

# 中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)

## 2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	10
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	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5	托管人报告	12
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	13
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	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	37
7.1	期末基金资产组合情况	37
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42

7.12	投资组合报告附注 .....	42
§ 8	基金份额持有人信息 .....	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.4	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 .....	44
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	44
§ 9	开放式基金份额变动 .....	44
§ 10	重大事件揭示 .....	45
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4	基金投资策略的改变 .....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8	其他重大事件 .....	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
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 .....	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§ 12	备查文件目录 .....	51
12.1	备查文件目录 .....	51
12.2	存放地点 .....	51
12.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	中信保诚深度价值混合 (LOF)
场内简称	中信保诚深度 LOF
基金主代码	165508
基金运作方式	契约型、上市开放式
基金合同生效日	2010 年 07 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	239,560,109.09 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 09 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对公司基本面的研究,深入剖析股票价值被低估的原因,从而挖掘具有深度价值的股票,以力争获取资本的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略:本基金定位为混合型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。</p> <p>2、股票投资策略:本基金的投资理念是价值投资,即投资于市场价格低于其内在价值的股票。公司内在价值的评估和判断包括公司的历史纪录和未来前景两方面。具体考量因素包括公司未来的预期收益和股息以及未来预期收益和股息的乘数(既包括历史可测的纪录影响,也要考虑一些重要的其他因素,例如行业的性质、公司的竞争地位、管理层的才能等等)是否在股价中被完全反映;公司的分红情况即股息收益率是否稳定并在将来可以持续;公司的资产本身是否会因重组、并购等行为发生重大变化等等。</p> <p>3、债券投资策略: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、其他金融工具的投资策略:本基金对权证等衍生金融工具的投资以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的证券的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资或运用衍生工具。在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露比例。</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</p>

	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。
业绩比较基准	上证 180 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金, 预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金, 低于股票型基金, 属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王小飞
	联系电话	021-68649788	021-60637103
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	021-60637228
传真		021-50120895	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		涂一锴	张金良

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	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

# § 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 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)
---------------	--

本期已实现收益	21,041,316.26
本期利润	72,621,705.98
加权平均基金份额本期利润	0.2995
本期加权平均净值利润率	16.82%
本期基金份额净值增长率	18.50%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2024年06月30日)</b>
期末可供分配利润	217,192,930.22
期末可供分配基金份额利润	0.9066
期末基金资产净值	456,753,039.31
期末基金份额净值	1.9066
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024年06月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	147.18%

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	2.35%	0.64%	-2.07%	0.36%	4.42%	0.28%
过去三个月	6.45%	0.62%	-0.50%	0.54%	6.95%	0.08%
过去六个月	18.50%	0.71%	3.27%	0.65%	15.23%	0.06%
过去一年	19.29%	0.63%	-3.43%	0.65%	22.72%	-0.02%
过去三年	-6.65%	0.85%	-19.92%	0.79%	13.27%	0.06%
自基金合同生效起至今	147.18%	1.48%	39.47%	1.07%	107.71%	0.41%

#### 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、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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 84 只，分别为：中信保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、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保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、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、中信保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)、中信保诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚全球商品主题证

券投资基金 (LOF)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金 (LOF)、中信保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)、中信保诚中证建筑工程指数型证券投资基金 (LOF)、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、中信保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、中信保诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金、中信保诚薪金宝货币市场基金、中信保诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保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、中信保诚稳健债券型证券投资基金、中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保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、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳悦债券型证券投资基金、中信保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、中信保诚稳泰债券型证券投资基金、中信保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、中信保诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智慧金货币市场基金、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、中信保诚先进制造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、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、

中信保诚景气优选混合型证券投资基金、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 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		
吴一静	基金经理	2022 年 07 月 13 日	-	8	吴一静女士，经济学硕士。曾担任朱雀股权投资管理股份有限公司研究员、中银基金管理有限公司研究员。2020 年 1 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任研究员。现任中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚弘远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《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同、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，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。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

2024 年上半年，A 股延续了震荡走势，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%。分行业来看，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化涨幅领先，综合、计算机、商业贸易、休闲服务、传媒跌幅较大。

本基金在 2024 年一季度，增持了公用事业、家电等行业，小幅减持了煤炭、银行、非银金融等行业。在二季度，增持了交通运输、机械设备等行业，减持了公用事业、银行等行业。

