

信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金  
2020 年第三季度报告

2020 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：2020 年 10 月 28 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规定，于 2020 年 10 月 27 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 2020 年 07 月 01 日起至 2020 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	信诚中证 800 金融指数分级
场内简称	信诚金融
基金主代码	165521
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 20 日
报告期末基金份额总额	645,762,740.06 份
投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 800 金融指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	<p>本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p>
业绩比较基准	95%×中证 800 金融价格指数收益率+5%×金融同业存款利率。

风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金, 具有较高预期风险、较高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	信诚中证 800 金融指数分级 A	信诚中证 800 金融指数分级 B	信诚中证 800 金融指数分级
下属分级基金场内简称	金融 A	金融 B	信诚金融
下属分级基金的交易代码	150157	150158	165521
报告期末下属分级基金的份额总额	302, 062, 072. 00 份	302, 062, 073. 00 份	41, 638, 595. 06 份
下属分级基金的风险收益特征	金融 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	金融 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。	本基金为跟踪指数的股票型基金, 具有较高预期风险、较高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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。

### § 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 (2020 年 07 月 01 日-2020 年 09 月 30 日)
1. 本期已实现收益	36, 316, 183. 87
2. 本期利润	93, 545, 637. 24
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1359
4. 期末基金资产净值	706, 863, 146. 31
5. 期末基金份额净值	1. 095

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。

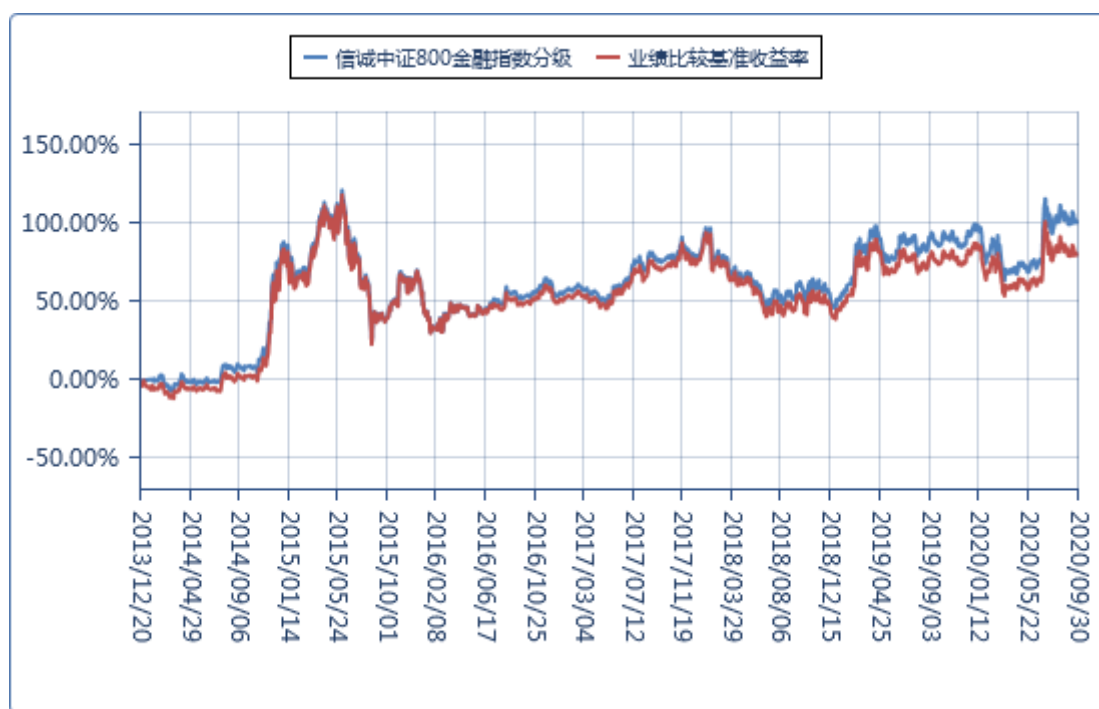
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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	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	12.89%	1.97%	8.54%	2.01%	4.35%	-0.04%
过去六个月	18.63%	1.54%	12.99%	1.57%	5.64%	-0.03%
过去一年	7.63%	1.48%	2.94%	1.49%	4.69%	-0.01%
过去三年	13.51%	1.37%	4.80%	1.38%	8.71%	-0.01%
过去五年	43.97%	1.29%	29.45%	1.30%	14.52%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	99.51%	1.55%	78.82%	1.57%	20.69%	-0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



## § 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		
HAN YILING	本基金基金经理	2018年04 月10日	-	6	计算机学硕士、信息技术硕士。曾任职于澳大利亚国立信息通信技术

					研究院,担任研究员;于中信保诚基金管理有限公司,担任量化投资部金融工程师;于华宝兴业基金管理有限公司,担任量化部投资经理。2016年6月重新加入中信保诚基金管理有限公司,历任投资经理、基金经理助理。现任量化二部副总监,信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚中证800金融指数分级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.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚中证800金融指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书》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》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际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,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当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

本报告期内,未发现本基金与其它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。报告期内,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(完全复制的指数基金除外)。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度,国内疫情与经济形势逐步趋于缓和,但从全球的角度看,疫情影响在各地仍有反复,加大了全球经济复苏的不确定性。影响经济的另一个比较重要的因素来源于美国大选。截至10月,美国选

情仍处于焦灼状态，哪党上台可能会对中国对外经贸政策产生很大影响，进而影响到本国货币政策和利率。A 股市场三季度，下跌较快的是通信、计算机与商贸板块；上涨较快的是新能源板块，包括新能源车产业链、以及光伏风电等。前三季度，上证综指涨幅 5.51%、深证成指涨幅 23.74%、创业板指涨幅 43.19%。

