

中信保诚至远动力混合型证券投资基金(原信诚至远灵活配置混合型  
证券投资基金转型)

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。

中信保诚至远动力混合型证券投资基金由信诚至远灵活配置混合型证券投资基金转型而成。信诚至远灵活配置混合型证券投资基金报告期自2021年10月1日起至2021年10月22日止，中信保诚至远动力混合型证券投资基金报告期自2021年10月23日起至2021年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

### 中信保诚至远动力混合型证券投资基金

#### 2.1 基金基本情况

基金简称	中信保诚至远动力混合
基金主代码	550015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年10月23日
报告期末基金份额总额	1,757,221,874.93份
投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，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。</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</p>

	<p>股票。</p> <p><b>2、股票投资策略</b></p> <p>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。</p> <p>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，本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法，严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>4、证券公司短期公司债券投资策略</b></p> <p>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> <p><b>5、可转换债券及可交换债券的投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>6、资产支持证券投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>7、股指期货投资策略</b></p>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>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。</p> <p>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，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，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。</p> <p>9、融资投资策略</p> <p>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>10、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。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	60%×沪深 300 指数收益率+20%×恒生指数收益率（使用估值汇率折算）+20%×中证综合债指数收益率	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中信保诚至远动力混合 A	中信保诚至远动力混合 C
下属分级基金的交易代码	550015	550016
报告期末下属分级基金的份额总额	1,543,338,195.46 份	213,883,679.47 份

注：中信保诚至远动力混合型证券投资基金由信诚至远灵活配置混合型证券投资基金转型而成。自 2021

年10月23日起,《中信保诚至远动力混合型证券投资基金基金合同》生效,《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

## § 2 基金产品概况

### 信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

#### 2.1 基金基本情况

基金简称	信诚至远
基金主代码	550015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月31日
报告期末基金份额总额	1,788,997,643.66份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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;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、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>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</p>

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、中小企业私募债券投资策略

在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征,选择具有相对优势的类属和个券进行投资。同时,通过期限和品种的分散投资降低基金投资中小企业私募债券的信用风险、利率风险和流动性风险。

#### 6、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。

#### 7、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。

#### 8、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,以套期保值为目的,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。

#### 9、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,确定其合理内在价值,构建交易组合。

#### 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。 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。	
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信诚至远 A	信诚至远 C
下属分级基金的交易代码	550015	550016
报告期末下属分级基金的份额总额	1,626,593,265.35 份	162,404,378.31 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 中信保诚至远动力混合型证券投资基金

#### 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23日-2021年12月31日）	
	中信保诚至远动力混合 A	中信保诚至远动力混合 C
1. 本期已实现收益	141,710,355.51	22,847,690.92
2. 本期利润	76,146,213.34	11,577,304.64
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0477	0.0608
4. 期末基金资产净值	4,742,908,624.61	935,863,646.96
5. 期末基金份额净值	3.0731	4.3756

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、本基金合同在当期生效，本报告期不足一季度。

#### 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

中信保诚至远动力混合 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
自基金合同生效起 至今	1.55%	0.86%	-2.22%	0.60%	3.77%	0.26%

