中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2025 年年度报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 30 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。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2026 年 03 月 27 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。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 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 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
4.9 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 17
§5 托管人报告 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
§6 审计报告 17
6.1 审计报告基本信息 17
6.2 审计报告的基本内容 18
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 50
8.1 期末基金资产组合情况 50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
8.3 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 51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56

8.6 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 56
8.7 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 57
8.8 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 57
8.9 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 57
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
8.12 投资组合报告附注 57
§9 基金份额持有人信息 58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
9.2 期末上市基金前十名持有人 59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
9.4 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 59
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 59
§10 开放式基金份额变动 60
§11 重大事件揭示 60
11.1 基金份额持有人大会决议 60
11.2 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 60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
11.4 基金投资策略的改变 60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 61
11.8 其他重大事件 63
§12 影响投资者决策的其他重要信息 64
12.1 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 64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 64
§13 备查文件目录 64
13.1 备查文件目录 64
13.2 存放地点 64
13.3 查阅方式 64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	中信保诚鼎利混合(LOF)	
场内简称	中信保诚鼎利 LOF	
基金主代码	165528	
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)	
基金合同生效日	2016 年 05 月 24 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	26,766,661.57 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	2016 年 08 月 31 日	
下属分级基金的基金简称	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C
下属分级基金场内简称	中信保诚鼎利 LOF	-
下属分级基金的交易代码	165528	015937
报告期末下属分级基金的份额总额	22,548,973.27 份	4,217,688.30 份

2.2 基金产品说明

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投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。
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。 本基金在进行个股筛选时,将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司：1）定性分析：根据对行业的发展情况和盈利状况的判断，从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2）定量分析：主要

	考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备选成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等； ROE、ROIC、毛利率、净利率等； PE、PEG、PB、PS 等。 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。 5、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。 6、资产支持证券投资策略 对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。 7、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。
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，属于较高风险、较高预期收益的品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	郭明
	联系电话	021-68649788	010-66105799
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0066	95588
传真		021-50120895	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 16 号 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	涂一锴	廖林

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	
	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C
本期已实现收益	16,106,618.04	3,169,993.66	588,580.42	256,121.16	-30,661,657.06	-18,497,929.37
本期利润	20,714,717.44	3,223,487.02	4,316,814.64	361,130.03	-24,095,927.53	-24,191,228.40
加权平均基金份额本期利润	0.7243	0.4445	0.0767	0.0230	-0.3264	-0.9134
本期加权平均净值利润率	51.58%	33.26%	7.38%	2.22%	-26.74%	-74.21%
本期基金份额净值增长率	61.32%	60.36%	10.94%	10.27%	-6.95%	-7.54%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C
期末可供分配利润	18,846,861.19	3,367,608.78	6,316,702.24	1,992,031.26	6,776,279.86	2,396,627.19
期末可供分配基金份额	0.8358	0.7984	0.2007	0.1825	0.0823	0.0724

利润						
期末基金资产净值	43,677,805.81	7,997,486.47	37,788,407.19	12,909,271.91	89,104,775.12	35,517,924.16
期末基金份额净值	1.9370	1.8962	1.2007	1.1825	1.0823	1.0724
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C
基金份额累计净值增长率	93.70%	60.50%	20.07%	0.09%	8.23%	-9.23%

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

中信保诚鼎利混合(LOF)A

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
过去三个月	0.99%	2.72%	0.22%	0.47%	0.77%	2.25%
过去六个月	73.69%	3.07%	8.40%	0.45%	65.29%	2.62%
过去一年	61.32%	2.49%	9.19%	0.47%	52.13%	2.02%
过去三年	66.54%	2.05%	17.98%	0.52%	48.56%	1.53%
过去五年	26.85%	1.97%	7.02%	0.56%	19.83%	1.41%
自基金合同生效起至今	93.70%	1.57%	54.21%	0.57%	39.49%	1.00%

中信保诚鼎利混合(LOF)C

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
过去三个月	0.84%	2.72%	0.22%	0.47%	0.62%	2.25%
过去六个月	73.17%	3.07%	8.40%	0.45%	64.77%	2.62%
过去一年	60.36%	2.49%	9.19%	0.47%	51.17%	2.02%
过去三年	63.49%	2.05%	17.98%	0.52%	45.51%	1.53%
自基金合同生效起至今	60.50%	2.07%	14.14%	0.53%	46.36%	1.54%

