中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	中信保诚创新成长混合
基金主代码	006392
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 01 月 30 日
报告期末基金份额总额	207,040,132.25 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极投资于具有较高成长性和较强创新能力的上市公司股票，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金主要通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境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各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、港股、债券、现金等大类资产的配置。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。 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或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

	2、股票投资策略 （1）创新成长主题的界定 本基金注重挖掘具备较强创新能力、具备创新可持续性、或具备较高成长性的上市公司。本基金将着重挖掘：能够通过产品创新、服务创新、技术创新、流程创新、管理创新或商业模式创新等方式提升创新能力，从而提升生产运营效率、降低成本、提高产品质量或提升客户服务水平，进而提升长期竞争优势或盈利能力的上市公司；或能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司；同时，本基金还将着重挖掘能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。 1）本基金注重挖掘具备较强创新能力的上市公司。 ①产品创新、服务创新、技术创新：产品创新包括创造某种新产品或对某一新或老产品的功能进行创新。服务创新指使潜在用户感受到不同于从前的崭新内容，包括新的设想、新的技术手段转变成新的或者改进的服务方式。技术创新包括开发新技术，或者将已有的技术进行应用创新。企业通过上述创新方式可以进入蓝海，降低成本、提高产品质量、提高企业生产效率、提升客户服务水平等从而提升企业长期竞争优势和盈利能力。 ②流程创新：包括利用云技术、大数据、机器人、人工智能等技术进行智能化流程改造，提高精准制造和柔性敏捷制造的能力，发展基于互联网的个性化定制、云制造等新型制造模式，从而提升企业制造创新和盈利能力。 ③管理创新：管理创新指企业把新管理方法、管理工具、管理模式、管理制度等要素组合引入企业管理系统以更有效地实现企业的运作，包括引入外部战略投资者、股权激励、制度创新等。企业通过管理创新，可以提升企业运作效率，解放生产力，从而最终提高盈利能力。 ④商业模式创新：指企业创造价值的基本逻辑发生了变化。商业模式的创新通常通过改变收入模式、改变企业模式和改变产业模式进行。改变收入模式包括企业重新定位并更好地满足客户需求从而改善企业收入；改变企业模式包括企业重新定位产业链中的位置，通过垂直整合等方式实现盈利模式的改变；改变产业模式包括企业重新定义本产业，进入或者创造一个新产业，从而使企业具备核心竞争优势。2）本基金注重挖掘具备创新可持续性的上市公司。 本基金重点关注能够通过研发费用投入具备创新可持续性的上市公司。企业能够通过在产品、技术、材料、工艺、标准等方面的研究和投入，改善竞争能力，增强在市场中的话语权和盈利能力。具体而言，本基金将重点关注研发费用每年超过 2

	亿元人民币或研发费用占比销售收入高于 2%的具备较强创新可持续性的上市公司。 3）本基金注重挖掘具备较高成长性的上市公司。 本基金重点关注能够紧跟国家经济结构转型方向、通过内生增长或外延增长等方式从而具有良好发展前景和较强成长能力的上市公司。 ①对于内生增长型公司，这类公司通常资产盈利能力较强，具备内生增长特质。本基金将重点关注在所属行业或细分子行业中主营业务收入增速高于行业平均水平或大于 20%的上市公司，同时将考察其所处行业的竞争格局、业务模式、经营管理效率、未来成长预期及股票的估值水平，从而做出投资判断和决定。 ②对于外延增长型公司，这类公司主要通过并购重组等方式实现经营规模扩张的公司。本基金将通过深入的研究，综合评估并购重组企业的行业增长前景；以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应，包括通过并购重组方式实现公司的经营规模扩张、经营效率改善、利润水平大幅提高等，从而做出投资判断和决定。 （2）个股精选 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。 由于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，因而本基金将在前述股票投资策略的基础上严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。 （3）灵活调整股票资产配置比例 本基金主要通过考量盈利增速与估值的匹配程度来灵活调整股票资产的配置比例。具体而言，本基金将采用沪深 300 指数作为市场的代表性指数，基于上市公司定期报告数据或市场预期数据，计算沪深 300 指数的市场市盈率对盈利增长率的比率（PEG），并以此为基准调整本基金的股票资产比例配置。当沪深 300 指数的 PEG 大于 3 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 0-50%；当沪深 300 指数的 PEG 大于 2 且小于等于 3 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 40%-80%；当沪深 300 指数的 PEG 小于等于 2 时，本基金的股票资产占基金资产的比例为 50%-95%。基金管理人应当自上述条件触发之日的下一工作日起 10 个交易日内将本基金股票资产比例调整至符合上述