中信保诚至远动力混合 C

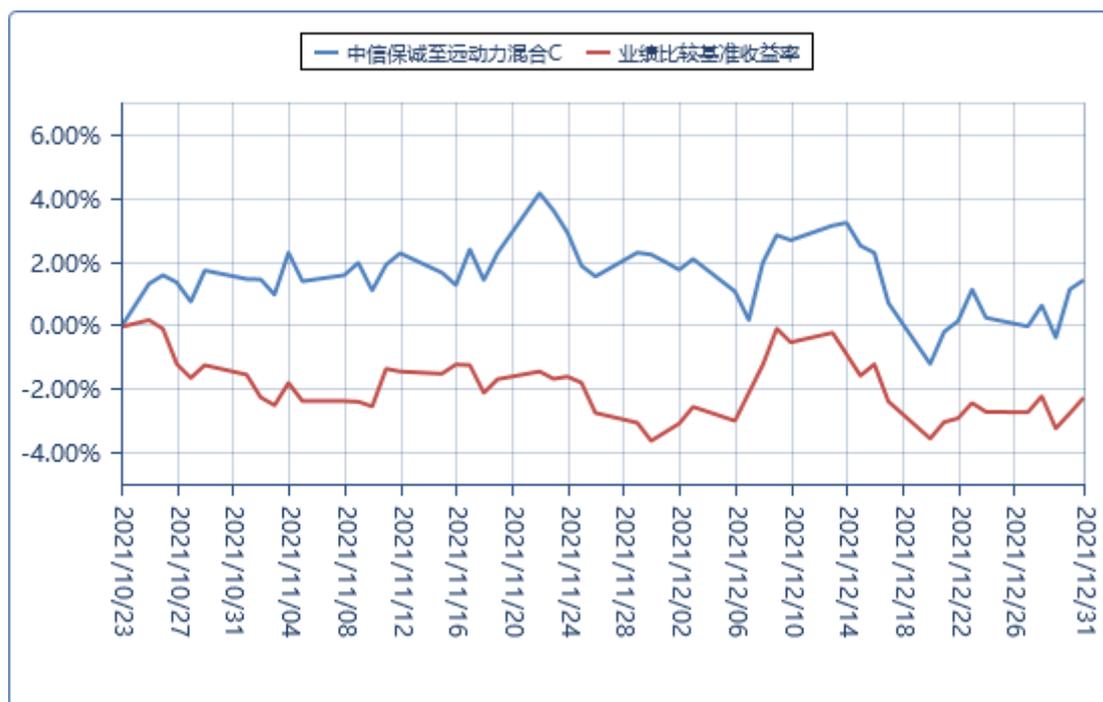
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起 至今	1.48%	0.86%	-2.22%	0.60%	3.70%	0.26%

### 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

中信保诚至远动力混合 A



中信保诚至远动力混合 C



注：本基金转型日期为2021年10月23日，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

##### 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10月22日）	
	信诚至远 A	信诚至远 C
1. 本期已实现收益	12,689,708.84	1,583,226.74
2. 本期利润	87,546,237.35	11,204,296.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0535	0.0723
4. 期末基金资产净值	4,922,431,249.09	700,224,093.74
5. 期末基金份额净值	3.0262	4.3116

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

信诚至远 A

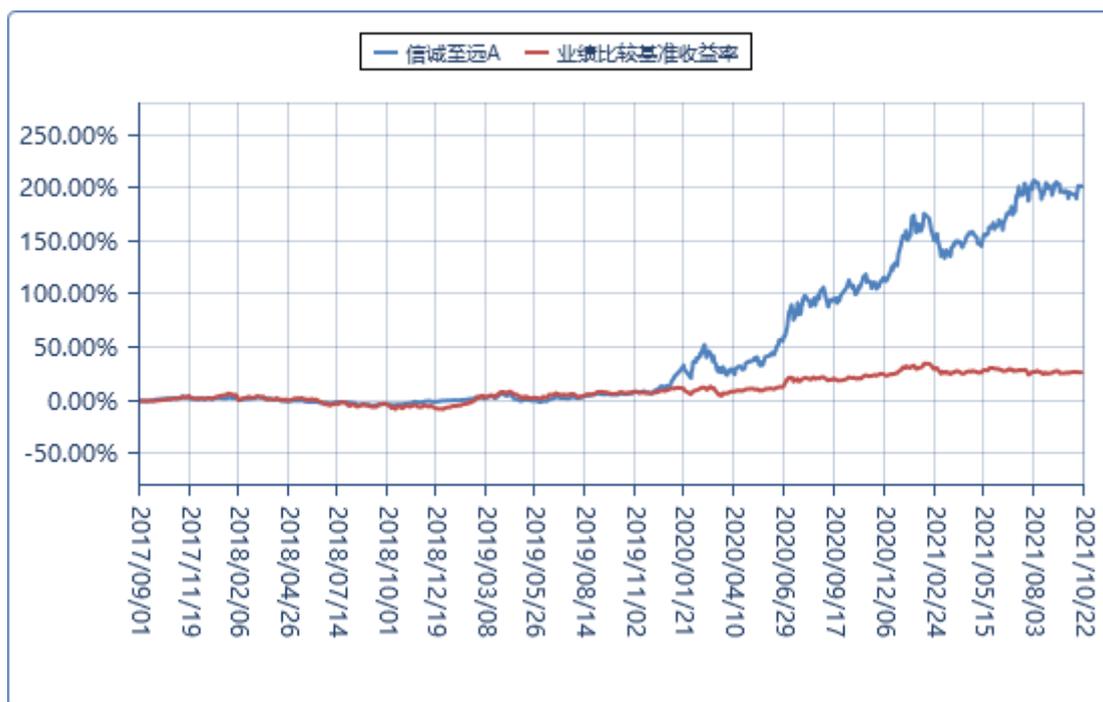
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2021年10月01日 -2021年10月22日	1.79%	0.96%	0.86%	0.44%	0.93%	0.52%
2021年07月01日 -2021年10月22日	6.68%	1.45%	-1.72%	0.58%	8.40%	0.87%
2021年01月01日 -2021年10月22日	26.80%	1.44%	-0.27%	0.63%	27.07%	0.81%
2019年01月01日 -2021年10月22日	201.81%	1.41%	37.78%	0.65%	164.03%	0.76%
2017年08月31日 -2021年10月22日	202.62%	1.17%	27.92%	0.64%	174.70%	0.53%