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

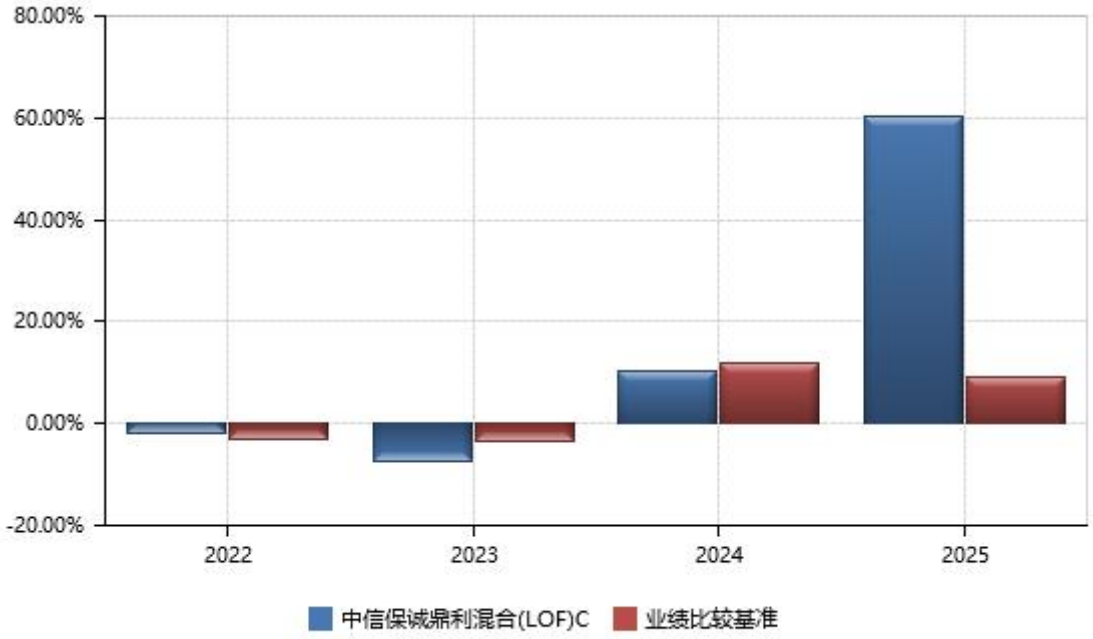
中信保诚鼎利混合(LOF)A

中信保诚鼎利混合(LOF)C

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信保诚鼎利混合(LOF)A

中信保诚鼎利混合(LOF)C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§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，本基金管理人于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”更名为“中信保诚基金管理有限公司”。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人管理的运作中的基金为 92 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）、中信保诚中证基建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、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智惠金货币市场基金、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、中信保诚 90 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚周期优选混合型发起式证券投资基金、中信保诚红利领航量化选股股票型证券投资基金、中信保诚乾元 30 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中信保诚汇利债券型证券投资基金、中信保诚中证 A500 指数增强型证券投资基金、中信保诚消费机遇混合型发起式证券投资基金、中信保诚稳和利率债债券型证券投资基金、中信保诚医药精选混合型发起式证券投资基金。

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		
吴振华	基金经理	2022 年 01 月 05 日	-	9	吴振华先生，管理学硕士。历任埃森哲（中国）有限公司分析师，中国证券登记结算有限责任公司工程师，方正证券研究所研究员。2017 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任研究员。现任中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚新机遇混合型证券投资基

					金（LOF）、中信保诚成长动力混合型证券投资基金的基金经理。

注：1.吴振华于 2026 年 3 月 26 日起离任本基金基金经理，杨柳青于 2026 年 3 月 26 日起担任本基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，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》,公司已制订公平交易及异常交易管理相关规定作为开展公平交易管理的规则指引，所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，包括境内上市股票、债券的一级市场申购、 二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

在实际的公平交易管理贯彻落实中采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括：健全投资授权制度，设立防火墙，确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；同时搭建了合理的资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。建立投资备选库、交易对手备选库、基金风格维度库，制定明确的备选库建立、维护程序；规范一、二级市场投资要求及交易流程。事中监控主要包括：公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，对于满足条件的指令，系统自动通过公平交易模块执行，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；严格控制同日反向交易，如因流动性或投资策略等原因需要反向交易的，需经过内部审批并留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价，

并建立公平分配机制。事后管理主要包括：定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近日反向交易进行统计分析。同时，合规或内部审计人员会对公平交易的执行情况做定期检查，相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅，签字确认。

4.3.2 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。

4.3.3 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 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

2025 年中国权益市场整体呈现较为明显的上涨态势，主要指数取得正收益。其中，上证指数、沪深 300 分别上涨 18.4%和 17.7%；创业板指和科创 50 指数分别上涨了 49.6%和 35.9%。分季度看，一季度市场平稳开局，指数温和上涨，各种机会涌现；4 月初美国对全球加征关税，指数出现大幅下探，此后市场恢复上升趋势，指数出现了较为持续和强劲的反弹，持续到三季度末，在此过程中

AI 算力建设相关的科技股涨幅较大；四季度市场区间震荡，成长股出现回调，有色化工为代表的周期股和价值股上涨明显。港股全年也出现了明显上涨行情，恒生指数和恒生科技分别上涨了 27.8%和 23.5%。

分季度来看，一季度，产品采用在大科技方向上均衡配置，重点布局了半导体、通信、计算机等行业；二季度，随着海外算力的高速增长，产品重点布局了相关的电子、通信板块公司；三季度，随着海外算力持续发酵，继续重点布局相关的电子、通信板块龙头公司；四季度，随着国产 AI 模型的发展，国内供应链应声而起，重点布局了相关的电子、通信板块龙头公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚鼎利混合(LOF)A 份额净值增长率为 61.32%，同期业绩比较基准收益率为 9.19%；中信保诚鼎利混合(LOF)C 份额净值增长率为 60.36%，同期业绩比较基准收益率为 9.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，我国经济延续稳中有进发展态势，全年 GDP 同比增长 5%。展望 2026 年，我国经济基础稳、优势多、韧性强、潜能大，长期向好的支撑条件和基本趋势没有变，但仍存在供强需弱等挑战，预计全年经济增速在 4.5%~5%，我们将对 2026 年两会期间可能制定的经济增长目标和相关财政、货币政策保持关注。

2025 年，多数发达国家延续降息周期，美联储全年降息 75bps；我国央行实施适度宽松的货币政策，下调政策利率、结构性货币政策工具利率和个人住房公积金贷款利率，有力支持降低社会综合融资成本。展望 2026 年，我们预计国内继续实施适度宽松的货币政策，灵活高效运用降准降息等多种政策工具，发挥货币政策工具总量和结构双重功能，加强对扩大内需、科技创新的金融支持；美联储降息节奏和幅度仍存在不确定性，将关注新任美联储主席是否调整货币政策决策机制。相对宏观流动性的变化，我们更关注居民储蓄进入基本市场的节奏和传导路径对资产定价可能带来的影响。

