（基金净值）	580,702,070.77	-	-115,818,724.02	464,883,346.75
三、本期增减变动额（减少）	-16,813,723.40	-	-5,660,048.73	-22,473,772.13



以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-8,922,170.99	-8,922,170.99
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-16,813,723.40	-	3,262,122.26	-13,551,601.14
其中: 1. 基金申购款	9,261,836.59	-	-1,649,076.29	7,612,760.30
2. 基金赎回款	-26,075,559.99	-	4,911,198.55	-21,164,361.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	563,888,347.37	-	-121,478,772.75	442,409,574.62
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	563,571,830.94	-	91,355,415.21	654,927,246.15
二、本期期初净资产(基金净值)	563,571,830.94	-	91,355,415.21	654,927,246.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	21,506,734.59	-	-139,409,983.58	-117,903,248.99
(一)、综合收益总额	-	-	-117,257,058.26	-117,257,058.26
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	21,506,734.59	-	944,325.71	22,451,060.30
其中: 1. 基金申购款	39,797,314.55	-	-552,369.96	39,244,944.59
2. 基金赎回款	-18,290,579.96	-	1,496,695.67	-16,793,884.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-23,097,251.03	-23,097,251.03
四、本期期末净资产(基金净值)	585,078,565.53	-	-48,054,568.37	537,023,997.16

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:

董元星

陈逸辛

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信诚四季红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”)《关于同意信诚四季红混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]42 号文)和《关于信诚四季红混合型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2006]96 号文)批准,由中信保诚基金管理有限公司(原“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》及其配套规则和《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2006 年 4 月 29 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 3,006,323,520.62 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》和《信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、债券及其他中国证监会批准的投资工具。本基金投资组合的比例范围为:股票资产 30%-95%;债券资产 0%-65%(不包括到期日在一年以内的政府债券);现金或者到期日在一年内的政府债券不低于 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:62.5%×沪深 300 指数收益率+37.5%×中债综合财富(总值)指数收益率。

#### 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》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<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局

公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财税〔2014〕81 号《财政部、国家税务总局、中国证券监督管理委员会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下简称“营改增”)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人(以下简称“管理人”)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、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股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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(以下简称“挂牌公司”)取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。个人投资者在国外已缴纳的预提税，可持有效扣税凭证到中国结算的主管税务机关申请税收抵免。

对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

(e) 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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

根据香港联合交易所有限公司(以下简称联交所)上调股票交易印花税公告，自 2021 年 8 月 1 日起，香港市场的股票交易印花税由按成交金额的 0.1% 双向收取，上调为按成交金额的 0.13% 双向收取(取整到元，不足一元按一元计)。按照《上海证券交易所沪港通业务实施办法》第七十六条的有关规定，投资者进行沪港通下的港股通交易，应按照联交所市场的有关规定交纳相关费用。

(f) 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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，自 2019 年 12 月 5 日起至 2023 年 12 月 31 日止，继续暂免征收个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后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费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	48,376,343.99
等于：本金	48,367,864.38
加：应计利息	8,479.61
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	48,376,343.99

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	400,803,971.18	-	396,936,007.95	-3,867,963.23
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		400,803,971.18	-	396,936,007.95	-3,867,963.23

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16.99
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	812,769.33
其中：交易所市场	812,769.33
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	34,712.18
应付信息披露费	159,507.37
应付账户维护费	9,000.00
应付后端申购费	5.97
其他	500,300.00
合计	1,516,311.84

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	580,702,070.77	580,702,070.77
本期申购	9,261,836.59	9,261,836.59
本期赎回（以“-”号填列）	-26,075,559.99	-26,075,559.99
本期末	563,888,347.37	563,888,347.37

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

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
本期期初	54,283,657.94	-170,102,381.96	-115,818,724.02
本期利润	-15,967,814.91	7,045,643.92	-8,922,170.99
本期基金份额交易产生的变动数	-1,309,469.83	4,571,592.09	3,262,122.26
其中：基金申购款	919,635.80	-2,568,712.09	-1,649,076.29
基金赎回款	-2,229,105.63	7,140,304.18	4,911,198.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,006,373.20	-158,485,145.95	-121,478,772.75

