

# 中信保诚丰裕一年持有期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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	中信保诚丰裕一年持有期
基金主代码	011525
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 03 月 04 日
报告期末基金份额总额	10,035,724,071.65 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投资收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成，主要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，预测宏观经济的发展趋势等，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类资产等工具的配置比例，动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）类属资产配置策略</p> <p>在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配</p>

置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

(2) 普通债券投资策略

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。

(3) 信用债投资策略

本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势。本基金根据债券发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、债券收益率、流动性等因素，评估其投资价值，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

本基金投资于主体评级 AA 级（含 AA 级）以上的信用债。其中，本基金投资于信用评级 AA 的信用债占基金总资产的比例不超过 20%；投资于信用评级 AA+ 的信用债占基金总资产的比例不超过 70%；投资于信用评级 AAA 的信用债占基金总资产的比例不低于 30%。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级（具体评级机构名单以基金管理人确认为准）。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券，基金管理人需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定，以基金管理人的判断结果为准。受此评级和投资比例安排限制的信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分等非国家信用的债券。

因资信评级机构调整评级等基金管理人之外的因素致使本基金投资信用债比例不符合上述约定投资比例的，基金管理人应当在该信用债可交易之日起 3 个月内进行调整，中国证监会规定的特殊情形除外。如果由于市场流动性等原因导致难以调整的，管理人应在维护持有人利益的基础上对相关债券进行处置安排。

(4) 可转换债券及可交换债券的投资策略

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

可以转换、交换为股票。

### 3、资产支持证券投资策略

本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

### 4、股票投资策略

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；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。

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：1) 定性分析：根据对行业的发展情况和盈利状况的判断，从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2) 定量分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等；ROE、ROIC、毛利率、净利率等；PE、PEG、PB、PS 等。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

### 5、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。

### 6、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。

	<p><b>7、股指期货投资策略</b> 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在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p><b>8、股票期权投资策略</b> 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><b>9、融资投资策略</b> 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><b>10、存托凭证投资策略</b> 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%	
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	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中信保诚丰裕一年持有期 A	中信保诚丰裕一年持有期 C
下属分级基金的交易代码	011525	011526
报告期末下属分级基金的份额总额	7, 879, 337, 898. 73 份	2, 156, 386, 172. 92 份

### § 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）	
	中信保诚丰裕一年持有期 A	中信保诚丰裕一年持有期 C
1. 本期已实现收益	11,489,713.82	963,828.77
2. 本期利润	28,174,712.61	5,517,035.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0036	0.0026
4. 期末基金资产净值	7,908,553,381.76	2,157,230,421.95
5. 期末基金份额净值	1.0037	1.0004

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

中信保诚丰裕一年持有期 A

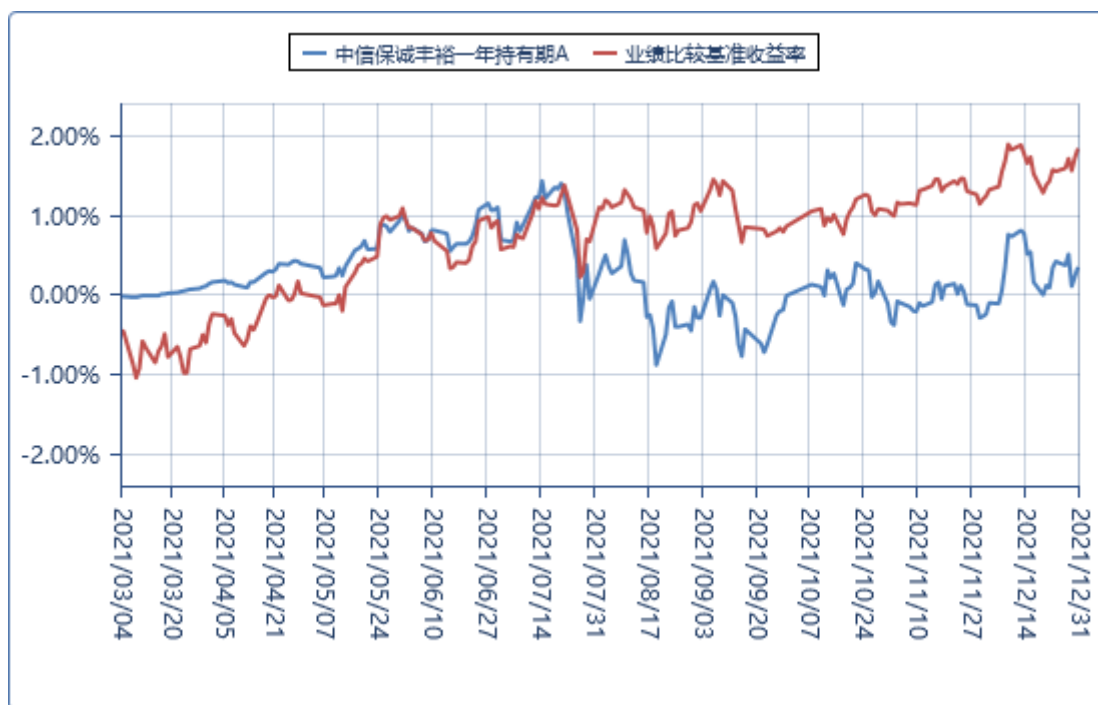
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.36%	0.18%	0.97%	0.11%	-0.61%	0.07%
过去六个月	-0.71%	0.22%	0.93%	0.15%	-1.64%	0.07%
自基金合同生效起 至今	0.37%	0.18%	1.86%	0.15%	-1.49%	0.03%

