

信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

2021年第3季度报告

2021年09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

报告送出日期：2021年10月27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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月26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07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 信诚新旺混合（LOF） |
| 场内简称 | 信诚新旺 |
| 基金主代码 | 165526 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年06月19日 |
| 报告期末基金份额总额 | 669,958,070.08份 |
| 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。 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 |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | <p>投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。</p> <p>3、固定收益投资策略：本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。</p> <p>4、股指期货、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。本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。</p> <p>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。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> | |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款利率(税后)+3% | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信诚新旺混合（LOF）A | 信诚新旺混合（LOF）C |
| 下属分级基金场内简称 | 信诚新旺 | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 165526 | 165527 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 305,142,230.90 份 | 364,815,839.18 份 |

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。

§ 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07月01日-2021年09月30日） | |
|-----------------|------------------------------|----------------|
| | 信诚新旺混合（LOF）A | 信诚新旺混合（LOF）C |
| 1. 本期已实现收益 | 8,815,001.72 | 11,449,832.40 |
| 2. 本期利润 | 2,123,789.64 | 2,770,052.41 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0077 | 0.0073 |
| 4. 期末基金资产净值 | 465,651,093.49 | 531,605,921.90 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.526 | 1.457 |

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

信诚新旺混合（LOF）A

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.53% | 0.21% | 1.13% | 0.01% | -0.60% | 0.20% |
| 过去六个月 | 2.72% | 0.19% | 2.26% | 0.01% | 0.46% | 0.18% |
| 过去一年 | 7.82% | 0.22% | 4.50% | 0.01% | 3.32% | 0.21% |
| 过去三年 | 36.36% | 0.36% | 13.51% | 0.01% | 22.85% | 0.35% |
| 过去五年 | 49.98% | 0.37% | 22.51% | 0.01% | 27.47% | 0.36% |
| 自基金合同生效起 至今 | 56.13% | 0.34% | 28.45% | 0.01% | 27.68% | 0.33% |

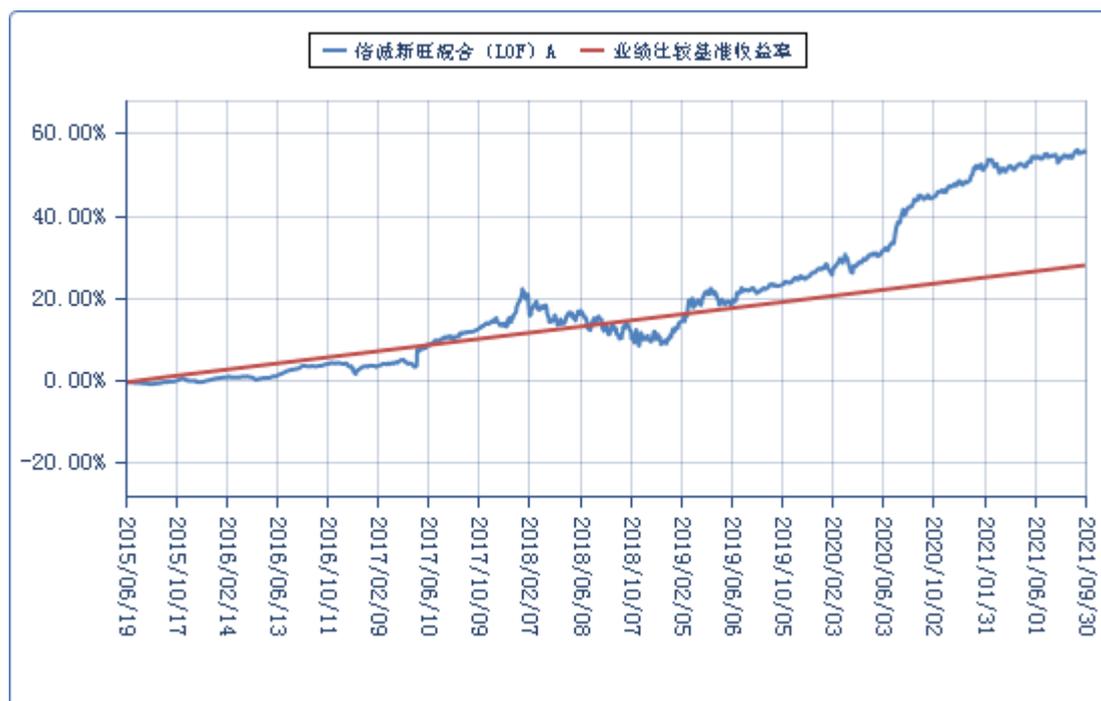
信诚新旺混合（LOF）C

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.48% | 0.21% | 1.13% | 0.01% | -0.65% | 0.20% |
| 过去六个月 | 2.64% | 0.19% | 2.26% | 0.01% | 0.38% | 0.18% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 7.76% | 0.22% | 4.50% | 0.01% | 3.26% | 0.21% |
| 过去三年 | 35.85% | 0.36% | 13.51% | 0.01% | 22.34% | 0.35% |
| 过去五年 | 43.71% | 0.36% | 22.51% | 0.01% | 21.20% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.03% | 0.34% | 26.20% | 0.01% | 22.83% | 0.33% |