信诚至远 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
2021年10月01日 -2021年10月22日	1.77%	0.96%	0.86%	0.44%	0.91%	0.52%
2021年07月01日 -2021年10月22日	6.56%	1.45%	-1.72%	0.58%	8.28%	0.87%
2021年01月01日 -2021年10月22日	26.44%	1.44%	-0.27%	0.63%	26.71%	0.81%
2019年01月01日 -2021年10月22日	199.23%	1.41%	37.78%	0.65%	161.45%	0.76%
2017年08月31日 -2021年10月22日	331.16%	1.74%	27.92%	0.64%	303.24%	1.10%

### 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

信诚至远 A



信诚至远 C



## § 4 管理人报告

中信保诚至远动力混合型证券投资基金

### 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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
王睿	权益投资部总监、基金经理	2019年10月25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。
刘锐	基金经理	2019年12月18日	-	7	刘锐先生，工学硕士。曾任职于腾讯科技，担任产品经理；于民生证券，担任研究员。2015年4月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任中信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金的基金经理。

注：1.自2022年1月14日起，王睿离任本基金基金经理。

2. 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。

3. 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《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《中信保诚至远动力混合型证券投资基金基金合同》、《中信保诚至远动力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

近期国内和海外疫情仍有反复,目前看 omicron 病毒传染力虽强但重症率未见明显升高,辉瑞小分子新冠口服药数据较好,展望 2022 年,我们对全球供应链恢复保持乐观。美联储 taper 加速落地,美股表

现超预期强势，部分科技龙头公司股价持续创新高。国内市场来看，11月工业企业利润增速大幅回落，消费恢复进度仍然缓慢，流动性相对宽松成为支撑市场的核心因素。整体来看，我们认为全球经济在逐步复苏的过程中。

报告期内，整体组合股票仓位保持在较高水位。相较三季度，我们按照细分领域的景气度结合远期市值空间，基于预期收益率对组合进行了再均衡，增加了云计算、汽车电子（包括电动化和智能化）的配置，降低了光伏和医药的权重，重点配置方向仍然聚焦在云计算、新能源车、光伏、创新药/器械等科技成长板块。展望未来，我们对科技成长行情仍然保持乐观，将继续聚焦中长期逻辑好的赛道和龙头公司，持续在科技类资产中寻找中长期投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，原信诚至远 A(2021/10/1 至 2021/10/22) 份额净值增长率为 1.79%，同期业绩比较基准收益率为 0.86%；信诚至远 C(2021/10/1 至 2021/10/22) 份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 0.86%。

中信保诚至远动力混合 A(2021/10/23 至 2021/12/31) 份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为-2.22%；中信保诚至远动力混合 C(2021/10/23 至 2021/12/31) 份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为-2.22%。