2025 年，市场风险偏好发生较大波动，4 月初经贸摩擦给市场带来了较大调整，但资本市场体现了较强韧性，市场整体定价较快修复，年末市场风险偏好较年初有明显提升。展望 2026 年，我们预计风险偏好进一步提升的空间较 2025 年或边际减少，且受风险事件扰动的影响较 2025 年或边际放大，我们关注 AI、人形机器人、商业航天等与经济周期脱敏的新兴产业趋势变化，以及资本市场监管、地缘风险事件等对市场风险偏好带来的影响。

从市场整体定价水平来看，以沪深 300 指数为例，市净率分位数已来到过去 5 年中高位数的水平，面临相对不对称的上下行风险条件；后续市场定价的运行方向，或取决于基本面、流动性和风

险偏好的综合影响，波动率较 2025 年或边际放大。

展望 2026 年，我们将继续重点跟踪大科技方向，并关注以下几个机遇：1）全球 AI 新技术的发展趋势以及相关供应链机会；2）国内 AI 大模型快速发展迭代背景下的国产化机会。同时也将积极关注年报披露后可能产生的新的结构性投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管要求，将保护基金份额持有人的合法权益放在首位，继续致力于完善公司内部控制机制与合规管理体系，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求，结合公司业务发展实际情况推进公司内控制度建设，完善公司内控制度体系；对产品合同及各类法律文书进行审核；对基金募集、投资过程进行合规检查与提示，规范公司运作与所管理的各类投资组合运作过程中的关联交易，防范不正当关联交易和利益输送，防范内幕交易和利用未公开信息交易，切实维护基金份额持有人、股东和本公司的合法权益；完成各项法定信息披露工作及文档合规检查；开展合规培训、合规咨询、更新法规汇编；根据监管部门要求完成各项反洗钱工作，贯彻落实反洗钱监管要求；依法依规完成向监管部门的各项数据报送工作等。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、审慎勤勉的原则管理和运用基金资产，继续加强公司内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。估值委员会由主管运营的公司领导、投资、研究、会计和风控等岗位资深人员组成。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，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程人员均具备相应的专业胜任能力及相关工作经历。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。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。

4.8 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。

4.9 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

本基金自 2025 年 2 月 28 日至 2025 年 8 月 15 日基金资产净值低于五千万元，已经连续 60 个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行报告并提交了解决方案。截至本报告期末，本基金资产净值已不低于五千万元。

自 2025 年 5 月 29 日至 2025 年 8 月 18 日，本基金如涉及信息披露费、审计费、持有人大会费用、银行间账户维护费、注册登记费等固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

§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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内,本基金的管理人--中信保诚基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中信保诚基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P02244 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务

	报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)不能持续经营。

	(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	史曼　　孙碧薇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2026 年 03 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	4,527,600.68	5,052,900.74
结算备付金		86,464.09	383,642.06
存出保证金		33,435.62	76,547.68
交易性金融资产	7.4.7.2	46,822,079.38	45,546,316.50
其中：股票投资		46,822,079.38	45,546,316.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		1,637,647.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		33,221.74	2,245.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		53,140,449.18	51,061,652.08
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		991,034.35	-
应付赎回款		273,946.74	3,756.88
应付管理人报酬		53,835.10	51,776.83
应付托管费		8,972.50	8,629.50
应付销售服务费		4,420.34	6,675.22
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	7.4.7.6	132,947.87	293,134.55
负债合计		1,465,156.90	363,972.98
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	26,766,661.57	42,388,945.60
未分配利润	7.4.7.8	24,908,630.71	8,308,733.50
净资产合计		51,675,292.28	50,697,679.10
负债和净资产总计		53,140,449.18	51,061,652.08

注：截止本报告期末，基金份额总额 26,766,661.57 份。其中：中信保诚鼎利混合(LOF)A 的基金份额净值 1.9370 元，基金份额总额 22,548,973.27 份；中信保诚鼎利混合(LOF)C 的基金份额净值 1.8962 元，基金份额总额 4,217,688.30 份。

7.2 利润表

会计主体：中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		24,791,678.13	6,029,020.37
1.利息收入		23,335.16	133,191.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	22,186.04	67,662.61
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		1,149.12	65,528.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,932,768.83	2,000,952.29
其中：股票投资收益	7.4.7.10	19,675,659.64	1,106,596.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	47,108.46	147,122.95

资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	210,000.73	747,233.01
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	4,661,592.76	3,833,243.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	173,981.38	61,633.89
减：二、营业总支出		853,473.67	1,351,075.70
1．管理人报酬		600,438.90	899,778.58
2．托管费		100,073.17	149,963.13
3．销售服务费		58,473.83	98,448.99
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	7.4.7.17	-	-
7．税金及附加		0.09	-
8．其他费用	7.4.7.18	94,487.68	202,885.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,938,204.46	4,677,944.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,938,204.46	4,677,944.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,938,204.46	4,677,944.67