中信保诚丰裕一年持有期 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	0.26%	0.18%	0.97%	0.11%	-0.71%	0.07%
过去六个月	-0.91%	0.22%	0.93%	0.15%	-1.84%	0.07%
自基金合同生效起 至今	0.04%	0.18%	1.86%	0.15%	-1.82%	0.03%

### 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

中信保诚丰裕一年持有期 A



中信保诚丰裕一年持有期 C



注：1、本基金建仓期自 2021 年 03 月 04 日至 2021 年 09 月 04 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、本基金合同生效日为 2021 年 03 月 04 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

## § 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		
韩海平	基金经理，副总经理，固定收益负责人，混合资产投资部总监	2021 年 03 月 04 日	-	17	韩海平先生，经济学硕士，CFA，FRM。历任招商基金数量分析师，国投瑞银基金固定收益组副总监、基金经理，融通基金固定收益部总监、基金经理，国投瑞银基金总经理助理、固定收益部总经理。2019 年 3 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任总经理助理、固定收益负责人。现任副总经理，固定收益负责人，混合资产投资部总监，信诚三得益债券型证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、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本基金基金合同的约定,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

2021 年 4 季度,欧美步入新一轮疫情爆发期,南非变异毒株加剧全球疫情反弹和全球经济复苏前景担忧。通胀高企背景下,美联储加快缩减购债步伐,加息风险上升。国内方面,出口韧性较强对生产、制造业投资有较强支撑,随着政策转向保障煤炭和电力供应,限电对生产的扰动也逐步缓解。房地产投资继续回落,基建仍在低位徘徊,疫情扰动下消费表现仍然较差,制造业投资持续高增,上下游利润分化边际缓和。通胀方面,PPI 见顶回落,环比动能明显减弱,CPI 在食品项拉动下有所上行。

货币政策方面,在基本面下行背景下,政策稳增长诉求较强,央行强调以我为主、稳字当头,将跨

周期与逆周期调控政策相结合，并将在总量和结构上都趋于宽松。12 月央行二次降准释放长期流动性，并下调 1 年期 LPR 报价，引导实体经济融资成本下行，同时 5 年期 LPR 未调整，地产政策仍保持定力。

从债券市场来看，4 季度国内疫情反复，基本面下行压力较大，实体融资意愿较弱使得社融整体处于低位，同时宽货币预期较强，央行呵护下流动性充裕，长端利率债收益率小幅下行，10 年国债收益率从 2.88% 下行到 2.78%；信用债方面，地产行业波动加剧，民企地产债风险事件频发，同时弱区域城投债压力也逐步显现；权益市场整体上涨，转债表现好于股票，4 季度沪深 300 上涨 1.52%，中证转债指数上涨 7.04%。

本基金的债券部分持仓主要以中高等级信用债为主，适度杠杆，4 季度债券市场收益率整体以下行为主，组合持有的高等级信用债取得了较好的票息和杠杆收益，长端利率债也取得了较好的资本利得收益；权益市场今年波动较大，且结构分化显著，组合坚持精选个券，4 季度持仓行业进一步分散，主要以食品饮料、互联网、电力设备、医药生物、银行、商贸零售、计算机、化工、机械设备、纺服、建材和公用事业等行业为主。

展望 2022 年 1 季度，海外疫情仍有不确定性，但通胀高企下美元流动性收紧预期仍然较强。国内方面，短期外需对国内出口仍有支撑，但随着后续海外疫情逐渐稳定，预计出口增速有所回落但韧性仍存；“房住不炒”的整体基调确定，地产对经济的冲击仍未结束，但随着财政提前发力，基建增速将有所上行，对经济有正向拉动；消费受疫情扰动较大，难以回到疫情前水平；经济逐步运行至主动去库存阶段，企业盈利整体承压，但价格因素影响消退，上下游企业利润分化有望继续缓和；前期供给约束有所放松，但冬奥会对北方地区工业生产或将带来一定扰动。整体来看，经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，短期政策稳增长诉求提升，货币政策以我为主，流动性保持稳中偏宽的状态，财政政策节奏前置，托底经济作用有望显现，一季度政策整体是宽货币和宽信用的组合。