#### 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

### 中信保诚至远动力混合型证券投资基金

#### 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	4,692,139,494.08	82.22
	其中：股票	4,692,139,494.08	82.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	314,685,000.00	5.51
	其中：债券	314,685,000.00	5.51

	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	200,000,500.00	3.50
	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	443,920,501.42	7.78
8	其他资产	55,778,693.27	0.98
9	合计	5,706,524,188.77	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94,763,682.72元，占资产净值比例为1.67%。

## 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	-	-
C	制造业	3,692,034,744.45	65.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	168,328.64	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	15,410,548.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	554,720,387.01	9.77
J	金融业	242,768,663.91	4.28
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	28,684,176.22	0.51
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	63,515,888.64	1.12
S	综合	-	-
	合计	4,597,375,811.36	80.96

### 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	19,903,000.32	0.35
信息科技	37,336,521.60	0.66
公用事业	37,524,160.80	0.66
合计	94,763,682.72	1.67

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	300750	宁德时代	640,100	376,378,800.00	6.63
2	002153	石基信息	7,353,477	211,338,928.98	3.72
3	002049	紫光国微	900,183	202,541,175.00	3.57
4	002223	鱼跃医疗	5,225,600	197,527,680.00	3.48
5	603799	华友钴业	1,753,400	193,417,554.00	3.41
6	300059	东方财富	5,048,681	187,356,551.91	3.30
7	600660	福耀玻璃	3,944,500	185,943,730.00	3.27
8	000938	紫光股份	7,710,969	176,195,641.65	3.10
9	300308	中际旭创	3,800,150	161,506,375.00	2.84
10	002475	立讯精密	3,272,662	161,014,970.40	2.84

### 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	311,237,000.00	5.48
	其中：政策性金融债	311,237,000.00	5.48
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)	3,448,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	314,685,000.00	5.54

### 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	190207	19 国开 07	2,100,000	210,672,000.00	3.71
2	170412	17 农发 12	500,000	50,570,000.00	0.89
3	210404	21 农发 04	500,000	49,995,000.00	0.88
4	113052	兴业转债	34,480	3,448,000.00	0.06

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

本基金将按照相关法律法规的规定，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，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

江苏鱼跃医疗设备股份有限公司于2021年12月6日受到江苏省药品监督管理局的处罚(苏药监镇处字[2021]6号)。

对“鱼跃医疗”投资决策程序的说明:鱼跃医疗生产的电动洗胃机(注册证编号:苏械注准20172540154,型号、规格:7DI,批号:2102系列号02,产品编号:2102020005),经上海市医疗器械检验研究院、中国食品药品检定研究院医疗器械检定所检验,“流量”不符合规定,违反了《医疗器械监督管理条例》(2017年修订)第二十四条第一款规定。江苏省药品监督管理局对鱼跃医疗责令改正,罚款147304.50元,处罚日期为2021年12月6日。

电动洗胃机不是鱼跃医疗的核心业务产品,公司此次受到处罚不影响公司正常经营和其他业务发展。

鱼跃医疗是一家以提供家用医疗器械、医用临床产品及与之相关的医疗服务为主要业务的公司。公司产品主要集中在医用呼吸与供氧、家用医疗及慢病管理、院内外消毒感控、手术与眼科器械及中医器械等领域。对鱼跃医疗的投资是基于其在呼吸、糖尿病、感控等业务的优势作出的决策,此次处罚不影响我们对公司业务将良好发展的判断。

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	1,585,969.91
2	应收证券清算款	14,819,234.34
3	应收股利	-
4	应收利息	5,900,258.10
5	应收申购款	33,473,230.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	55,778,693.27