7.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	42,388,945.60	8,308,733.50	50,697,679.10
二、本期期初净资产	42,388,945.60	8,308,733.50	50,697,679.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,622,284.03	16,599,897.21	977,613.18
（一）、综合收益总额	-	23,938,204.46	23,938,204.46
（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）	-15,622,284.03	-7,338,307.25	-22,960,591.28
其中：1.基金申购款	28,664,544.48	20,421,906.14	49,086,450.62
2.基金赎回款	-44,286,828.51	-27,760,213.39	-72,047,041.90
（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	26,766,661.57	24,908,630.71	51,675,292.28
项目	**上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	115,449,792.23	9,172,907.05	124,622,699.28
二、本期期初净资产	115,449,792.23	9,172,907.05	124,622,699.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-73,060,846.63	-864,173.55	-73,925,020.18
（一）、综合收益总额	-	4,677,944.67	4,677,944.67
（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）	-73,060,846.63	-5,542,118.22	-78,602,964.85
其中：1.基金申购款	11,717,392.88	1,003,532.00	12,720,924.88
2.基金赎回款	-84,778,239.51	-6,545,650.22	-91,323,889.73
（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	42,388,945.60	8,308,733.50	50,697,679.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)是根据《信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，由原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转型而来。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金为契约型基金，封闭期是 2016 年 5 月 24 日(基金合同生效日)起至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日的期间。封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。2017 年 11 月 24 日封闭期届满后，信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。自 2017 年 11 月 27 日起,原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金更名为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型开放式，存续期限不定。原信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,236,504,477.82 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)，基金托管

人为中国工商银行股份有限公司。

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。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2016]第 573 号文审核同意，本基金 408,791,677.00 份基金份额于 2016 年 8 月 31 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。

根据本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2022 年 6 月 9 日发布的《关于旗下信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)增加 C 类基金份额、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》以及修改后的《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》，自 2022 年 6 月 9 日起，本基金增设 C 类基金份额，原有基金份额转为 A 类基金份额。其中，在投资人申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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》、深圳证券交易所(以下简称“深交所”)关于基金证券简称相关规则的规定及基金合同的约定，信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)于 2023 年 9 月 12 日公告后更名为中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》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含(中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。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。基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本

基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，

分类为以摊余成本计量的金融资产：

-本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

-该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融

负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情

况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计

期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，封闭期内，本基金的收益分配每年不得少于一次，且年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的 90%。本基金转换为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；封闭期内，本基金的收益分配方式为现金分红；本基金转为信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)后，登记在登记结算系统的基金份额，收益分配方式为现金分红或红利再投资，登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于

面值；即基金收益分配基准日的该类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于基金费用的不同，可能导致 A 类基金份额和 C 类基金份额之间在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6 号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《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]140 号《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《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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(3)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，暂不计缴企业所得税。

(4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所

挂牌交易的上市公司限售股，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

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	4,527,600.68	5,052,900.74
等于：本金	4,527,140.21	5,052,378.59
加：应计利息	460.47	522.15
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	4,527,600.68	5,052,900.74

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		38,564,550.75	-	46,822,079.38	8,257,528.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		38,564,550.75	-	46,822,079.38	8,257,528.63
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		41,950,380.63	-	45,546,316.50	3,595,935.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		41,950,380.63	-	45,546,316.50	3,595,935.87

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	31.25	0.20
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	58,616.62	118,834.35
其中：交易所市场	58,616.62	118,834.35
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	15,000.00	45,000.00
应付信息披露费	50,000.00	120,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
其他	300.00	300.00
合计	132,947.87	293,134.55

7.4.7.7 实收基金

中信保诚鼎利混合(LOF)A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,471,704.95	31,471,704.95
本期申购	13,775,224.67	13,775,224.67
本期赎回（以“-”号填列）	-22,697,956.35	-22,697,956.35
本期末	22,548,973.27	22,548,973.27

中信保诚鼎利混合(LOF)C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,917,240.65	10,917,240.65
本期申购	14,889,319.81	14,889,319.81
本期赎回（以“-”号填列）	-21,588,872.16	-21,588,872.16
本期末	4,217,688.30	4,217,688.30

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：

单位：份

		本报告期末		上年度末	
基金代码	基金名称	场内	场外	场内	场外
165528	中信保诚鼎利混合（LOF）A	4,803,259.00	17,745,714.27	5,996,422.00	25,475,282.95
015937	中信保诚鼎利混合（LOF）C	-	4,217,688.30	-	10,917,240.65

7.4.7.8 未分配利润

中信保诚鼎利混合(LOF)A

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	8,256,949.25	-1,940,247.01	6,316,702.24

本期期初	8,256,949.25	-1,940,247.01	6,316,702.24
本期利润	16,106,618.04	4,608,099.40	20,714,717.44
本期基金份额交易产生的变动数	-5,516,706.10	-385,881.04	-5,902,587.14
其中：基金申购款	5,903,057.00	3,439,085.50	9,342,142.50
基金赎回款	-11,419,763.10	-3,824,966.54	-15,244,729.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,846,861.19	2,281,971.35	21,128,832.54

中信保诚鼎利混合(LOF)C

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	2,669,904.39	-677,873.13	1,992,031.26
本期期初	2,669,904.39	-677,873.13	1,992,031.26
本期利润	3,169,993.66	53,493.36	3,223,487.02
本期基金份额交易产生的变动数	-2,472,289.27	1,036,569.16	-1,435,720.11
其中：基金申购款	6,548,579.89	4,531,183.75	11,079,763.64
基金赎回款	-9,020,869.16	-3,494,614.59	-12,515,483.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,367,608.78	412,189.39	3,779,798.17

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	20,788.31	51,040.37
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	1,232.82	14,833.80
其他	164.91	1,788.44
合计	22,186.04	67,662.61

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	381,180,602.18	819,691,814.96
减：卖出股票成本总额	360,930,206.37	816,974,590.07
减：交易费用	574,736.17	1,610,628.56