#### 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 18.50%，同期业绩比较基准收益率为 3.27%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，国内经济处于结构转型过程中，预计全年将呈现筑底状态。政策端持续呵护，加强逆周期调节，实施好积极的财政政策和稳健的货币政策，提振消费、扩大内需等政策有望

出台落地。

当前市场估值处于历史低位水平，随着后续海外流动性边际宽松，国内经济企稳信号不断累积，预计市场仍将具有结构性机会。

产品主要聚焦于红利和低估值周期的方向上，市场对企业盈利质量的关注度不断提升，具有盈利稳定、现金流充沛、较好分红水平的上市公司或仍受市场的青睐。在经济处于弱复苏阶段，盈利稳定且抵御市场波动能力较强的红利资产具有吸引力，同时在经济预期向好阶段，也积极关注顺周期方向的投资机会。

#### 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其适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、海外投资负责人、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历。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或者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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	21,965,823.32	34,857,304.60
结算备付金		2,229,218.39	8,521,361.62
存出保证金		57,824.83	97,041.42
交易性金融资产	6.4.7.2	387,165,894.90	287,793,972.58
其中：股票投资		368,986,385.17	287,793,972.58
基金投资		-	-
债券投资		18,179,509.73	-
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	-	73,591,877.33

应收清算款		45,968,261.16	5,671,460.89
应收股利		-	-
应收申购款		280,942.23	4,153.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		457,667,964.83	410,537,172.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	-
应付赎回款		170,060.66	226,643.67
应付管理人报酬		441,855.08	441,064.52
应付托管费		73,642.53	73,510.80
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	229,367.25	777,191.59
负债合计		914,925.52	1,518,410.58
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	239,560,109.09	254,227,763.78
未分配利润	6.4.7.8	217,192,930.22	154,790,997.65
净资产合计		456,753,039.31	409,018,761.43
负债和净资产总计		457,667,964.83	410,537,172.01

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.9066 元，基金份额总额 239,560,109.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		75,731,132.97	376,309.27
1. 利息收入		628,777.84	7,674.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	120,999.80	7,674.28
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		507,778.04	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,361,366.85	907,481.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	18,394,465.71	585,315.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	141,125.99	21,233.93
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	4,825,775.15	300,932.69
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	51,580,389.72	-539,367.27
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	160,598.56	520.49
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,109,426.99</b>	<b>269,483.92</b>
1. 管理人报酬		2,580,518.10	201,894.71
2. 托管费		430,086.29	33,649.02
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	98,822.60	33,940.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>72,621,705.98</b>	<b>106,825.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>72,621,705.98</b>	<b>106,825.35</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>72,621,705.98</b>	<b>106,825.35</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	254,227,763.78	154,790,997.65	409,018,761.43
二、本期期初净资产	254,227,763.78	154,790,997.65	409,018,761.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,667,654.69	62,401,932.57	47,734,277.88

(一)、综合收益总额	-	72,621,705.98	72,621,705.98
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-14,667,654.69	-10,219,773.41	-24,887,428.10
其中: 1. 基金申购款	57,829,812.47	44,127,748.20	101,957,560.67
2. 基金赎回款	-72,497,467.16	-54,347,521.61	-126,844,988.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	239,560,109.09	217,192,930.22	456,753,039.31
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,870,713.76	13,720,349.12	26,591,062.88
二、本期期初净资产	12,870,713.76	13,720,349.12	26,591,062.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-187,905.48	-119,559.29	-307,464.77
(一)、综合收益总额	-	106,825.35	106,825.35
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-187,905.48	-226,384.64	-414,290.12
其中: 1. 基金申购款	382,307.28	425,105.92	807,413.20
2. 基金赎回款	-570,212.76	-651,490.56	-1,221,703.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	12,682,808.28	13,600,789.83	26,283,598.11

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

桂思毅

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

中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)(原“信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)”) (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”)《关于核准信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2010]679 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《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同》发售, 基金合同于 2010 年 7 月 30 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集资金总额人民币 524,136,365.45 元。

上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 299 号文审核同意,本基金 31,723,252 份基金份额于 2010 年 9 月 20 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及《信诚深度价值股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定,经与基金托管人协商一致,自 2015 年 8 月 3 日起,本基金名称变更为“信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)”,基金类别变更为“混合型”,同时相应修改基金合同等相关文件的表述。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称及部分深交所基金变更证券简称事宜的公告》,自 2023 年 9 月 12 日起,本基金名称变更为“中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)”,同时相应修改基金合同相关表述。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板股票)、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种(如股指期货等),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于 60%,其中投资于本基金定义的价值型股票的资产占股票资产的比例不低于 80%;债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的比例不高于 40%;现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证不超过基金资产净值的 3%。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为:上证 180 指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