## 6.4.7.9 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 06 月 30 日
	活期存款利息收入
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	8,832.37
其他	1,304.53
合计	253,847.41

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
	卖出股票成交总额



减：卖出股票成本总额	793,117,361.22
减：交易费用	2,352,642.92
买卖股票差价收入	-18,394,355.27

#### 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

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,414,169.08
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	6,414,169.08

#### 6.4.7.15 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06月30日

1. 交易性金融资产	7,045,643.92
—股票投资	7,045,643.92
—债券投资	—
—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	7,045,643.92

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	3,087.67
转换费收入	3.03
合计	3,090.70

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

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

#### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	4,975.45
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	117,795.00

#### 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

根据基金管理人中信保诚基金管理有限公司 2023 年 7 月 24 日《关于旗下信诚四季红混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2023 年 7 月 24 日起增加 C 类基金份额并相应修改基金合同。

自 2023 年 7 月 24 日起，本基金新增 C 类基金份额并单独设置基金代码，原有的基金份额自动转为 A 类基金份额，其收费模式不变。投资者申购时可以自主选择与 A 类基金份额或 C 类基金份额相对应的基金代码进行申购。由于基金费用收取方式的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

除以上情况外，截至本财务报告批准报出日，本基金无其他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（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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 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 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,537,233.04	3,929,783.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,246,234.92	1,355,778.16

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	589,538.79	654,963.85

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
农业银行	48,376,343.99	243,710.51	103,396,381.56	372,759.82

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业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 2023 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	证券	成功	受限	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	期	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	总额	
00128 2	三联 锻造	2023年 05月15 日	6个月	锁定期 股票	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
00128 7	中电 港	2023年 03月30 日	6个月	锁定期 股票	11.88	21.02	638	7,579.44	13,410.76	-
00136 0	南矿 集团	2023年 03月31 日	6个月	锁定期 股票	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
00136 7	海森 药业	2023年 03月30 日	6个月	锁定期 股票	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
30080 4	广康 生化	2023年 06月15 日	6个月	锁定期 股票	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
30114 1	中科 磁业	2023年 03月27 日	6个月	锁定期 股票	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
30117 0	锡南 科技	2023年 06月16 日	6个月	锁定期 股票	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
30120 2	朗威 股份	2023年 06月28 日	1个月 内 (含)	新股未 上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
30120 2	朗威 股份	2023年 06月28 日	6个月	锁定期 股票	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
30120 3	国泰 环保	2023年 03月28 日	6个月	锁定期 股票	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
30122 5	恒勃 股份	2023年 06月08 日	6个月	锁定期 股票	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
30123 2	飞沃 科技	2023年 06月08 日	6个月	锁定期 股票	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
30126 1	恒工 精密	2023年 06月29 日	1个月 内 (含)	新股未 上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
30126 1	恒工 精密	2023年 06月29 日	6个月	锁定期 股票	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-

		日								
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	锁定期股票	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023年05月26日	1-6个月(含)	锁定期股票-转增	-	25.10	97	-	2,434.70	-
301292	海科新源	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	锁定期股票	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	锁定期股票	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年06月19日	6个月	锁定期股票	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	锁定期股票	25.25	19.69	736	18,584.00	14,491.84	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	锁定期股票	32.34	31.86	605	19,565.70	19,275.30	-
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	锁定期股票	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	锁定期股票	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	锁定期股票	131.11	53.24	149	19,535.39	7,932.76	-
301322	绿通科技	2023年05月25日	1-6个月(含)	锁定期股票-转增	-	53.24	75	-	3,993.00	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	锁定期股票	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	锁定期股票	76.80	107.95	264	20,275.20	28,498.80	-

301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	锁定期股票	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	锁定期股票	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年04月11日	6个月	锁定期股票	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	锁定期股票	23.77	42.89	561	13,334.97	24,061.29	-
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	锁定期股票	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	锁定期股票	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	锁定期股票	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	锁定期股票	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	6个月	锁定期股票	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	锁定期股票	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	锁定期股票	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	锁定期股票	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年04月10日	6个月	锁定期股票	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
30148	致尚	2023年	1个月	新股未	57.66	57.66	2,839	163,696.7	163,696.7	-