买卖股票差价收入	19,675,659.64	1,106,596.33

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益--利息收入	63.42	107,270.55
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	47,045.04	39,852.40
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	47,108.46	147,122.95

7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	420,181.79	88,481,228.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	370,980.00	86,941,298.60
减：应计利息总额	2,148.03	1,500,077.85
减：交易费用	8.72	-
买卖债券差价收入	47,045.04	39,852.40

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.13.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	210,000.73	747,233.01
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	210,000.73	747,233.01

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	4,661,592.76	3,833,243.09
--股票投资	4,661,592.76	3,837,903.09
--债券投资	-	-4,660.00
--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	4,661,592.76	3,833,243.09

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	171,160.49	61,454.11
转换费收入	2,820.89	179.78
合计	173,981.38	61,633.89

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	15,000.00	45,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	613.00	685.00
账户维护费	27,943.02	36,000.00
其他	931.66	1,200.00
合计	94,487.68	202,885.00

注：本基金处于“迷你基金”期间的信息披露费、审计费、持有人大会费用、银行间账户维护费、注册登记费等固定费用由本基金的基金管理人承担。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
Prudential Corporation Holdings Limited（保诚集团股份有限公司）	基金管理人的股东
上海信诚致远资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

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。

“中信信诚资产管理有限公司”于 2025 年 2 月 10 日完成工商变更登记，更名为“上海信诚致远资产管理有限公司”。

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

7.4.10.1.6 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	600,438.90	899,778.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	269,085.01	291,925.23
应支付基金管理人的净管理费	331,353.89	607,853.35

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的管理人报酬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。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的托管费	100,073.17	149,963.13

注：支付基金托管人中国工商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。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C	合计
中信保诚基金管理有限公司	-	227.06	227.06
合计	-	227.06	227.06

注：本基金中信保诚鼎利混合(LOF)A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚鼎利混合(LOF)C 基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

中信保诚鼎利混合(LOF)C 的销售服务费按前一日中信保诚鼎利混合(LOF)C 资产净值的 0.60%年费率计提。

计算公式为：中信保诚鼎利混合(LOF)C 基金日销售服务费=中信保诚鼎利混合(LOF)C 基金份额前一日资产净值×0.60%/当年天数

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,527,600.68	20,788.31	5,052,900.74	51,040.37

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末 2025 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025年12月19日	筹划重大事项	283.75	2026年01月05日	278.00	14,359	4,149,317.45	4,074,366.25	-

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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的各类重大风险，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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。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以控制相应的信用风险。 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。

7.4.13.2.1 按短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短期债券投资。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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》等法规的要求建立了流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，并通过对基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值等指标进行监控，以及定期开展压力测试等方式防范流动性风险。

本基金投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所或者银行间同业市场交易，除在期末本基金持有的流通受限证券章节部分所列示券种暂时受限制不能自由转让以外，其余均能及时变现。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。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	4,527,600.68	-	-	-	-	-	4,527,600.68
结算备付金	86,464.09	-	-	-	-	-	86,464.09
存出保证金	33,435.62	-	-	-	-	-	33,435.62
交易性金融资产	-	-	-	-	-	46,822,079.38	46,822,079.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,637,647.67	1,637,647.67
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	33,221.74	33,221.74
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,647,500.39	-	-	-	-	48,492,948.79	53,140,449.18
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	-	-	-	-	-	991,034.35	991,034.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	273,946.74	273,946.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,835.10	53,835.10
应付托管费	-	-	-	-	-	8,972.50	8,972.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,420.34	4,420.34
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	-	-	-	-	-	132,947.87	132,947.87
负债总计	-	-	-	-	-	1,465,156.90	1,465,156.90
利率敏感度缺口	4,647,500.39	-	-	-	-	47,027,791.89	51,675,292.28
上年度末 2024 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	5,052,900.74	-	-	-	-	-	5,052,900.74
结算备付金	383,642.06	-	-	-	-	-	383,642.06
存出保证金	76,547.68	-	-	-	-	-	76,547.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	45,546,316.50	45,546,316.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,245.10	2,245.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,513,090.48	-	-	-	-	45,548,561.60	51,061,652.08
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	-	-	-	-	-	3,756.88	3,756.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,776.83	51,776.83
应付托管费	-	-	-	-	-	8,629.50	8,629.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,675.22	6,675.22
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	-	-	-	-	-	293,134.55	293,134.55
负债总计	-	-	-	-	-	363,972.98	363,972.98
利率敏感度缺口	5,513,090.48	-	-	-	-	45,184,588.62	50,697,679.10

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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,并运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	46,822,079.38	90.61	45,546,316.50	89.84
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	46,822,079.38	90.61	45,546,316.50	89.84

7.4.13.4.3.2 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(2025 年 12 月 31 日)	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	4,472,419.55	2,486,992.67
	业绩比较基准中的股票指	-4,472,419.55	-2,486,992.67

	数下降 5%		

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	42,747,713.13	45,546,316.50
第二层次	4,074,366.25	-
第三层次	-	-
合计	46,822,079.38	45,546,316.50

7.4.14.2.2 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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 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)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	46,822,079.38	88.11
	其中：股票	46,822,079.38	88.11
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	4,614,064.77	8.68
8	其他各项资产	1,704,305.03	3.21
9	合计	53,140,449.18	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	43,266,471.73	83.73
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	3,555,607.65	6.88
J	金融业	-	-
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	-	-
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	46,822,079.38	90.61