#### 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》（以下合称“企业会计准则”）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<年度报告和中期报告>》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2024年1月1日至2024年6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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6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《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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) 资管产品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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

c) 对基金从上市公司、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（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金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附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日

活期存款	21,965,823.32
等于：本金	21,962,176.62
加：应计利息	3,646.70
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	21,965,823.32

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	313,121,523.35	-	368,986,385.17	55,864,861.82	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,893,795.00	275,929.73	18,179,509.73	9,785.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,893,795.00	275,929.73	18,179,509.73	9,785.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	331,015,318.35	275,929.73	387,165,894.90	55,874,646.82	

#### 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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	581.75
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	134,777.90
其中：交易所市场	134,777.90
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	29,835.26
应付信息披露费	59,672.34
应付账户维护费	4,500.00
合计	229,367.25

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	254,227,763.78	254,227,763.78
本期申购	57,829,812.47	57,829,812.47
本期赎回（以“-”号填列）	-72,497,467.16	-72,497,467.16
本期末	239,560,109.09	239,560,109.09

注：1、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）。

2、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

基金代码	基金名称	本报告期末		上年度末	
		场内	场外	场内	场外
165508	中信保诚深度价值混合(LOF)	355,379.00	239,204,730.09	340,256.00	253,987,507.78

#### 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
上年度末	312,538,018.06	-157,747,020.41	154,790,997.65
本期期初	312,538,018.06	-157,747,020.41	154,790,997.65

本期利润	21,041,316.26	51,580,389.72	72,621,705.98
本期基金份额交易产生的变动数	-17,835,474.23	7,615,700.82	-10,219,773.41
其中：基金申购款	72,995,597.69	-28,867,849.49	44,127,748.20
基金赎回款	-90,831,071.92	36,483,550.31	-54,347,521.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	315,743,860.09	-98,550,929.87	217,192,930.22

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	70,439.04	
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	49,105.64	
其他	1,455.12	
合计	120,999.80	

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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	205,571,250.27	
减：卖出股票成本总额	186,678,076.40	
减：交易费用	498,708.16	
买卖股票差价收入	18,394,465.71	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益—利息收入	146,952.59	
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-5,826.60	
债券投资收益—赎回差价收入	-	
债券投资收益—申购差价收入	-	
合计	141,125.99	

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,579,707.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,487,826.60
减：应计利息总额	97,707.60
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-5,826.60

#### 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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,825,775.15
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	4,825,775.15

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	51,580,389.72
--股票投资	51,570,604.72

—债券投资	9,785.00
—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	51,580,389.72

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	160,036.13
转换费收入	562.43
合计	160,598.56

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行费用	315.00
账户维护费	9,000.00
合计	98,822.60

#### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金无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	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,580,518.10	201,894.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	187,152.74	96,776.05
应支付基金管理人的净管理费	2,393,365.36	105,118.66

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 1.20%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×1.20%/当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	430,086.29	33,649.02

注:支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
中国建设银行股份有限公司	21,965,823.32	70,439.04	5,250,837.62	7,152.10

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设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2024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										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301392	汇成真空	2024年05月28日	6个月	锁定期股票	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301565	中仑新材	2024年06月13日	6个月	锁定期股票	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-

		日								
301580	爱迪特	2024年06月19日	6个月	锁定期股票	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603082	北自科技	2024年01月23日	6个月	锁定期股票	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年06月28日	6个月	锁定期股票	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年01月04日	6个月	锁定期股票	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年01月03日	6个月	锁定期股票	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年02月23日	6个月	锁定期股票	26.00	37.49	244	6,344.00	9,147.56	-
603344	星德胜	2024年03月13日	6个月	锁定期股票	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年06月26日	6个月	锁定期股票	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年01月17日	6个月	锁定期股票	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	锁定期股票	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024年04月29日	6个月	锁定期股票	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	6个月	锁定期股票	22.66	15.89	654	14,819.64	10,392.06	-

688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	锁定期股票	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	锁定期股票	86.96	174.93	168	14,609.28	29,388.24	-
688695	中创股份	2024年03月06日	6个月	锁定期股票	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	锁定期股票	15.69	18.79	794	12,457.86	14,919.26	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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。