6	科技	06月30日	内(含)	上市				4	4	
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	锁定期股票	57.66	57.66	316	18,220.56	18,220.56	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	锁定期股票	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	锁定期股票	10.36	11.84	524	5,428.64	6,204.16	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	锁定期股票	11.66	12.26	484	5,643.44	5,933.84	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	锁定期股票	25.98	24.53	145	3,767.10	3,556.85	-
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	锁定期股票	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	锁定期股票	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688334	西高院	2023年06月09日	6个月	锁定期股票	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	锁定期股票	23.60	64.67	485	11,446.00	31,364.95	-
688429	时创能源	2023年06月20日	6个月	锁定期股票	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	锁定期股票	245.56	122.11	87	21,363.72	10,623.57	-
688507	索辰科技	2023年06月20日	1-6个月(含)	锁定期股票-转增	-	122.11	42	-	5,128.62	-
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	锁定期股票	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

		日								
688543	国科军工	2023年06月14日	6个月	锁定期股票	43.67	53.05	338	14,760.46	17,930.90	-
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	锁定期股票	21.17	23.50	710	15,030.70	16,685.00	-
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	锁定期股票	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	锁定期股票	30.26	25.33	523	15,825.98	13,247.59	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	锁定期股票	125.80	118.03	124	15,599.20	14,635.72	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	锁定期股票	26.74	40.68	539	14,412.86	21,926.52	-
688593	新相微	2023年05月25日	6个月	锁定期股票	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	锁定期股票	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年06月15日	6个月	锁定期股票	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年05月31日	6个月	锁定期股票	125.88	86.79	131	16,490.28	11,369.49	-
688629	华丰科技	2023年06月16日	6个月	锁定期股票	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	锁定期股票	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年06月28日	筹划重大事项	6.97	2023年07月03日	7.10	1,281,700	8,890,111.36	8,933,449.00	

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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。

公司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**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期债券投资。

##### **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上市公司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 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银行存款、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 2023 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							
银行存款	48,376,343.99	-	-	-	-	-	48,376,343.99

结算备付金	2,344,060.88	-	-	-	-	-	2,344,060.88
存出保证金	189,986.32	-	-	-	-	-	189,986.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-396,936,007.95	396,936,007.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	112,667.38	112,667.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	50,910,391.19	-	-	-	-	-397,048,675.33	447,959,066.52
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	-	-	-	-	-	3,108,382.27	3,108,382.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	66,648.76	66,648.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	557,959.74	557,959.74
应付托管费	-	-	-	-	-	92,993.29	92,993.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	207,196.00	207,196.00
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,516,311.84	1,516,311.84
负债总计	-	-	-	-	-	5,549,491.90	5,549,491.90
利率敏感度缺口	50,910,391.19	-	-	-	-	-391,499,183.43	442,409,574.62
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	90,553,463.82	-	-	-	-	-	90,553,463.82
结算备付金	1,321,253.28	-	-	-	-	-	1,321,253.28
存出保证金	139,336.15	-	-	-	-	-	139,336.15
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-384,862,165.18	384,862,165.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	12,146.80	12,146.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	92,014,053.25	-	-	-	-384,874,311.98	476,888,365.23
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	-	-	-	-	9,591,244.31	9,591,244.31
应付赎回款	-	-	-	-	9,000.63	9,000.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	598,726.34	598,726.34
应付托管费	-	-	-	-	99,787.73	99,787.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	207,196.00	207,196.00
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	1,499,063.47	1,499,063.47
负债总计	-	-	-	-	12,005,018.48	12,005,018.48
利率敏感度缺口	92,014,053.25	-	-	-	-372,869,293.50	464,883,346.75

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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 2023 年 06 月 30 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	396,936,007.95	89.72	384,862,165.18	82.79
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	396,936,007.95	89.72	384,862,165.18	82.79

#### 6.4.13.4.3.2 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 06 月 30 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%	17,626,570.32	17,852,480.99
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-17,626,570.32	-17,852,480.99

### 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 2023 年 06 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	386,601,395.54	384,331,043.40
第二层次	9,702,879.28	-
第三层次	631,733.13	531,121.78
合计	396,936,007.95	384,862,165.18