8.2.2 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。

8.3 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	300502	新易盛	11,600	4,998,208.00	9.67
2	300308	中际旭创	8,100	4,941,000.00	9.56
3	002371	北方华创	9,645	4,427,826.60	8.57
4	688012	中微公司	14,359	4,074,366.25	7.88
5	688256	寒武纪	2,623	3,555,607.65	6.88
6	688313	仕佳光子	38,510	3,418,917.80	6.62
7	600183	生益科技	45,100	3,220,591.00	6.23
8	300394	天孚通信	14,600	2,964,238.00	5.74
9	603986	兆易创新	13,700	2,935,225.00	5.68
10	688072	拓荆科技	8,643	2,852,190.00	5.52
11	002463	沪电股份	38,900	2,842,423.00	5.50
12	601138	工业富联	24,800	1,538,840.00	2.98
13	300604	长川科技	11,600	1,175,196.00	2.27
14	002222	福晶科技	19,200	1,081,728.00	2.09
15	688498	源杰科技	1,644	1,055,431.56	2.04
16	603083	剑桥科技	2,600	349,388.00	0.68
17	688385	复旦微电	4,259	313,888.30	0.61
18	688630	芯碁微装	2,307	310,360.71	0.60
19	688041	海光信息	1,165	261,437.65	0.51
20	601869	长飞光纤	2,200	255,992.00	0.50
21	688401	路维光电	5,106	249,223.86	0.48

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	688256	寒武纪	15,137,655.70	29.86
2	002916	深南电路	12,344,103.60	24.35
3	300476	胜宏科技	11,667,803.00	23.01
4	688041	海光信息	10,786,705.02	21.28
5	688012	中微公司	10,368,168.42	20.45
6	300394	天孚通信	10,347,781.00	20.41
7	603228	景旺电子	10,061,994.40	19.85
8	002463	沪电股份	9,880,310.00	19.49
9	600183	生益科技	9,678,042.00	19.09
10	688313	仕佳光子	9,130,313.66	18.01
11	002371	北方华创	9,036,806.00	17.82
12	688347	华虹公司	7,930,782.28	15.64
13	603986	兆易创新	7,516,046.40	14.83
14	601138	工业富联	6,697,216.00	13.21
15	688072	拓荆科技	6,554,818.34	12.93
16	600941	中国移动	6,276,064.00	12.38
17	688037	芯源微	6,272,181.70	12.37
18	688205	德科立	6,185,882.86	12.20
19	300502	新易盛	5,809,090.00	11.46
20	002475	立讯精密	5,168,963.00	10.20
21	300408	三环集团	4,752,520.00	9.37
22	688981	中芯国际	4,688,551.60	9.25
23	688678	福立旺	4,344,963.22	8.57
24	603083	剑桥科技	4,058,580.00	8.01
25	300308	中际旭创	4,024,501.00	7.94
26	300475	香农芯创	3,941,079.00	7.77
27	300570	太辰光	3,598,293.00	7.10
28	300442	润泽科技	3,495,887.00	6.90
29	600050	中国联通	3,451,940.00	6.81
30	002384	东山精密	3,399,712.00	6.71
31	603019	中科曙光	3,347,143.00	6.60
32	001309	德明利	3,318,037.00	6.54
33	002600	领益智造	3,171,954.00	6.26
34	002947	恒铭达	3,129,869.00	6.17
35	300433	蓝思科技	3,099,941.00	6.11
36	601728	中国电信	3,081,131.00	6.08
37	688120	华海清科	2,926,726.29	5.77
38	688099	晶晨股份	2,854,424.31	5.63

39	688596	正帆科技	2,690,514.73	5.31
40	688385	复旦微电	2,634,879.52	5.20
41	688183	生益电子	2,510,327.76	4.95
42	688498	源杰科技	2,482,181.20	4.90
43	300548	长芯博创	2,467,435.00	4.87
44	600584	长电科技	2,389,182.00	4.71
45	300604	长川科技	2,344,763.00	4.62
46	600418	江淮汽车	2,325,111.00	4.59
47	688111	金山办公	2,247,205.39	4.43
48	688123	聚辰股份	2,224,572.59	4.39
49	002837	英维克	2,217,474.00	4.37
50	601689	拓普集团	2,210,853.90	4.36
51	002050	三花智控	2,204,379.00	4.35
52	002126	银轮股份	2,165,587.20	4.27
53	688213	思特威	2,113,941.06	4.17
54	688525	佰维存储	1,993,483.90	3.93
55	603893	瑞芯微	1,957,505.00	3.86
56	688484	南芯科技	1,930,704.68	3.81
57	688200	华峰测控	1,874,654.35	3.70
58	688627	精智达	1,784,924.24	3.52
59	688228	开普云	1,737,030.51	3.43
60	001389	广合科技	1,725,160.00	3.40
61	002130	沃尔核材	1,695,484.00	3.34
62	002938	鹏鼎控股	1,644,825.00	3.24
63	301489	思泉新材	1,610,342.00	3.18
64	002965	祥鑫科技	1,510,927.00	2.98
65	688766	普冉股份	1,499,492.33	2.96
66	300373	扬杰科技	1,494,762.00	2.95
67	688279	峰岹科技	1,486,131.51	2.93
68	300857	协创数据	1,467,651.00	2.89
69	002850	科达利	1,452,008.00	2.86
70	301308	江波龙	1,437,254.00	2.83
71	688381	帝奥微	1,433,907.99	2.83
72	601231	环旭电子	1,388,012.00	2.74
73	688249	晶合集成	1,354,608.73	2.67
74	002484	江海股份	1,325,670.00	2.61
75	002273	水晶光电	1,289,921.00	2.54
76	002222	福晶科技	1,281,412.00	2.53
77	688362	甬矽电子	1,276,468.54	2.52
78	600686	金龙汽车	1,210,758.00	2.39
79	688300	联瑞新材	1,197,596.18	2.36