债券市场投资方面，短期国内疫情有所抬头、经济基本面下行压力较大，工业品价格明显降温，叠加货币政策将整体保持宽松，均有利于债市，但货币财政政策共同发力，且时间点前置，将显著降低经济失速风险，也制约了利率进一步下行的空间，预计短期利率债收益率仍将以低位窄幅震荡为主；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，当前信用利差仍处于低位，但宽货币持续发力，未来流动性预期稳定下，中短端的信用债仍具备一定的票息价值；权益方面，将关注内需消费、金融和稳增长相关投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚丰裕一年持有期 A 份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.97%；中信保诚丰裕一年持有期 C 份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数量不满二百人的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,679,373,660.57	16.66
	其中：股票	1,679,373,660.57	16.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,756,139,000.00	76.95
	其中：债券	7,756,139,000.00	76.95
	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	472,000,000.00	4.68
	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	5,509,279.20	0.05
8	其他资产	166,238,494.59	1.65
9	合计	10,079,260,434.36	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 274,743,851.20 元，占资产净值比例为 2.73%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	19,460,000.00	0.19
C	制造业	1,065,385,062.17	10.58

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,078,300.13	0.15
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	207,374.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	14,644,546.99	0.15
J	金融业	146,235,521.99	1.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	142,628,128.73	1.42
M	科学研究和技术服务业	868,479.64	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	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	1,404,629,809.37	13.95

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	50,656,043.20	0.50
信息科技	224,087,808.00	2.23
合计	274,743,851.20	2.73

注：以上分类采用全球行业分类系统(GICS)提供的国际通用分类标准。

### 5.3 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	00700	腾讯控股	600,000	224,087,808.00	2.23
2	600519	贵州茅台	82,000	168,100,000.00	1.67
3	000858	五粮液	700,023	155,867,121.18	1.55
4	300760	迈瑞医疗	380,000	144,704,000.00	1.44
5	601888	中国中免	650,053	142,628,128.73	1.42
6	600036	招商银行	2,799,169	136,347,521.99	1.35
7	601012	隆基股份	1,300,000	112,060,000.00	1.11

8	000568	泸州老窖	360,000	91,393,200.00	0.91
9	002415	海康威视	1,600,000	83,712,000.00	0.83
10	600309	万华化学	820,000	82,820,000.00	0.82

#### 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	1,826,240,000.00	18.14
	其中：政策性金融债	1,117,780,000.00	11.10
4	企业债券	1,942,482,000.00	19.30
5	企业短期融资券	804,200,000.00	7.99
6	中期票据	1,187,838,000.00	11.80
7	可转债（可交换债）	4,929,000.00	0.05
8	同业存单	1,990,450,000.00	19.77
9	其他	-	-
10	合计	7,756,139,000.00	77.05

#### 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	210206	21 国开 06	5,500,000	550,385,000.00	5.47
2	042100183	21 电网 CP001	5,000,000	502,550,000.00	4.99
3	112106078	21 交通银行 CD078	5,000,000	485,500,000.00	4.82
4	112109111	21 浦发银行 CD111	5,000,000	485,450,000.00	4.82
4	112117059	21 光大银行 CD059	5,000,000	485,450,000.00	4.82

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，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。

### 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

交通银行股份有限公司于 2021 年 7 月 13 日、2021 年 8 月 13 日、2021 年 10 月 20 日分别受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行处罚、国家外汇管理局上海市分局（银保监罚决字[2021]28 号、银罚字[2021]23 号、上海汇管罚字[2021]3111210701 号）。

上海浦东发展银行股份有限公司于 2021 年 4 月 23 日、2021 年 7 月 13 日、2021 年 11 月 15 日分别

受到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、国家外汇管理局上海市分局的处罚（沪银保监罚决字[2021]29号、银保监罚决字[2021]27号、上海汇管罚字[2021]3121210802号）。

平安银行股份有限公司于 2021 年 5 月 28 日、2021 年 9 月 29 日分别受到中国银保监会云南监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚（云银保监罚决字[2021]34号、深外管检[2021]40号）。

对“21 交通银行 CD078、21 浦发银行 CD111、19 浦发银行小微债 01、21 平安银行 CD089”投资决策程序的说明：基金管理人定期回顾、长期跟踪研究上述投资标的的信用资质，我们认为，上述处罚事项未对上述证券的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	339,796.95
2	应收证券清算款	5,764,507.35
3	应收股利	-
4	应收利息	160,130,536.13
5	应收申购款	3,654.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	166,238,494.59

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚丰裕一年持有期 A	中信保诚丰裕一年持有期 C
报告期期初基金份额总额	7,878,875,491.12	2,156,342,178.03
报告期期间基金总申购份额	462,407.61	43,994.89
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	7,879,337,898.73	2,156,386,172.92

## § 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

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中信保诚丰裕一年持有期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、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚丰裕一年持有期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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2022 年 01 月 21 日