#### 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券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	396,936,007.95	88.61
	其中：股票	396,936,007.95	88.61
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	50,720,404.87	11.32
8	其他各项资产	302,653.70	0.07
9	合计	447,959,066.52	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	-	-
B	采矿业	74,918,899.00	16.93
C	制造业	82,959,397.31	18.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,363,461.00	3.25
E	建筑业	19,642,297.35	4.44
F	批发和零售业	16,437,815.96	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	66,330,995.00	14.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,594,116.65	3.07
J	金融业	88,189,914.50	19.93
K	房地产业	11,178,437.00	2.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,231.84	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	9,260,265.00	2.09
S	综合	-	-
	合计	396,936,007.95	89.72

### 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	600028	中国石化	5,605,100	35,648,436.00	8.06
2	601398	工商银行	4,171,200	20,105,184.00	4.54
3	601939	建设银行	3,166,300	19,821,038.00	4.48
4	600012	皖通高速	1,793,600	18,796,928.00	4.25
5	601818	光大银行	4,875,400	14,967,478.00	3.38
6	600377	宁沪高速	1,432,300	14,079,509.00	3.18
7	601728	中国电信	2,400,200	13,513,126.00	3.05
8	601328	交通银行	2,254,100	13,073,780.00	2.96
9	601898	中煤能源	1,521,200	12,838,928.00	2.90
10	000568	泸州老窖	60,800	12,741,856.00	2.88
11	002128	电投能源	949,900	12,557,678.00	2.84
12	601988	中国银行	3,103,200	12,133,512.00	2.74
13	600048	保利发展	857,900	11,178,437.00	2.53
14	000932	华菱钢铁	2,322,400	11,077,848.00	2.50
15	601668	中国建筑	1,896,500	10,885,910.00	2.46
16	600019	宝钢股份	1,888,400	10,612,808.00	2.40
17	000938	紫光股份	331,900	10,571,015.00	2.39
18	600023	浙能电力	1,949,900	9,885,993.00	2.23
19	002402	和而泰	564,100	9,578,418.00	2.17
20	601900	南方传媒	451,500	9,260,265.00	2.09
21	601088	中国神华	298,600	9,181,950.00	2.08
22	600004	白云机场	639,800	9,174,732.00	2.07
23	601298	青岛港	1,281,700	8,933,449.00	2.02
24	000761	本钢板材	2,226,300	8,905,200.00	2.01
25	601390	中国中铁	1,154,100	8,748,078.00	1.98
26	000596	古井贡酒	34,600	8,559,348.00	1.93
27	002966	苏州银行	1,234,950	8,088,922.50	1.83
28	600755	厦门国贸	965,300	7,471,422.00	1.69
29	600026	中远海能	516,000	6,522,240.00	1.47
30	600482	中国动力	209,300	4,905,992.00	1.11
31	000651	格力电器	130,000	4,746,300.00	1.07
32	601857	中国石油	628,100	4,691,907.00	1.06
33	601000	唐山港	1,287,300	4,544,169.00	1.03
34	603368	柳药集团	183,300	4,529,343.00	1.02
35	601158	重庆水务	805,300	4,477,468.00	1.01
36	600153	建发股份	404,600	4,414,186.00	1.00
37	601872	招商轮船	739,200	4,279,968.00	0.97

38	301486	致尚科技	3,155	181,917.30	0.04
39	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
40	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
41	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
42	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
43	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
44	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
45	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
46	688361	中科飞测	485	31,364.95	0.01
47	301325	曼恩斯特	264	28,498.80	0.01
48	301358	湖南裕能	561	24,061.29	0.01
49	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
50	688582	芯动联科	539	21,926.52	0.00
51	301307	美利信	605	19,275.30	0.00
52	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
53	688543	国科军工	338	17,930.90	0.00
54	688552	航天南湖	710	16,685.00	0.00
55	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
56	688507	索辰科技	129	15,752.19	0.00
57	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
58	688581	安杰思	124	14,635.72	0.00
59	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
60	301305	朗坤环境	736	14,491.84	0.00
61	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
62	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
63	001287	中电港	638	13,410.76	0.00
64	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
65	688570	天玛智控	523	13,247.59	0.00
66	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
67	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
68	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
69	301322	绿通科技	224	11,925.76	0.00
70	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
71	688623	双元科技	131	11,369.49	0.00
72	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
73	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
74	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
75	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
76	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
77	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
78	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00

