中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2026 年第 3 季度报告

2026 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：2026 年 10 月 26 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约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 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	中信保诚新旺混合(LOF)
场内简称	中信保诚新旺
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	110,368,422.07 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

	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。 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。 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。 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。 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。		
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率*80%+中证 A500 指数收益率*20%		
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	中信保诚新旺混合(LOF)A	中信保诚新旺混合(LOF)C	中信保诚新旺混合(LOF)E
下属分级基金场内简称	中信保诚新旺	-	-
下属分级基金的交易代码	165526	165527	028358
报告期末下属分级基金的份额总额	18,461,784.37 份	91,904,775.30 份	1,862.40 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（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）		
	中信保诚新旺混合(LOF)A	中信保诚新旺混合(LOF)C	中信保诚新旺混合(LOF)E
1.本期已实现收益	-133,704.02	-371,467.88	-5.51
2.本期利润	-345,328.26	-1,045,299.22	-13.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0198	-0.0133	-0.0093
4.期末基金资产净值	29,623,005.57	138,728,456.90	2,986.11
5.期末基金份额净值	1.6046	1.5095	1.6034

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。

3.2 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

中信保诚新旺混合(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	-1.55%	0.12%	0.26%	0.09%	-1.81%	0.03%
过去六个月	0.45%	0.15%	1.38%	0.06%	-0.93%	0.09%
过去一年	0.92%	0.16%	3.60%	0.05%	-2.68%	0.11%
过去三年	3.39%	0.15%	12.55%	0.03%	-9.16%	0.12%
过去五年	5.15%	0.19%	21.49%	0.02%	-16.34%	0.17%
过去七年	32.93%	0.21%	30.43%	0.02%	2.50%	0.19%
过去十年	57.71%	0.30%	43.84%	0.02%	13.87%	0.28%
自基金合同生效起至今	64.17%	0.28%	49.73%	0.02%	14.44%	0.26%

中信保诚新旺混合(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	-1.58%	0.12%	0.26%	0.09%	-1.84%	0.03%
过去六个月	0.41%	0.15%	1.38%	0.06%	-0.97%	0.09%

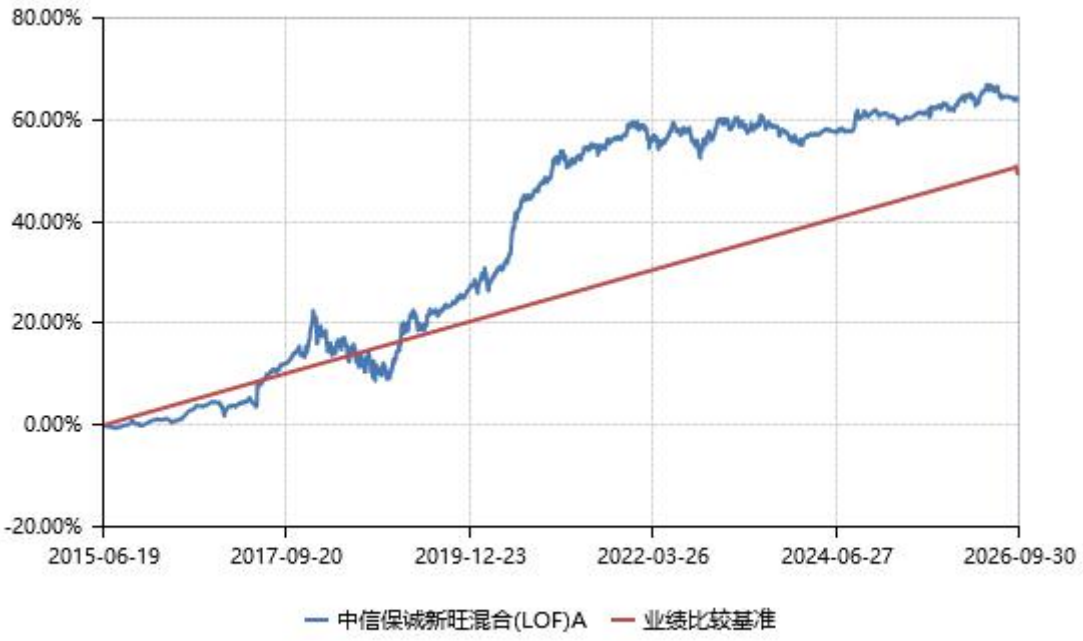
过去一年	0.84%	0.16%	3.60%	0.05%	-2.76%	0.11%
过去三年	2.13%	0.14%	12.55%	0.03%	-10.42%	0.11%
过去五年	3.60%	0.18%	21.49%	0.02%	-17.89%	0.16%
过去七年	30.73%	0.21%	30.43%	0.02%	0.30%	0.19%
过去十年	48.89%	0.29%	43.84%	0.02%	5.05%	0.27%
自基金合同生效起至今	54.40%	0.28%	47.50%	0.02%	6.90%	0.26%