#### 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。

## § 5 投资组合报告

### 信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

#### 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	4,698,549,174.11	81.28
	其中：股票	4,698,549,174.11	81.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	311,578,000.00	5.39
	其中：债券	311,578,000.00	5.39
	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	701,603,877.60	12.14
8	其他资产	69,080,631.17	1.19
9	合计	5,780,811,682.88	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,229,619,557.53	57.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,049.98	0.00
F	批发和零售业	272,137.30	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	55,262,628.80	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	522,481,430.57	9.29
J	金融业	498,673,940.44	8.87
K	房地产业	56,376,299.16	1.00
L	租赁和商务服务业	95,131,581.00	1.69
M	科学研究和技术服务业	226,660,551.82	4.03
N	水利、环境和公共设施管理业	27,046.50	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	14,019,954.37	0.25
R	文化、体育和娱乐业	5,996.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,698,549,174.11	83.56

### 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 报告期末投资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	300750	宁德时代	566,400	340,632,960.00	6.06
2	300059	东方财富	7,520,260	249,973,442.40	4.45
3	000938	紫光股份	8,895,938	246,150,604.46	4.38
4	002812	恩捷股份	764,800	229,440,000.00	4.08

5	600519	贵州茅台	119,400	226,979,400.00	4.04
6	603259	药明康德	1,620,040	226,449,191.20	4.03
7	600660	福耀玻璃	3,937,100	195,083,305.00	3.47
8	002415	海康威视	3,500,000	194,040,000.00	3.45
9	300037	新宙邦	1,347,800	178,691,324.00	3.18
10	002049	紫光国微	880,000	176,704,000.00	3.14

#### 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	311,578,000.00	5.54
	其中:政策性金融债	311,578,000.00	5.54
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	311,578,000.00	5.54

#### 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	190207	19国开07	2,100,000	210,903,000.00	3.75
2	170412	17农发12	500,000	50,720,000.00	0.90
3	210404	21农发04	500,000	49,955,000.00	0.89

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

本基金将按照相关法律法规的规定，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，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

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	1,652,632.73
2	应收证券清算款	28,213,614.83
3	应收股利	-
4	应收利息	4,042,942.98
5	应收申购款	35,171,440.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	69,080,631.17

### 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

中信保诚至远动力混合型证券投资基金

单位：份

项目	中信保诚至远动力混合 A	中信保诚至远动力混合 C
基金合同生效日（2021年10月23日）基金份额总额	1,626,593,265.35	162,404,378.31
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	148,837,045.82	114,013,862.91
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	232,092,115.71	62,534,561.75
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,543,338,195.46	213,883,679.47

## § 6 开放式基金份额变动

**信诚至远灵活配置混合型证券投资基金**

单位：份

项目	信诚至远 A	信诚至远 C
报告期期初基金份额总额	1,620,687,098.05	153,896,357.83
报告期期间基金总申购份额	46,907,054.94	16,590,353.52
减：报告期期间基金总赎回份额	41,000,887.64	8,082,333.04
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	1,626,593,265.35	162,404,378.31

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**中信保诚至远动力混合型证券投资基金**

**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

项目	中信保诚至远动力混合 A	中信保诚至远动力混合 C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	1,720,234.00	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,720,234.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.10	-

**7.2 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。

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**信诚至远灵活配置混合型证券投资基金**

**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

项目	信诚至远 A	信诚至远 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,720,234.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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	1,720,234.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.10	-

## 7.2 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

中信保诚至远动力混合型证券投资基金

无

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

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

2021年9月15日，信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会讨论通过了信诚至远灵活配置混合型证券投资基金的修改议案，内容包括信诚至远灵活配置混合型证券投资基金调整基金的投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、管理费率以及修订基金合同等，并同意将信诚至远灵活配置混合型证券投资基金更名为“中信保诚至远动力混合型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2021年10月23日起，《中信保诚至远动力混合型证券投资基金基金合同》生效，《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金管理人于2022年1月12日发布了《关于旗下中信保诚至远动力混合型证券投资基金增加E类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自2022年1月12日起，中信保诚至远动力混合型证券投资基金增加E类基金份额并对基金合同、托管协议、招募说明书等相关法律文件进行修订。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、(原)信诚添金分级债券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、(原)信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同
- 4、(原)信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书
- 5、(原)信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 6、(原)信诚至远灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 7、中信保诚至远动力混合型证券投资基金基金合同
- 8、中信保诚至远动力混合型证券投资基金招募说明书
- 9、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