79	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
80	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
81	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
82	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
83	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
84	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
85	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
86	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
87	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
88	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
89	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
90	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
91	601065	江盐集团	524	6,204.16	0.00
92	601133	柏诚股份	484	5,933.84	0.00
93	603125	常青科技	145	3,556.85	0.00
94	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
95	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
96	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
97	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
98	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 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	600028	中国石化	33,125,017.00	7.13
2	000938	紫光股份	26,855,796.00	5.78
3	601728	中国电信	24,508,258.00	5.27
4	601398	工商银行	20,652,645.00	4.44
5	601939	建设银行	20,618,051.00	4.44
6	002180	纳思达	19,726,440.95	4.24
7	300687	赛意信息	19,227,613.44	4.14
8	002120	韵达股份	18,876,427.00	4.06
9	002402	和而泰	18,091,646.00	3.89
10	600012	皖通高速	18,015,864.19	3.88
11	601818	光大银行	15,770,088.00	3.39
12	000425	徐工机械	15,149,009.00	3.26
13	601138	工业富联	14,911,433.12	3.21
14	600004	白云机场	13,932,734.00	3.00
15	601898	中煤能源	13,749,274.00	2.96

16	600048	保利发展	13,684,229.00	2.94
17	000568	泸州老窖	13,618,040.00	2.93
18	600377	宁沪高速	13,616,572.00	2.93
19	002128	电投能源	13,329,936.00	2.87
20	601328	交通银行	12,764,472.00	2.75
21	002049	紫光国微	12,746,757.00	2.74
22	601988	中国银行	12,620,877.00	2.71
23	601919	中远海控	11,911,502.27	2.56
24	601900	南方传媒	11,598,795.00	2.49
25	000661	长春高新	11,482,232.00	2.47
26	000932	华菱钢铁	11,406,782.00	2.45
27	600019	宝钢股份	11,339,249.00	2.44
28	002727	一心堂	10,776,974.21	2.32
29	002555	三七互娱	10,268,097.00	2.21
30	002430	杭氧股份	10,227,198.00	2.20
31	002603	以岭药业	10,215,437.21	2.20
32	603027	千禾味业	10,095,391.76	2.17
33	000338	潍柴动力	10,095,251.00	2.17
34	300613	富瀚微	9,970,411.85	2.14
35	002929	润建股份	9,906,176.60	2.13
36	688561	奇安信	9,874,224.31	2.12
37	601857	中国石油	9,822,648.00	2.11
38	603636	南威软件	9,757,059.00	2.10
39	605123	派克新材	9,738,365.00	2.09
40	300316	晶盛机电	9,722,359.93	2.09
41	001979	招商蛇口	9,701,154.59	2.09
42	000596	古井贡酒	9,695,439.00	2.09
43	300118	东方日升	9,668,195.00	2.08
44	603138	海量数据	9,612,315.00	2.07
45	601800	中国交建	9,503,831.00	2.04
46	600023	浙能电力	9,496,593.00	2.04
47	601390	中国中铁	9,300,880.00	2.00

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。

#### 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	300638	广和通	25,460,647.00	5.48
2	000938	紫光股份	20,980,149.86	4.51
3	002430	杭氧股份	20,757,036.50	4.46
4	600875	东方电气	19,896,980.52	4.28