本基金管理人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。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。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。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	18,179,509.73	-
合计	18,179,509.73	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

##### 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货币资金、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 2024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							
货币资金	21,965,823.32	-	-	-	-	-	21,965,823.32
结算备付金	2,229,218.39	-	-	-	-	-	2,229,218.39
存出保证金	57,824.83	-	-	-	-	-	57,824.83
交易性金融资产	18,179,509.73	-	-	-	-	368,986,385.17	387,165,894.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	45,968,261.16	45,968,261.16
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	280,942.23	280,942.23
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	42,432,376.27	-	-	-	-	415,235,588.56	457,667,964.83
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	170,060.66	170,060.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	441,855.08	441,855.08
应付托管费	-	-	-	-	-	73,642.53	73,642.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	229,367.25	229,367.25
负债总计	-	-	-	-	-	914,925.52	914,925.52
利率敏感度缺口	42,432,376.27	-	-	-	-	414,320,663.04	456,753,039.31
上年度末 2023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							
货币资金	34,857,304.60	-	-	-	-	-	34,857,304.60
结算备付金	8,521,361.62	-	-	-	-	-	8,521,361.62
存出保证金	97,041.42	-	-	-	-	-	97,041.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	287,793,972.58	287,793,972.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	73,591,877.33	-	-	-	-	-	73,591,877.33
应收清算款	-	-	-	-	-	5,671,460.89	5,671,460.89
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	4,153.57	4,153.57
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	117,067,584.97	-	-	-	-	293,469,587.04	410,537,172.01
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	226,643.67	226,643.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	441,064.52	441,064.52
应付托管费	-	-	-	-	-	73,510.80	73,510.80
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-

费							
应付投资顾问费							
应交税费							
应付利润							
递延所得税负债							
其他负债						777,191.59	777,191.59
负债总计						1,518,410.58	1,518,410.58
利率敏感度缺口	117,067,584.97					291,951,176.46	409,018,761.43

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 2024年06月30日		上年度末 2023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	368,986,385.17	80.78	287,793,972.58	70.36
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	368,986,385.17	80.78	287,793,972.58	70.36

#### 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(2024年06月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	8,588,956.57	13,826,276.02
业绩比较基准中的股票指数下降5%	-8,588,956.57	-13,826,276.02	

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	368,796,741.84	287,729,718.54
第二层次	18,225,120.84	-
第三层次	144,032.22	64,254.04
合计	387,165,894.90	287,793,972.58

###### 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	368,986,385.17	80.62
	其中：股票	368,986,385.17	80.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,179,509.73	3.97
	其中：债券	18,179,509.73	3.97
	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	24,195,041.71	5.29
8	其他各项资产	46,307,028.22	10.12
9	合计	457,667,964.83	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	91,119,320.00	19.95
C	制造业	75,662,790.46	16.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,853,613.00	16.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,199,680.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	41,186,647.20	9.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,783,506.51	3.67
J	金融业	60,192,842.00	13.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,987,986.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	368,986,385.17	80.78

### 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	600938	中国海油	662,600	21,865,800.00	4.79
2	600900	长江电力	734,600	21,244,632.00	4.65
3	600941	中国移动	155,700	16,737,750.00	3.66
4	601398	工商银行	2,850,700	16,248,990.00	3.56
5	601985	中国核电	1,523,900	16,244,774.00	3.56
6	601898	中煤能源	1,200,400	14,980,992.00	3.28