	比例范围。 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、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。 6、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。 7、国债期货投资策略 本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。 8、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。

	9、股票期权投资策略 本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。 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。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。 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	中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合财富（总值）指数收益率*15%	
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
下属分级基金的交易代码	006392	016258
报告期末下属分级基金的份额总额	155,641,946.19 份	51,398,186.06 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）	
	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
1.本期已实现收益	24,446,821.23	7,258,418.40
2.本期利润	-106,678,756.28	-33,443,484.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6625	-0.6501

4.期末基金资产净值	496,351,339.46	159,848,913.49
5.期末基金份额净值	3.1891	3.1100

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

中信保诚创新成长混合 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
过去三个月	-17.16%	1.79%	-4.29%	0.63%	-12.87%	1.16%
过去六个月	3.87%	1.80%	-0.87%	0.65%	4.74%	1.15%
过去一年	-4.26%	1.60%	-3.37%	0.62%	-0.89%	0.98%
过去三年	20.28%	1.51%	20.79%	0.65%	-0.51%	0.86%
过去五年	-7.86%	1.41%	6.01%	0.68%	-13.87%	0.73%
过去七年	190.00%	1.49%	20.75%	0.69%	169.25%	0.80%
自基金合同生效起至今	218.91%	1.44%	30.12%	0.69%	188.79%	0.75%

中信保诚创新成长混合 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
过去三个月	-17.29%	1.79%	-4.29%	0.63%	-13.00%	1.16%
过去六个月	3.56%	1.80%	-0.87%	0.65%	4.43%	1.15%
过去一年	-4.83%	1.60%	-3.37%	0.62%	-1.46%	0.98%
过去三年	18.11%	1.51%	20.79%	0.65%	-2.68%	0.86%
自基金合同生效起至今	-7.01%	1.40%	12.82%	0.66%	-19.83%	0.74%

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

中信保诚创新成长混合 A



中信保诚创新成长混合 C



注：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证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债-综合财富（总值）指数收益率*15%。

§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	2019 年 01 月 30 日	-	16	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

2026 年三季度，A 股市场结束了二季度由 AI 产业链主导的单边上行，转入一轮以高估值成长资产的估值压缩为核心特征的调整。报告期内主要宽基指数全线收跌，且呈现明显的结构性特征——上半年涨幅越大、估值越高的板块，本季度回撤越深。从主要指数看，上证指数三季度下跌 6.16%，沪深 300 指数下跌 12.49%，成长与科技属性更强的创业板指、科创 50 指数分别下跌 27.80%和 30.70%。上半年涨幅巨大的科技股在 7 月迅速回落，较高的交易集中度和偏高的杠杆水平加速了下跌过程，电子、通信板块当月跌幅均超过 30%。8 月，科技板块的交易拥挤与去杠杆压力阶段性缓解，市场触底反弹；由于中小市值股票的反弹阻力相对更小，其表现相对占优，7 月跌幅较大的电子、通信板块反弹也更为迅速。9 月，随着美联

储加息预期升温，市场二次探底，创业板与科创板领跌。以 CXO 为代表的医药研发环节，在三季度成为 AI 应用叙事的新落脚点，走出一波较为独立的行情；以银行为代表的红利资产则取得较为明显的绝对收益，相对收益更为突出。整个三季度，融资余额下降超过 4000 亿元，全市场日均成交额从 7 月的约 2.7 万亿元回落至 9 月的约 1.8 万亿元，季末单日成交一度降至 1.4 万亿元左右，量能萎缩十分明显。

三季度较大的外部变量，是美联储重启加息及其引发的全球流动性与估值重定价。美联储于 9 月 16 日议息会议宣布加息 25bp，且政策表述偏鹰。加息落地叠加通胀黏性，推动长端利率进一步大幅上行，至季末，10 年期美债收益率触及约 5.31%，创 2002 年以来最高水平。不过，9 月 30 日公布的美国 8 月 PCE 物价指数同比上涨 3.4%、核心同比上涨 3.0%，均低于市场预期，加息定价随之边际回落。从外围市场的表现看，海外投资者对长期高利率环境的定价已较为充分。