中信保诚新旺混合(LOF)E

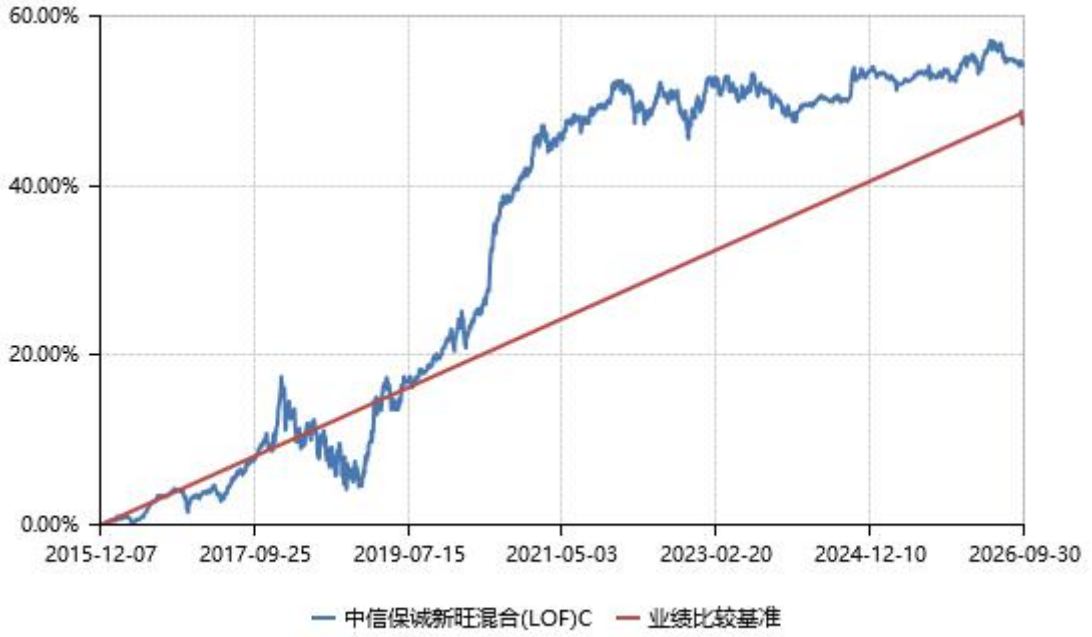
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.49%	0.07%	0.18%	0.09%	-0.67%	-0.02%