7	601899	紫金矿业	809,000	14,214,130.00	3.11
8	601328	交通银行	1,837,800	13,728,366.00	3.01
9	601088	中国神华	296,200	13,142,394.00	2.88
10	601288	农业银行	2,925,100	12,753,436.00	2.79
11	600803	新奥股份	611,200	12,712,960.00	2.78
12	000333	美的集团	194,800	12,564,600.00	2.75
13	601857	中国石油	1,213,700	12,525,384.00	2.74
14	600674	川投能源	657,136	12,321,300.00	2.70
15	000338	潍柴动力	740,700	12,028,968.00	2.63
16	601298	青岛港	1,106,800	10,581,008.00	2.32
17	600886	国投电力	568,200	10,363,968.00	2.27
18	601919	中远海控	646,080	10,007,779.20	2.19
19	601021	春秋航空	137,100	7,722,843.00	1.69
20	601600	中国铝业	960,600	7,329,378.00	1.60
21	601225	陕西煤业	280,600	7,231,062.00	1.58
22	603816	顾家家居	222,300	7,178,067.00	1.57
23	601211	国泰君安	504,700	6,838,685.00	1.50
24	600398	海澜之家	584,400	5,399,856.00	1.18
25	600028	中国石化	810,600	5,122,992.00	1.12
26	002027	分众传媒	823,100	4,987,986.00	1.09
27	001965	招商公路	412,200	4,888,692.00	1.07
28	600887	伊利股份	184,400	4,764,896.00	1.04
29	000932	华菱钢铁	1,035,400	4,586,822.00	1.00
30	000425	徐工机械	615,100	4,397,965.00	0.96
31	600926	杭州银行	334,900	4,370,445.00	0.96
32	600690	海尔智家	153,800	4,364,844.00	0.96
33	002415	海康威视	138,700	4,287,217.00	0.94
34	601601	中国太保	153,400	4,273,724.00	0.94
35	600795	国电电力	662,100	3,965,979.00	0.87
36	002352	顺丰控股	87,000	3,105,030.00	0.68
37	002064	华峰化学	364,400	2,612,748.00	0.57
38	600018	上港集团	387,600	2,240,328.00	0.49
39	002353	杰瑞股份	63,600	2,231,088.00	0.49
40	603939	益丰药房	89,600	2,199,680.00	0.48
41	600546	山煤国际	139,300	2,036,566.00	0.45
42	601916	浙商银行	717,100	1,979,196.00	0.43
43	603885	吉祥航空	169,800	1,866,102.00	0.41
44	002078	太阳纸业	110,300	1,538,685.00	0.34
45	600426	华鲁恒升	44,700	1,190,808.00	0.26
46	002601	龙佰集团	47,500	882,075.00	0.19
47	601872	招商轮船	91,700	774,865.00	0.17

48	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.04
49	688692	达梦数据	168	29,388.24	0.01
50	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
51	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
52	688709	成都华微	794	14,919.26	0.00
53	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
54	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
55	688584	上海合晶	654	10,392.06	0.00
56	603341	龙旗科技	244	9,147.56	0.00
57	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
58	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
59	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
60	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
61	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
62	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
63	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
64	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
65	603375	盛景微	72	2,800.80	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	600803	新奥股份	10,571,159.60	2.58
2	600674	川投能源	10,384,953.40	2.54
3	601298	青岛港	9,347,599.00	2.29
4	603816	顾家家居	8,238,567.00	2.01
5	601919	中远海控	7,816,035.40	1.91
6	601021	春秋航空	7,651,732.52	1.87
7	601898	中煤能源	7,513,357.00	1.84
8	600886	国投电力	7,492,928.84	1.83
9	601600	中国铝业	7,373,730.00	1.80
10	600926	杭州银行	7,361,482.00	1.80
11	601225	陕西煤业	6,932,916.00	1.70
12	601601	中国太保	6,438,206.00	1.57
13	600795	国电电力	6,306,187.00	1.54
14	600027	华电国际	6,269,636.00	1.53
15	600398	海澜之家	5,198,666.00	1.27
16	002027	分众传媒	5,178,843.00	1.27
17	000338	潍柴动力	5,171,195.00	1.26

18	600887	伊利股份	5,000,758.00	1.22
19	600188	兖矿能源	4,501,861.00	1.10
20	002415	海康威视	4,434,268.00	1.08

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	600919	江苏银行	26,448,747.00	6.47
2	600795	国电电力	17,180,048.00	4.20
3	600027	华电国际	13,674,324.00	3.34
4	600985	淮北矿业	13,538,176.00	3.31
5	000895	双汇发展	11,536,345.00	2.82
6	600028	中国石化	11,365,044.00	2.78
7	601699	潞安环能	10,751,965.00	2.63
8	600023	浙能电力	10,123,682.00	2.48
9	601006	大秦铁路	9,780,378.71	2.39
10	600256	广汇能源	8,456,507.00	2.07
11	601985	中国核电	8,005,347.00	1.96
12	601288	农业银行	6,408,757.00	1.57
13	601881	中国银河	6,158,397.00	1.51
14	600188	兖矿能源	4,662,140.00	1.14
15	601816	京沪高铁	4,334,488.00	1.06
16	600011	华能国际	4,112,037.00	1.01
17	601919	中远海控	3,437,870.00	0.84
18	601898	中煤能源	3,404,575.00	0.83
19	000933	神火股份	3,274,595.00	0.80
20	601328	交通银行	3,091,897.00	0.76