5	300750	宁德时代	19,310,899.20	4.15
6	600845	宝信软件	18,453,170.22	3.97
7	601567	三星医疗	18,419,463.72	3.96
8	002555	三七互娱	17,961,469.97	3.86
9	002180	纳思达	15,988,236.00	3.44
10	002120	韵达股份	15,835,906.00	3.41
11	600050	中国联通	15,697,403.92	3.38
12	002484	江海股份	15,503,403.94	3.33
13	002049	紫光国微	15,353,522.00	3.30
14	301191	菲菱科思	15,170,843.00	3.26
15	002254	泰和新材	14,830,322.14	3.19
16	603236	移远通信	14,795,576.54	3.18
17	601728	中国电信	13,300,072.00	2.86
18	300986	志特新材	13,250,699.60	2.85
19	000425	徐工机械	13,111,893.00	2.82
20	601138	工业富联	12,878,707.00	2.77
21	300661	圣邦股份	12,828,245.00	2.76
22	300687	赛意信息	12,686,745.00	2.73
23	600732	爱旭股份	12,645,428.08	2.72
24	300408	三环集团	12,219,192.00	2.63
25	603915	国茂股份	12,106,183.64	2.60
26	300613	富瀚微	12,038,877.10	2.59
27	603416	信捷电气	12,024,947.79	2.59
28	002960	青鸟消防	11,910,342.00	2.56
29	002271	东方雨虹	11,498,386.00	2.47
30	601919	中远海控	11,258,241.00	2.42
31	002727	一心堂	10,709,727.00	2.30
32	600027	华电国际	10,587,429.89	2.28
33	300294	博雅生物	10,261,139.40	2.21
34	002415	海康威视	9,988,245.00	2.15
35	002791	坚朗五金	9,982,240.55	2.15
36	002929	润建股份	9,952,786.00	2.14
37	002064	华峰化学	9,937,560.00	2.14
38	300316	晶盛机电	9,909,435.23	2.13
39	000338	潍柴动力	9,883,518.00	2.13
40	603027	千禾味业	9,754,877.13	2.10
41	000661	长春高新	9,630,172.00	2.07
42	002603	以岭药业	9,628,570.00	2.07
43	603138	海量数据	9,594,290.00	2.06
44	600153	建发股份	9,428,438.00	2.03
45	002965	祥鑫科技	9,423,014.00	2.03



46	301302	华如科技	9,319,534.78	2.00
----	--------	------	--------------	------

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。

#### 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	798,145,560.07
卖出股票收入（成交）总额	777,075,648.87

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金投资范围不包括股指期货投资。

#### 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，交通银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2022]46号）；中国建设银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字[2023]10号、银保监罚决字[2022]44号、银保监罚决字[2022]51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	189,986.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	112,667.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	302,653.70

### 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

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
23,434	24,062.83	5,416,885.17	0.96%	558,471,462.20	99.04%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	202,456.87	0.04%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、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

基金合同生效日（2006年04月29日）基金份额总额	3,006,323,520.62
本报告期期初基金份额总额	580,702,070.77
本报告期基金总申购份额	9,261,836.59
减：本报告期基金总赎回份额	26,075,559.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	563,888,347.37

## § 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 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。上述变更事项已按监管要求公告并备案。

本报告期内，基金托管人未发生重大人事变动。

### 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

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。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。

### 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，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	305,626,991.51	19.49%	284,622.64	19.60%	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	42,386,784.41	2.70%	39,052.19	2.69%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	404,592,774.04	25.80%	376,795.21	25.95%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	707,347,177.18	45.10%	651,681.89	44.88%	-
中国银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	13,252,281.98	0.84%	12,343.52	0.85%	-
中信证券	3	95,119,241.45	6.07%	87,634.41	6.03%	-

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。

### 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

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。

### 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	信诚四季红混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《上海证券报》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	信诚四季红混合型证券投资基金基金经	同上	2023年02月15日

	理变更公告		
4	信诚四季红混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2023年02月16日
5	信诚四季红混合型证券投资基金更新招募说明书	同上	2023年02月16日
6	中信保诚基金管理有限公司关于信诚四季红混合型证券投资基金分红结算的提示性公告	同上	2023年03月28日
7	信诚四季红混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资的公告	同上	2023年03月28日
8	信诚四季红混合型证券投资基金 2022 年年度报告	同上	2023年03月31日
9	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
10	信诚四季红混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	同上	2023年04月20日
11	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
12	信诚四季红混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2023年05月31日
13	信诚四季红混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 5 月）	同上	2023年05月31日
14	中信保诚基金管理有限公司关于信诚四季红混合型证券投资基金分红结算的提示性公告	同上	2023年06月27日
15	信诚四季红混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	同上	2023年06月27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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
无

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、信诚四季红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、信诚四季红混合型证券投资基金基金合同
- 4、信诚四季红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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2023 年 08 月 26 日