

# 中信保诚至远动力混合型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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 2024 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 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 | 359,183,464.62 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>本基金主要通过分析宏观经济运行状况、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股票。</p> <p>2、股票投资策略</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。

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。

### 3、债券投资策略

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。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。

### 4、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。

### 5、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。

### 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

|                 |  |                 |              |
|-----------------|--|-----------------|--------------|
|                 | <p>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    | 中信保诚至远动力混合 E |
| 下属分级基金的交易代码     | 550015   | 550016          | 014677       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 317,636,950.19 份   | 41,109,301.32 份 | 437,213.11 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（2024 年 07 月 01 日-2024 年 09 月 30 日） |                |              |
|-----------------|--|----------------|--------------|
|                 | 中信保诚至远动力混合 A                           | 中信保诚至远动力混合 C   | 中信保诚至远动力混合 E |
| 1. 本期已实现收益      | -29,010,999.22                         | -6,253,356.16  | -37,665.06   |
| 2. 本期利润         | 81,130,728.68                          | 18,347,336.79  | 110,941.21   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2521                                 | 0.3817         | 0.2613       |
| 4. 期末基金资产净值     | 684,016,680.21                         | 124,830,798.29 | 926,451.11   |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.1535                                 | 3.0366         | 2.1190       |

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

中信保诚至远动力混合 A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 13.47%     | 1.74%         | 13.47%         | 1.14%                 | 0.00%   | 0.60% |
| 过去六个月          | 13.54%     | 1.43%         | 14.22%         | 0.92%                 | -0.68%  | 0.51% |
| 过去一年           | 0.34%      | 1.37%         | 10.44%         | 0.85%                 | -10.10% | 0.52% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | -28.84%    | 1.21%         | -10.15%        | 0.90%                 | -18.69% | 0.31% |

中信保诚至远动力混合 C

| 阶段       | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|----------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月    | 13.37%     | 1.74%         | 13.47%         | 1.14%                 | -0.10%  | 0.60% |
| 过去六个月    | 13.34%     | 1.43%         | 14.22%         | 0.92%                 | -0.88%  | 0.51% |
| 过去一年     | -0.01%     | 1.37%         | 10.44%         | 0.85%                 | -10.45% | 0.52% |
| 自基金合同生效起 | -29.57%    | 1.21%         | -10.15%        | 0.90%                 | -19.42% | 0.31% |

| 中信保诚至远动力混合 E   |            |               |                |                       |         |       |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
| 过去三个月          | 13.30%     | 1.74%         | 13.47%         | 1.14%                 | -0.17%  | 0.60% |
| 过去六个月          | 13.20%     | 1.43%         | 14.22%         | 0.92%                 | -1.02%  | 0.51% |
| 过去一年           | -0.26%     | 1.37%         | 10.44%         | 0.85%                 | -10.70% | 0.52% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | -26.56%    | 1.23%         | -6.77%         | 0.92%                 | -19.79% | 0.31% |

### 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 C



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期        | 离任日期 |        |    |
|    |    |             |      |        |    |

|    |              |                  |   |    |  |
|----|--------------|------------------|---|----|--|
| 王睿 | 权益投资部总监、基金经理 | 2022 年 09 月 19 日 | - | 14 | 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, 中信保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、中信保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、中信保诚至远动力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、中信保诚景气优选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 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，未发现有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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度，A 股及港股市场先抑后扬，主要指数均实现上涨。前两个半月指数一直震荡下行，上证指数一度再次跌破 2700 点；最后两周政策发力，市场大幅反转。整个三季度上证指数上涨 12%，沪深 300 指数上涨 16%，创业板指上涨 29%，同期港股市场亦大幅上涨。季末伴随场外资金入市，市场交易量迅速放大，A 股市场单日成交突破 2.6 万亿。

三季度海外宏观事件较多，中东局势进一步紧张，欧盟选举右翼逆袭，美国大选出现枪击事件等，均

对国内外资本市场产生一定影响；但对全球资本市场和经济走向影响最大的事件在于 9 月美联储降息 50bp，幅度超出了市场的中性预期，也给了国内货币政策一定的扩张空间。