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

信诚新旺混合（LOF）A



信诚新旺混合（LOF）C



§ 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（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 提云涛 | 本基金基金经理、量化投资总监 | 2016年11月23日 | - | 21 | 提云涛先生，经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于东方证券有限责任公司，担任研究所所长助理；于上海申银万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015年6月加入中信保诚基金管理有 |

| | | | | | |
|-----|---------|-------------|---|----|--|
| | | | | | 限公司，担任量化投资总监。现兼任信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 杨立春 | 本基金基金经理 | 2020年01月14日 | - | 10 | 杨立春先生，经济学博士。曾任职于江苏省社会科学院，担任助理研究员。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。现任信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置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《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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

三季度,国内经济虽然整体仍保持向好趋势,但是因为局部发生的疫情、汛情以及上年基数等原因,经济增速有所放缓。虽然制造业PMI 7、8月还呈扩展状态,但较之前逐月下降,9月份跌到50荣枯线以下。三季度,上游商品价格处于高位徘徊或上涨,特别是9月中下旬部分地区的限电对经济和预期产生了扰动。另外,局部发生的疫情干扰了当地的生活和生产活动,部分消费也受到影响。在坚持“房住不炒”的政策基调下,商品房销售价格涨幅继续回落,部分过热地区房价有所回落。虽然市场开始有各种担忧,但社会总体运行良好,经济仍处于稳定区间。海外,虽然疫情反复一定程度干扰了社会经济生活,但总体

呈社会生活进一步恢复正常，随着美国经济的恢复和通胀上升，市场开始预期美联储将推出量化宽松政策。

股票市场，三季度继续分化明显，钢铁、有色、煤炭等周期性行业先涨后跌，食品饮料、电力、房地产先跌后涨。整个三季度，采掘、公用事业、有色、钢铁涨幅居前，家电、传媒、银行跌幅较大。从规模看，三季度沪深300指数下跌6.85%，中证500和中证1000分别上涨4.35%和4.54%。货币政策方面，央行强调以稳为主，同时，政策重心转向跨周期调节，7月9日央行超预期全面降准，加强对经济的结构性支持。债券市场，在“保持流动性合理充裕，增强信贷总量增长的稳定性”政策导向下，市场流动性相对充裕，利率水平在7月份上升后维持在合理水平。10年国债收益率从3.08%下行到2.88%；信用债方面，信用利差低位震荡，市场情绪有所修复但尾部风险仍存。

三季度，本基金仍然以传统蓝筹为主，从长期盈利能力、盈利稳定性、资产质量以及市场估值等因素多角度选择标的，并保持适度分散和行业均衡。债券投资，报告期内组合资产规模基本稳定，组合利率仓位主要投资于短端品种，满足现金配置的基本要求，组合基本无杠杆。组合的固定收益资产仓位以风险可控、性价比合适的中短久期优质国企信用债、国有股份行大额存单为主，以及部分风险可控的产业债龙头。同时在可能的情况下积极参与网下新股申购、可转债申购以获取收益。

展望四季度，海外，随着新冠疫苗接种推广和治疗药物研发的推进，预计生活和经济将进一步恢复正常，但随着基数的提高，环比恢复速度可能放缓。国内，政府将进一步重视前期扰动事件的影响，进一步综合考虑采取相应措施，兼顾长期目标和短期预期，预计经济将更加平稳。从市场看，经过之前预期的交易，后续可能更偏向确定性。后续周期性行业、成长性行业的波动可能会加大，业绩稳定增长的标的在估值合理的情况下可能更受市场关注。债券市场，在稳定的预期背景下，预计短期内资金面稳定性将进一步加强，可能继续保持平稳。

从投资看，股票投资，继续采用“主动+量化”的方式，综合考虑盈利与增长、业绩稳定性、估值、公司前景、公司治理等选择个股，同时保持适度分散；在保持基本组合的同时，也根据公司的盈利增长和相对估值匹配适当调整组合。债券投资，经济下行压力大，货币政策中性但财政政策边际有所放松，预计短期利率债仍然偏震荡；信用策略上，在信用分化环境中，仍然将注重选择中高等级信用债进行投资。久期方面，4季度流动性将受到地方债供给提速、MLF到期量加大等多重因素的考验，叠加摊余成本法理财整改截止日期临近，信用债的调整或将延续，短期将控制久期，中长期将静待流动性预期稳定以及理财整改截止后高等级信用债的配置机会；同时，在可能的情况下参与网下新股申购等投资以增强收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚新旺混合（LOF）A 份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 1.13%；信诚新旺混合（LOF）C 份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.13%。