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

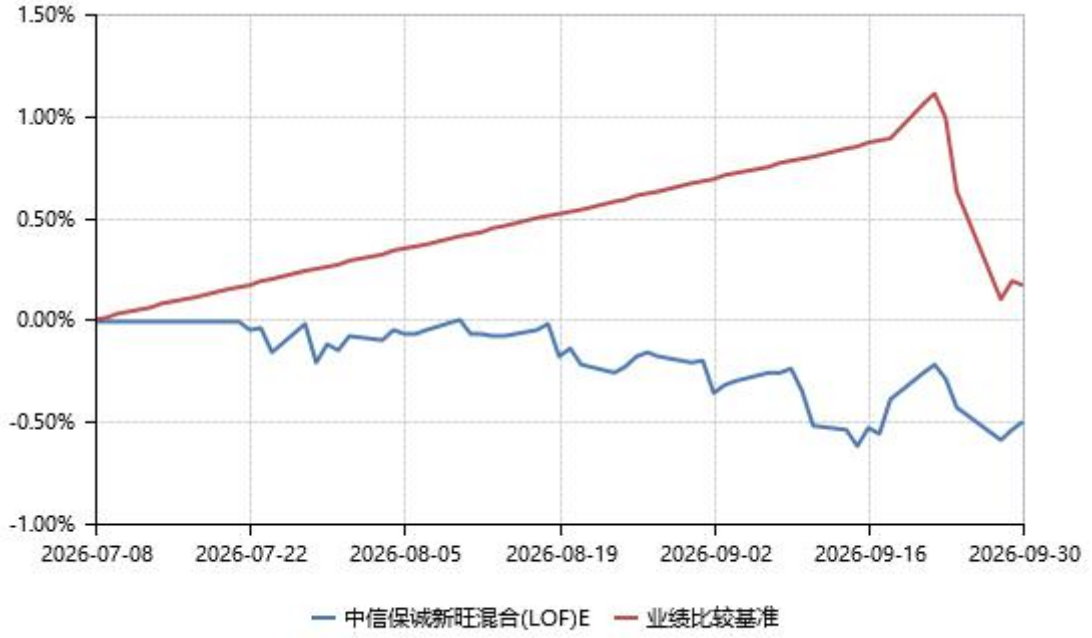
中信保诚新旺混合(LOF)A



中信保诚新旺混合(LOF)C



中信保诚新旺混合(LOF)E



注：1、本基金于 2026 年 7 月 8 日起新增 E 类份额。

2、根据《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 9 月 21 日起，变更业绩比较基准为中债-综合全价（总值）指数收益率*80%+中证 A500 指数收益率*20%。

§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		
姜鹏	基金经理	2025 年 02 月 24 日	-	12	姜鹏先生，经济学硕士。曾担任中交城市投资控股有限公司业务分析岗、杭州金达资产管理有限公司量化研究员。2017 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、投资经理。现任中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚中证A500指数增强型证券投资基金的基金经理。
顾飞辰	基金经理	2025 年 12 月 29 日	-	12	顾飞辰女士，管理学硕士。曾担任第一创业摩根大通证券有限责任公司投资银行部分析员、澳门国际银行资金部债券投资处高级主任、民生银行上海分行金融市场部分析员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易部交易总监助理、上海光大证券资产管理有限公司交易管理部副总经理（主持工作）。2023

					年 8 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任债券投资经理。现任中信保诚至泰中短债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 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚乾元 30 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、中信保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遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。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，基金管理人不存在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》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，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，满足条件时自动执行交易系统中的公平交易程序，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检查和统计分析。本报告期，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原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有投资组合的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行合理管控，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析。报告期内，本投资组合与公司旗下管理的其它投资组合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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

全球宏观方面，三季度全球经济在“强美元叙事”与地缘博弈中呈现分化加剧的特征。全球地缘政治局势并未实质性缓解，经历了“短暂缓和—再度升级—长期僵持”的反复过程，霍尔木兹海峡通航持续受阻，油价中枢显著抬升，地缘风险溢价阶段性成为主导全球宏观和大类资产定价的核心变量；美联储 9 月加息落地并释放鹰派信号，试图通过重塑“强美元叙事”吸引全球资金回流美债；欧洲及日本等发达经济体长期国债利率同步走高，全球无风险利率中枢抬升。中期选举临近，政策不确定性对全球风险偏好形成潜在扰动。整体而言，三季度全球宏观在“再通胀”与“紧货币”的拉锯中运行，外部流动性环境逐步收紧。

中国宏观方面，三季度中国经济延续“外需偏强、内需偏弱、新动能对冲旧动能”的 K 型分化格局，总量运行总体平稳。出口端贸易结构持续优化；但内需修复动能偏弱，消费复苏斜率放缓，地产投资仍不景气，政策端明确转向“精准滴灌”，PSL 利率调降并扩围至“六网”建设、新型政策性金融工具加快投放、居民购房贷款贴息等政策陆续落地，财政金融协同发力特征显著；同时，高技术制造业与装备制造业利润保持较快增长，新质生产力对经济的支撑作用持续强化。物价方面，CPI 与 PPI 双双温和回升，PPI 同比增速持续上行，企业盈利改善趋势延续。整体而言，三季度中国经济在结构分化中温和修复，政策精准发