国内三季度经济数据亮点不多，社零、社融等数据有走弱迹象，同时资本市场也显示出较弱的信心，随着指数下跌市场交易量一度跌至 5000 亿以下。9 月 24 日，央行，金管总局，证监会联合召开会议提振市场信心，宣布了针对经济和资本市场未来可能发布的一系列政策，包括降准降息，降低存量房贷和首付比例，创设新的货币政策工具等。这些政策明显有利于支持实体经济，降低社会综合融资成本，扩大内需，释放消费和投资潜力，也明显有助于提振股市流动性和信心。作为积极反应 A 股和港股的主要指数短期均出现了幅度较大的上涨。

三季度本基金维持了之前指定的投资策略，主要的仓位布局在安全边际较高且基本面较稳定的成长龙头和估值较低、基本面存在改善可能的顺周期龙头等方向。随着市场信心被激活，市场单边下行的趋势预计将改变，我们会继续将主要精力放在产业研究和选股上，努力争取把握产业和个股机会，创造超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚至远动力混合 A 份额净值增长率为 13.47%，同期业绩比较基准收益率为 13.47%；中信保诚至远动力混合 C 份额净值增长率为 13.37%，同期业绩比较基准收益率为 13.47%；中信保诚至远动力混合 E 份额净值增长率为 13.30%，同期业绩比较基准收益率为 13.47%。

#### 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   | 726,185,785.22 | 82.14        |
|    | 其中：股票  | 726,185,785.22 | 82.14        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | -              | -            |
|    | 其中：债券  | -              | -            |
|    | 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          | 20,252,000.00  | 2.29   |
|   | 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      | 137,299,426.59 | 15.53  |
| 8 | 其他资产              | 382,166.20     | 0.04   |
| 9 | 合计                | 884,119,378.01 | 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 32,561,833.32 元，占资产净值比例为 4.02%。

## 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              | 590,680,687.15 | 72.94        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 43,029,353.75  | 5.31         |
| J  | 金融业              | 46,535,000.00  | 5.75         |
| 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       | 13,378,911.00  | 1.65         |
| 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               | 693,623,951.90 | 85.66        |

### 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（%） |
|------|---------------|--------------|
| 原材料  | 10,510,362.45 | 1.30         |

|      |               |      |
|------|---------------|------|
| 电信业务 | 22,051,470.87 | 2.72 |
| 合计   | 32,561,833.32 | 4.02 |

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 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  | 600309 | 万华化学 | 450,000   | 41,094,000.00 | 5.07         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 150,000   | 37,783,500.00 | 4.67         |
| 3  | 300316 | 晶盛机电 | 1,000,000 | 32,390,000.00 | 4.00         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 500,000   | 28,545,000.00 | 3.53         |
| 5  | 600487 | 亨通光电 | 1,601,500 | 27,081,365.00 | 3.34         |
| 6  | 002050 | 三花智控 | 1,100,000 | 26,213,000.00 | 3.24         |
| 7  | 002179 | 中航光电 | 600,000   | 26,124,000.00 | 3.23         |
| 8  | 300760 | 迈瑞医疗 | 80,000    | 23,440,000.00 | 2.89         |
| 9  | 600522 | 中天科技 | 1,500,000 | 23,235,000.00 | 2.87         |
| 10 | 600885 | 宏发股份 | 700,000   | 22,785,000.00 | 2.81         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

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   | 129,570.25 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 252,595.95 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 382,166.20 |

### 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                        | 中信保诚至远动力混合 A   | 中信保诚至远动力混合 C  | 中信保诚至远动力混合 E |
|---------------------------|----------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 331,108,595.77 | 46,081,538.79 | 412,175.30   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 317,670.97     | 11,017,113.64 | 25,231.12    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 13,789,316.55  | 15,989,351.11 | 193.31       |
| 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               | 317,636,950.19 | 41,109,301.32 | 437,213.11   |

## § 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

| 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              | 2024-07-01 至<br>2024-09-30 | 189,967,727.8<br>6 | -    | -    | 189,967,727.8<br>6 | 52.89<br>% |
| 个人    | -              | -                          | -                  | -    | -    | -                  | -          |

#### 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

无。

## § 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、中信保诚至远动力混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚至远动力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  
2024 年 10 月 24 日