国内三季度总量平稳放缓，结构继续分化，呈现“生产稳、出口强、投资弱、消费平”的态势。8 月装备制造业增加值同比增长 12.1%、高技术制造业增长 16.7%，锂电、机器人、AI 算力等新兴产业高速增长；与此同时，投资端持续承压，其中 1—8 月房地产投资同比降幅接近 20%，新房销售降幅超过 10%。7 月 30 日中央政治局会议明确要求“加大逆周期调节力度”，至季度末，已有 PSL 利率下调、科技创新再贷款增加、房贷利率贴息、新型政策性金融工具全面投放等多项举措陆续落地。

目前，市场倾向于把大部分资产简单划分为科技和非科技两大类。科技资产正处在人工智能产业浪潮驱动的景气上行周期中，二、三季度整个科技板块快速经历了从泡沫化到估值回归的过程。我们认为，人工智能作为一种划时代的生产力，其产业发展远未看到终结迹象，是值得长期跟踪研究的方向。目前市场关注较多的集中在前期基础设施建设环节。随着算力设施总规模不断扩大，我们将更为关注算力资本开支的增速是否会放缓——这直接决定了算力相关标的是否仍应适用成长股的投资范式。毕竟，目前板块整体估值（PB）已处于较高位置，缺乏明确的安全边际，而 ROE 的高位能否维持，也取决于资本开支的持续性。我们接下来对科技股的选择会更加审慎，对业绩增长质量的要求也会更高。非科技板块整体估值不高，部分板块的 PB 水平甚至已降至过去十年相对较低的位置，或具备较高的安全边际；对于其中一部分可能出现盈利拐点的板块，或有较大可能提供超额收益。

过去一个季度，我们从安全边际和预期回报的角度出发，在科技与非科技领域进行了相对均衡的配置，并根据板块预期回报率的变化小幅动态调整。科技板块中，我们认为国产算力基础设施建设接下来可能有更大的增长空间；同时，一些新的技术方向，如 CPO（光电共封装）、玻璃基板等，也值得中长期重视。非科技板块中，化工、工程机械、新能源、非银金融的估值与增长匹配度相对较高，且均具备相对较高的安

全边际，逆周期调节的加强有可能成为这类资产估值修复的催化剂。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚创新成长混合 A 份额净值增长率为-17.16%，同期业绩比较基准收益率为-4.29%；中信保诚创新成长混合 C 份额净值增长率为-17.29%，同期业绩比较基准收益率为-4.29%。

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	606,389,641.30	92.11
	其中：股票	606,389,641.30	92.11
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	-	-
	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	51,268,369.87	7.79
8	其他资产	648,664.26	0.10
9	合计	658,306,675.43	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 69,399,823.32 元，占资产净值比例为 10.58%。

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	11,179,069.96	1.70
C	制造业	441,896,898.20	67.34
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	51,133,507.82	7.79
J	金融业	32,774,000.00	4.99
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,342.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	536,989,817.98	81.83

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（%）
工业	7,760,116.80	1.18
信息科技	43,140,755.52	6.57
电信业务	18,498,951.00	2.82
合计	69,399,823.32	10.58

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	300750	宁德时代	110,000	32,022,100.00	4.88
2	000425	徐工机械	4,000,000	28,800,000.00	4.39
3	688825	长鑫科技	554,958	28,655,426.88	4.37
4	00981	中芯国际	520,000	27,072,849.96	4.13
5	688041	海光信息	100,000	22,680,000.00	3.46

6	000680	山推股份	2,300,000	20,838,000.00	3.18
7	000977	浪潮信息	299,940	19,775,044.20	3.01
8	000792	盐湖股份	800,000	19,064,000.00	2.91
9	689009	九号公司	500,000	18,550,000.00	2.83
10	00700	腾讯控股	50,000	18,498,951.00	2.82

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均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	208,075.39
2	应收证券清算款	225,826.60
3	应收股利	197,201.43
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,560.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	648,664.26

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	4,192,404.15	0.64	锁定期股票

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	中信保诚创新成长混合 A	中信保诚创新成长混合 C
报告期期初基金份额总额	169,355,560.57	51,510,005.75
报告期期间基金总申购份额	1,480,862.70	42,669.39
减：报告期期间基金总赎回份额	15,194,477.08	154,489.08
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	155,641,946.19	51,398,186.06

§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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

者类别	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	2026-07-01 至 2026-09-30	50,264,855.29	-	-	50,264,855.29	24.28%
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

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、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件

2、中信保诚基金管理有限公司营业执照

3、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同

4、中信保诚创新成长灵活配置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。

中信保诚基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日