力与产业升级构成宏观主线。

股票市场方面，三季度 A 股市场整体呈现高位震荡、结构再平衡的格局。科技成长板块在经历二季度大幅上涨后，三季度波动明显加剧，AI 算力、半导体等核心赛道交易拥挤度上升，板块内部出现高低切换与精耕细作的特征；与此同时，前期大幅跑输的消费、地产链等低位板块在政策预期催化下出现阶段性估值修复，市场风格从极致分化向再平衡过渡。行业层面，通信、电子等科技类资产出现明显回调，消费内需类核心资产在低估值与政策催化下重新获得资金关注。市场情绪方面，三季度末情绪指标探底，融资余额与成交活跃度同步收缩，前期过热风险得到一定的释放。整体而言，三季度 A 股在科技主线延续与结构再平衡中震荡，产业趋势明确、估值合理的细分方向仍具备配置价值，困境反转风格开始占优，市场仍有结构性机会。

债券市场方面，资金面稳定、基本面偏弱、增量政策相对克制的背景下，三季度债市整体偏强运行，收益率曲线明显平坦化，10 年期国债收益率从 6 月末 1.73%附近震荡下行至 9 月末 1.68%附近，超长债表现突出，30-10 年利差整体压缩；信用债方面，收益率普遍下行，信用利差压缩至历史低位。

报告期内，本基金股票投资组合仍然以传统蓝筹为主，并考虑公司治理、盈利能力、成长性、资产质量、估值、市场交易行为等因素，以定性分析结合定量模型的方式构建投资组合，同时采用量化模型控制组合风险，保持组合持仓分散和行业配置均衡。债券投资方面，仓位仍然以利率债为主，其中利率债主要投资于短久期品种，以满足现金的基本配置要求，同时避免杠杆过高。

展望 2026 年四季度，A 股市场有望在盈利验证与政策支撑下演绎震荡修复、中枢温和抬升的收官行情。经历三季度的调整后，市场交易情绪与板块拥挤度已有所降温，局部过热的风险得到一定的释放，为四季度的修复行情积蓄了条件。市场驱动力将进一步从流动性预期转向盈利基本面，业绩兑现情况将成为核心定价锚，科技产业的投资逻辑预计从赛道贝塔转向业绩兑现的阿尔法。结构上，科技成长板块内部预计将出现分化与轮动，估值合理、能够兑现业绩收益的公司预计可能获得超额收益。同时，经历前期调整后，部分超跌的传统蓝筹与消费内需板块在政策催化下存在估值修复机会，风格预计将继续从明显分化向均衡再平衡过渡，资源类红利资产的配置价值也值得重视。

债券市场投资方面，9 月末一系列稳增长措施出台，反映政策提振内需的意愿偏强，年内经济目标顺利完成问题不大，但经济修复斜率可能有限。四季度供给压力缓解，机构或仍有配置需求，供需格局改善可能对债券市场有所支撑，预计债市可能维持偏强震荡；信用方面，当前信用等级利差已压缩至历史极值，继续下沉性价比较低。

股票市场投资方面，本基金继续采用定量与定性结合的方法，综合考虑公司治理、盈利能力、成长性、资产质量、估值、市场交易行为等因素筛选个股，适度分散构建投资组合，并采用量化模型适度控制投资组合的行业集中度和风险暴露，根据估值与盈利能力的平衡及交易行为影响动态调整组合。债券投资方面，预期货币政策仍将保持积极，利率曲线在前期上升后或将保持平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚新旺混合(LOF)A 份额净值增长率为-1.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%；中信保诚新旺混合(LOF)C 份额净值增长率为-1.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%；中信保诚新旺混合(LOF)E 份额净值增长率为-0.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.18%。