80	688234	天岳先进	1,193,384.83	2.35
81	002929	润建股份	1,172,629.00	2.31
82	688608	恒玄科技	1,169,678.35	2.31
83	688018	乐鑫科技	1,136,747.16	2.24
84	688025	杰普特	1,118,706.93	2.21
85	688691	灿芯股份	1,069,567.03	2.11
86	688220	翱捷科技	1,018,845.94	2.01
87	688401	路维光电	1,018,144.57	2.01

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。

8.4.2 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	688256	寒武纪	15,148,454.33	29.88
2	002916	深南电路	13,374,360.20	26.38
3	300476	胜宏科技	12,984,908.00	25.61
4	688041	海光信息	12,015,289.88	23.70
5	688347	华虹公司	10,206,840.82	20.13
6	600183	生益科技	9,991,662.20	19.71
7	603228	景旺电子	9,974,191.00	19.67
8	300394	天孚通信	9,537,978.00	18.81
9	002463	沪电股份	9,486,315.30	18.71
10	600941	中国移动	8,774,429.01	17.31
11	601138	工业富联	8,168,414.95	16.11
12	002371	北方华创	7,745,412.00	15.28
13	688981	中芯国际	7,071,565.04	13.95
14	688037	芯源微	6,737,891.85	13.29
15	300408	三环集团	6,667,219.00	13.15
16	688313	仕佳光子	6,339,189.23	12.50
17	688012	中微公司	6,170,355.91	12.17
18	002475	立讯精密	5,818,608.00	11.48
19	688205	德科立	5,718,248.99	11.28
20	603986	兆易创新	5,553,577.67	10.95
21	300502	新易盛	5,424,905.00	10.70
22	300308	中际旭创	5,182,471.00	10.22
23	300433	蓝思科技	4,807,124.00	9.48
24	601728	中国电信	4,637,608.00	9.15
25	603083	剑桥科技	4,561,123.00	9.00
26	603019	中科曙光	4,427,760.00	8.73
27	002384	东山精密	4,263,822.00	8.41
28	688678	福立旺	4,176,378.06	8.24

29	688213	思特威	4,016,835.30	7.92
30	300548	长芯博创	3,928,857.00	7.75
31	300570	太辰光	3,783,848.00	7.46
32	300475	香农芯创	3,601,349.00	7.10
33	688072	拓荆科技	3,535,195.43	6.97
34	600050	中国联通	3,480,059.00	6.86
35	002600	领益智造	3,378,862.00	6.66
36	002273	水晶光电	3,259,854.00	6.43
37	688099	晶晨股份	3,147,400.49	6.21
38	001309	德明利	3,136,357.00	6.19
39	002947	恒铭达	3,102,567.00	6.12
40	300442	润泽科技	3,088,155.00	6.09
41	688120	华海清科	2,853,555.38	5.63
42	600418	江淮汽车	2,610,078.00	5.15
43	603893	瑞芯微	2,583,376.00	5.10
44	688183	生益电子	2,509,181.37	4.95
45	600584	长电科技	2,314,743.00	4.57
46	688596	正帆科技	2,297,451.29	4.53
47	601689	拓普集团	2,268,873.00	4.48
48	300679	电连技术	2,237,928.00	4.41
49	000063	中兴通讯	2,230,791.00	4.40
50	688498	源杰科技	2,218,068.60	4.38
51	688111	金山办公	2,173,801.65	4.29
52	002126	银轮股份	2,164,054.00	4.27
53	002837	英维克	2,139,193.10	4.22
54	002050	三花智控	2,137,613.00	4.22
55	688385	复旦微电	2,136,974.58	4.22
56	600487	亨通光电	2,102,749.00	4.15
57	688123	聚辰股份	2,089,517.54	4.12
58	002241	歌尔股份	2,031,798.00	4.01
59	688525	佰维存储	1,989,313.64	3.92
60	688200	华峰测控	1,949,593.93	3.85
61	002938	鹏鼎控股	1,948,241.00	3.84
62	688766	普冉股份	1,844,661.60	3.64
63	001389	广合科技	1,791,203.00	3.53
64	688484	南芯科技	1,729,173.75	3.41
65	688228	开普云	1,719,199.81	3.39
66	301489	思泉新材	1,698,280.00	3.35
67	688608	恒玄科技	1,695,600.83	3.34
68	603296	华勤技术	1,662,231.00	3.28
69	002138	顺络电子	1,661,174.00	3.28

70	688627	精智达	1,637,302.00	3.23
71	688018	乐鑫科技	1,611,648.45	3.18
72	002130	沃尔核材	1,586,103.00	3.13
73	688502	茂莱光学	1,550,229.63	3.06
74	300857	协创数据	1,522,084.00	3.00
75	002484	江海股份	1,507,486.00	2.97
76	688381	帝奥微	1,464,492.47	2.89
77	300373	扬杰科技	1,459,660.00	2.88
78	688279	峰岹科技	1,452,588.39	2.87
79	301308	江波龙	1,448,555.00	2.86
80	002850	科达利	1,410,836.00	2.78
81	002965	祥鑫科技	1,403,819.00	2.77
82	688249	晶合集成	1,333,631.86	2.63
83	000977	浪潮信息	1,305,696.00	2.58
84	601231	环旭电子	1,289,783.00	2.54
85	688234	天岳先进	1,160,579.57	2.29
86	600686	金龙汽车	1,138,905.00	2.25
87	002929	润建股份	1,129,324.00	2.23
88	688362	甬矽电子	1,121,421.97	2.21
89	300687	赛意信息	1,120,889.00	2.21
90	688220	翱捷科技	1,111,112.65	2.19
91	300604	长川科技	1,106,413.00	2.18
92	688300	联瑞新材	1,100,903.78	2.17
93	688332	中科蓝讯	1,086,338.97	2.14
94	688691	灿芯股份	1,081,688.30	2.13
95	300002	神州泰岳	1,037,469.00	2.05
96	300953	震裕科技	1,030,347.00	2.03
97	688141	杰华特	1,024,108.06	2.02