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 | 170,071,035.10 | 17.04 |
| | 其中：股票 | 170,071,035.10 | 17.04 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 784,449,933.00 | 78.58 |
| | 其中：债券 | 784,449,933.00 | 78.58 |
| | 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 | 17,800,000.00 | 1.78 |
| | 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 | 10,412,946.26 | 1.04 |
| 8 | 其他资产 | 15,573,370.95 | 1.56 |
| 9 | 合计 | 998,307,285.31 | 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 | 2,816,614.82 | 0.28 |
| B | 采矿业 | 2,346,102.38 | 0.24 |
| C | 制造业 | 88,314,457.14 | 8.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,356,675.22 | 1.24 |
| E | 建筑业 | 20,183.39 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 2,128,772.52 | 0.21 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,302,650.00 | 0.63 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,917,667.68 | 0.39 |
| J | 金融业 | 44,269,985.00 | 4.44 |
| K | 房地产业 | 4,822,300.00 | 0.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 930,216.00 | 0.09 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 914,938.12 | 0.09 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 303,613.78 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 169,028.71 | 0.02 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 454,485.22 | 0.05 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 170,071,035.10 | 17.05 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 5,200 | 9,516,000.00 | 0.95 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 125,000 | 6,306,250.00 | 0.63 |
| 3 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 6,299,875.22 | 0.63 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 265,000 | 5,830,000.00 | 0.58 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 266,800 | 4,882,440.00 | 0.49 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 128,000 | 4,825,600.00 | 0.48 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 889,300 | 4,144,138.00 | 0.42 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 16,800 | 3,722,544.00 | 0.37 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 70,000 | 3,385,200.00 | 0.34 |
| 10 | 000776 | 广发证券 | 160,000 | 3,353,600.00 | 0.34 |

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 | 31,694,309.40 | 3.18 |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 3 | 金融债券 | 25,173,000.00 | 2.52 |
| | 其中：政策性金融债 | 25,173,000.00 | 2.52 |
| 4 | 企业债券 | 70,248,000.00 | 7.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | 451,026,000.00 | 45.23 |
| 6 | 中期票据 | 30,445,000.00 | 3.05 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 717,623.60 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | 175,146,000.00 | 17.56 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 784,449,933.00 | 78.66 |

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 | 112109220 | 21 浦发银行 CD220 | 1,200,000 | 116,772,000.00 | 11.71 |
| 2 | 012100141 | 21 宁波港 SCP001 | 600,000 | 60,246,000.00 | 6.04 |
| 3 | 112117019 | 21 光大银行 CD019 | 600,000 | 58,374,000.00 | 5.85 |
| 4 | 143098 | 18 川投 01 | 500,000 | 50,210,000.00 | 5.03 |
| 5 | 012102902 | 21 拉萨城投 SCP001 | 500,000 | 49,975,000.00 | 5.01 |

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据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

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

上海浦东发展银行股份有限公司于2020年11月26日、2021年4月23日、2021年7月13日分别受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国银行保险监督管理委员会处罚（上海汇管罚字[2020]20200007号、沪银保监罚决字（2021）29号、银保监罚决字（2021）27号）。

中国光大银行股份有限公司于2020年10月20日受到国家外汇管理局北京外汇管理部处罚（京汇罚（2020）29号、京汇罚（2020）30号）。

对“21光大银行CD019”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质,我们认为,该处罚事项未对光大银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该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。

对“21浦发银行CD220”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质,我们认为,该处罚事项未对浦发银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该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 | 20,228.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,084,518.97 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,408,056.95 |
| 5 | 应收申购款 | 60,566.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 15,573,370.95 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600905 | 三峡能源 | 6,299,875.22 | 0.63 | 锁定期股票 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 信诚新旺混合（LOF）A | 信诚新旺混合（LOF）C |
|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 265,979,048.10 | 368,408,050.66 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 44,026,259.86 | 49,055,805.56 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,863,077.06 | 52,648,017.04 |

| | | |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 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 | 305,142,230.90 | 364,815,839.18 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 7 月 22 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2021 年 7 月 22 日起增加侧袋机制，并对基金合同、托管协议和招募说明书(更新)等法律文件进行修订。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同
- 4、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

2021年10月27日