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	18,990,418.45	11.26
	其中：股票	18,990,418.45	11.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	148,394,020.43	87.99
	其中：债券	148,394,020.43	87.99
	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	1,225,258.15	0.73
8	其他资产	29,824.47	0.02
9	合计	168,639,521.50	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	132,402.00	0.08
B	采矿业	757,755.00	0.45
C	制造业	10,932,295.00	6.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,008,243.00	0.60
E	建筑业	489,003.00	0.29
F	批发和零售业	321,752.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,070,307.00	0.64
H	住宿和餐饮业	14,927.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,073,854.00	0.64
J	金融业	2,468,995.45	1.47
K	房地产业	230,641.00	0.14
L	租赁和商务服务业	138,334.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	233,833.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	27,499.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,365.00	0.00
Q	卫生和社会工作	27,773.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	34,305.00	0.02
S	综合	23,135.00	0.01
	合计	18,990,418.45	11.28

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 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	500	629,310.00	0.37
2	000333	美的集团	6,400	512,640.00	0.30
3	600036	招商银行	9,900	408,474.00	0.24
4	000651	格力电器	10,100	386,628.00	0.23
5	601166	兴业银行	17,200	310,460.00	0.18
6	300750	宁德时代	1,000	291,110.00	0.17
7	601398	工商银行	34,700	287,316.00	0.17
8	601318	中国平安	5,100	271,779.00	0.16

9	600900	长江电力	9,400	268,276.00	0.16
10	600690	海尔智家	13,100	267,502.00	0.16

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	71,817,048.50	42.66
	其中：政策性金融债	30,559,923.29	18.15
4	企业债券	30,194,021.10	17.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	46,382,268.16	27.55
7	可转债（可交换债）	682.67	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	148,394,020.43	88.14

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	250413	25 农发 13	200,000	20,209,238.36	12.00
2	170405	17 农发 05	100,000	10,350,684.93	6.15
3	242480004	24 华夏银行永续债 01	100,000	10,289,387.95	6.11
4	242400011	24 广发银行永续债 01	100,000	10,263,431.23	6.10
5	102281535	22 华发集团 MTN010(科创票据)	100,000	10,240,013.70	6.08

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

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，广发银行股份有限公司受到中国人民银行、国家外汇管理局广东省分局处罚（银罚决字[2026]104 号、粤汇处[2025]16 号）；华夏银行股份有限公司受到中国人民银行处罚（银罚决字[2025]75 号）；东方财富证券股份有限公司受到中国人民银行处罚（银罚决字[2026]72 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信用资质，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其分支机构、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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	29,824.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	29,824.47

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127110	广核转债	682.67	0.00

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	中信保诚新旺混合(LOF)A	中信保诚新旺混合(LOF)C	中信保诚新旺混合(LOF)E
报告期期初基金份额总额	10,926,277.23	22,616,216.26	-

报告期期间基金总申购份额	8,729,881.20	99,198,991.20	1,862.40
减：报告期期间基金总赎回份额	1,194,374.06	29,910,432.16	-
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	18,461,784.37	91,904,775.30	1,862.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	中信保诚新旺混合(LOF)A	中信保诚新旺混合(LOF)C	中信保诚新旺混合(LOF)E
报告期期初管理人持有的本基金份额	6,913,262.10	-	-
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	6,913,262.10	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.26	-	-

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

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

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	1	2026-07-01 至 2026-07-02	6,913,262.10	-	-	6,913,262.10	6.26%
个人	1	2026-07-13 至 2026-07-16	-	12,985,300.90	-	12,985,300.90	11.77%
	2	2026-08-12 至 2026-09-30	-	32,990,234.89	-	32,990,234.89	29.89%

产品特有风险
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致： (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； (3)因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； (4)基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； (5)大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2026 年 7 月 8 日披露的《关于旗下中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）调整 A 类基金份额申购费率、增加 E 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2026 年 7 月 8 日起本基金增加 E 类份额并修改基金合同及托管协议中相关条款,招募说明书（更新）涉及前述内容的部分一并修订，同时调整本基金 A 类基金份额申购费率。

根据基金管理人于 2026 年 8 月 22 日披露的《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 9 月 21 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订，同时对基金管理人信息及基金托管人信息（如需）进行更新。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、（原）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、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同

4、中信保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

2026 年 10 月 26 日