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	216,299,884.27
卖出股票收入(成交)总额	205,571,250.27

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	18,179,509.73	3.98

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	18,179,509.73	3.98

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	179,000	18,179,509.73	3.98

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 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国家金融监督管理总局处罚（金罚决字[2024]29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。

### 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	57,824.83
2	应收清算款	45,968,261.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	280,942.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,307,028.22

### 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
2,357	101,637.72	218,116,679.07	91.05%	21,443,430.02	8.95%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	于洁	50,854.00	14.31%
2	顾忠兴	50,011.00	14.07%
3	蓝国贤	26,000.00	7.32%
4	成巧	20,001.00	5.63%
5	钦峰	19,799.00	5.57%
6	郑一真	18,532.00	5.21%
7	刘江	12,539.00	3.53%
8	张群	12,200.00	3.43%
9	李松汉	11,000.00	3.10%
10	刘桥珍	10,353.00	2.91%

### 8.3 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	114,556.51	0.05%

### 8.4 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

### 8.5 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（2010年07月30日）基金份额总	524,136,365.45
---------------------------	----------------

额	
本报告期期初基金份额总额	254,227,763.78
本报告期基金总申购份额	57,829,812.47
减：本报告期基金总赎回份额	72,497,467.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	239,560,109.09

## § 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
财通证券	2	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	14,440,764.00	3.43%	10,627.22	2.88%	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	
东方证券	1	46,086,345.02	10.95%	43,593.02	11.82%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	6,410,407.08	1.52%	3,921.91	1.06%	-
国联证券	1	866,205.00	0.21%	810.70	0.22%	-
国盛证券	2	77,719,282.24	18.47%	56,936.35	15.43%	-
国泰君安 证券	1	23,237,734.60	5.52%	21,978.90	5.96%	-
国投证券	4	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
国元证券	1	-	-	-	-	
海通证券	2	7,284,279.00	1.73%	6,889.82	1.87%	-
华创证券	2	30,175,215.22	7.17%	28,062.47	7.61%	-
华金证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	3	4,827,792.00	1.15%	4,518.39	1.22%	-
华西证券	2	-	-	-	-	
开源证券	1	-	-	-	-	
民生证券	1	130,518,491.54	31.02%	123,455.31	33.46%	-
平安证券	2	-	-	-	-	
瑞银证券	1	-	-	-	-	
申港证券	1	-	-	-	-	本报告期 退租
申万宏源 证券	5	17,090,901.50	4.06%	15,995.37	4.34%	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	本报告期 退租
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	31,654,050.00	7.52%	23,294.78	6.31%	本报告期 退租
中信建投 证券	2	30,495,422.63	7.25%	28,842.31	7.82%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

川财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	138,09 0,000.0 0	2.71%	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	678,79 0,000.0 0	13.31%	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	970,73 3,000.0 0	19.03%	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	232,92 5,000.0 0	4.57%	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	157,77 7,000.0 0	3.09%	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	688,56 9,000.0 0	13.50%	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	22,381,6 21.60	100.00%	2,098,8 62,000. 00	41.15%	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	134,92 1,000.0 0	2.65%	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

### 10.8 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	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)2023 年第 4 季度报告	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年01月19日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	同上	2024年01月19日
3	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)2023 年年度报告	同上	2024年03月28日
4	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	同上	2024年03月28日
5	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)2024 年第 1 季度报告	同上	2024年04月19日
6	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	同上	2024年04月19日
7	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF) 更新招募说明书	同上	2024年04月30日
8	关于旗下部分基金调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告	同上	2024年04月30日
9	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF) 基金合同	同上	2024年04月30日
10	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF) 托管协议	同上	2024年04月30日
11	中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2024年06月28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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2024-01-01 至 2024-06-30	61,252,658.57	-	-	61,252,658.57	25.57%
	2	2024-01-25 至 2024-06-30	47,303,216.65	21,021,213.44	15,000,000.00	53,324,430.09	22.26%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于2024年4月30日发布的《关于旗下部分基金调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自2024年5月6日起调整基金份额净值计算精度，并对基金合同等法律文件进行修订。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、(原) 信诚深度价值股票型证券投资基金(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、中信保诚深度价值混合型证券投资基金(LOF) 基金合同
- 4、中信保诚深度价值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

### 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  
2024 年 08 月 29 日