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。

8.4.3 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	357,544,376.49
卖出股票收入（成交）总额	381,180,602.18

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。

8.5 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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	33,435.62
2	应收清算款	1,637,647.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,221.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,704,305.03

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	4,074,366.25	7.88	停牌

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
中信保诚鼎利混合(LOF)A	1,580	14,271.50	14,456.45	0.06%	22,534,516.82	99.94%
中信保诚鼎利混合(LOF)C	666	6,332.87	747,689.81	17.73%	3,469,998.49	82.27%
合计	2,246	11,917.48	762,146.26	2.85%	26,004,515.31	97.15%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末上市基金前十名持有人

中信保诚鼎利混合(LOF)A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	金小庆	1,000,038.00	20.82%
2	盛秉铨	200,000.00	4.16%
3	牛桂玲	119,458.00	2.49%
4	王鹏飞	114,200.00	2.38%
5	袁宝康	108,004.00	2.25%
6	李子熠	107,519.00	2.24%
7	金文波	103,250.00	2.15%
8	徐文芹	100,026.00	2.08%
9	郑秀英	100,010.00	2.08%
10	余嫦君	100,006.00	2.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中信保诚鼎利混合(LOF)A	197,672.33	0.88%
	中信保诚鼎利混合(LOF)C	4,592.90	0.11%
	合计	202,265.23	0.76%

注：本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.4 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	份额级别	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	中信保诚鼎利混合(LOF)A	10~50
	中信保诚鼎利混合(LOF)C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚鼎利混合(LOF)A	0
	中信保诚鼎利混合(LOF)C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚鼎利混合(LOF)A	中信保诚鼎利混合(LOF)C
基金合同生效日（2016 年 05 月 24 日）基金份额总额	1,216,702,748.19	-
本报告期期初基金份额总额	31,471,704.95	10,917,240.65
本报告期基金总申购份额	13,775,224.67	14,889,319.81
减：本报告期基金总赎回份额	22,697,956.35	21,588,872.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,548,973.27	4,217,688.30

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

自 2025 年 4 月 21 日起,刘业伟先生不再担任中信保诚基金管理有限公司副总经理职务;自 2025 年 12 月 17 日起，沈阳女士担任中信保诚基金管理有限公司副总经理职务。上述变更事项已按规定公告并向监管机构备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人于 2025 年 10 月 30 日将本基金会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金报告年度应支付给该事务所的报酬为人民币 15,000.00 元。该会计师事务所自改聘日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	365,845,278.50	49.52%	166,787.04	49.52%	-
广发证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
国融证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
华创证券	2	108,447,534.94	14.68%	49,441.80	14.68%	-
华福证券	1	2,088,197.00	0.28%	952.02	0.28%	本报告期新增
华金证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	2	89,822,983.54	12.16%	40,951.07	12.16%	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	28,035,999.39	3.80%	12,781.63	3.80%	本报告期新增
西南证券	1	138,049,875.30	18.69%	62,936.92	18.69%	-
浙商证券	1	6,435,110.00	0.87%	2,933.62	0.87%	本报告期新增

中信建投证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
中信证券	2	-	-	-	-	-

注： 1、本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

2、国泰海通由国泰君安与海通证券合并而成，自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起国泰君安作为合并后的存续公司，承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

11.7.2 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
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	789,026.50	100.00%	4,290,000.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注： 1、本公募基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。本公募基金管理人对首次合作的证券公司进行甄选，并对证券公司开展尽职调查，协调证券公司填写尽职调查表并提供相关证明材料。尽调完成后提交内部审批，评估通过后方可签署合同。

2、国泰海通由国泰君安与海通证券合并而成，自合并交割日 2025 年 3 月 14 日起国泰君安作为合并后的存续公司，承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，自 2025 年 4 月 3 日起，国泰君安证券股份有限公司中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

11.8 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	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)溢价风险提示公告	《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	2025 年 01 月 15 日
2	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2024 年第 4 季度报告	同上	2025 年 01 月 21 日
3	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2024 年年度报告	同上	2025 年 03 月 28 日
4	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2025 年第 1 季度报告	同上	2025 年 04 月 21 日
5	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新(2025 年 5 月)	同上	2025 年 05 月 30 日
6	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025 年 05 月 30 日
7	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（C 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2025 年 05 月 30 日
8	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2025 年第 2 季度报告	同上	2025 年 07 月 18 日
9	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)溢价风险提示公告	同上	2025 年 08 月 18 日
10	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2025 年中期报告	同上	2025 年 08 月 29 日
11	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)C 类份额恢复大额申购、大额	同上	2025 年 09 月 09 日

	转换转入及大额定期定额投资业务的公告		
12	中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2025 年第 3 季度报告	同上	2025 年 10 月 27 日
13	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	同上	2025 年 11 月 01 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、（原）信诚鼎利定增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、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同

4、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书

6、本报告期内按照规定披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

13.3 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 03 月 30 日