三季度进出口数据持续回升，主要由于内需与外需的改善。经济数据方面，中国上半年 GDP 实际同比增 3.2%，经济恢复向好的势头有望持续；宽信用的政策带动社融数据显著回升并构造了流动性宽松的市场环境，其中社融增速主要由人民币贷款和政府债券支撑；上半年 CPI 逐月走低，而近期 CPI 有所回升的主要原因在于洪灾导致的猪肉价格和农产品价格上涨，结合经济回升的现状来看通胀压力并不大；制造业 PMI 连续五个月维持在 50 以上，表明经济仍在好转。然而需关注中美关系的后续发展，上半年中美互关领事馆以及近期南海与台海问题、美国大选等事件均导致中美关系的不确定性有所上升，国际贸易摩擦加剧，需关注国际形势给 A 股市场带来的不确定性。

报告期内，本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上，利用数量化方法构建投资组合进行指数化投资，实现对标的指数的有效跟踪。同时，积极参与网下新股申购，以提高基金净值。

展望未来，总体来说我们更加看好估值处于合理区间的行业龙头。从疫情中复工是中国相对世界其他国家更具确定性的情况，因此全球资本流入是大势所趋。风险在于中美的大国博弈或能产生对中国较为负面的影响。

从行业角度看，下半年我们持续看好消费、医药以及电子科技对股市的带动作用，同时会关注低估值行业的中短期回暖，比如金融板块中的非银板块，以及周期性板块。对于科创板以及未来创业板的改革抱有正向预期，未来将长期持有在科创板及创业板上市的科技龙头企业。

我们坚持以“价值”作为投资，看好未来在各行业聚集效用，做价值股的长期投资。

#### 4.5 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 12.89%，同期业绩比较基准收益率为 8.54%。

#### 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（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	668,910,127.26	94.20
	其中：股票	668,910,127.26	94.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	910,880.00	0.13
	其中：债券	910,880.00	0.13
	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	39,430,901.26	5.55
8	其他资产	816,781.78	0.12

9	合计	710,068,690.30	100.00
---	----	----------------	--------

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
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	11,357,568.00	1.61
J	金融业	648,745,841.44	91.78
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	660,103,409.44	93.38

### 5.2.2 报告期末积极投资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	8,431,062.95	1.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	160,522.75	0.02
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	160,280.72	0.02

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	14,813.40	0.00
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	27,008.88	0.00
S	综合	-	-
	合计	8,806,717.82	1.25

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 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

### 5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	1,179,933	89,981,690.58	12.73
2	600036	招商银行	1,418,880	51,079,680.00	7.23
3	600030	中信证券	1,171,550	35,181,646.50	4.98
4	601166	兴业银行	1,716,856	27,692,887.28	3.92
5	601398	工商银行	4,832,272	23,774,778.24	3.36
6	300059	东方财富	909,520	21,819,384.80	3.09
7	000001	平安银行	1,338,150	20,299,735.50	2.87
8	601328	交通银行	3,787,692	17,196,121.68	2.43
9	601688	华泰证券	813,582	16,702,838.46	2.36
10	600837	海通证券	1,175,190	16,628,938.50	2.35

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688981	中芯国际	157,140	6,032,604.60	0.85
2	688336	三生国健	12,459	327,048.75	0.05
3	688311	盟升电子	4,182	322,264.92	0.05
4	688519	南亚新材	7,826	228,597.46	0.03
5	688330	宏力达	2,410	212,634.30	0.03



#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	910,880.00	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	910,880.00	0.13

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110073	国投转债	4,680	557,107.20	0.08
2	113037	紫银转债	3,310	353,772.80	0.05

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事

项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

兴业银行股份有限公司分别于 2020 年 8 月 31 日、2020 年 9 月 4 日收到中国银保监会福建监管局、中国人民银行福州中心支行处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24 号、福银罚字〔2020〕35 号），兴业银行因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款等违法违规事项被处以罚款合计 2978 万元。

中国工商银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日收到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监罚决字〔2020〕7 号），工商银行因数据质量及数据报送存在违法违规行为被中国银行保险监督管理委员会罚款合计 270 万元。

平安银行股份有限公司于 2020 年 1 月 20 日收到深圳银保监局处罚（深银保监罚决字〔2020〕7 号），因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成等违法违规行为被罚款 720 万元。

交通银行股份有限公司分别于 2019 年 12 月 27 日、2020 年 4 月 20 日收到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监罚决字〔2019〕24 号、银保监罚决字〔2020〕6 号），交通银行因授信审批不审慎、对分支机构管控不力、数据质量及数据报送存在违法违规行为被中国银行保险监督管理委员会罚款共计 410 万元。

华泰证券股份有限公司于 2020 年 2 月 10 日收到中国人民银行的处罚（银罚字〔2020〕23 号），华泰证券因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送可疑交易报告及与身份不明的客户进行交易等违法违规行为被中国人民银行罚款 1010 万元。

对“工商银行”、“兴业银行”、“平安银行”、“交通银行”和“华泰证券”投资决策程序的说明：这些银行和证券等金融机构均为中证 800 金融指数的成分股。这些银行和证券分别因 2019 年至 2020 年间发生的违规事件受到监管部门处罚。基金经理对事件的影响做了分析后认为，此类类型的处罚事件不会对公司的企业经营和投资价值产生太大的影响；另外，根据量化模型，基金经理也控制了其在投资组合中的占比，防止意外风险发生。因此我们认为投资策略没有决策性问题。

除此之外，本基金指数投资的前十名证券的发行主体及积极投资的前五名证券的发行主体均没有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。

### 5.11.2 声明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	91,938.26
2	应收证券清算款	642,363.27
3	应收股利	-
4	应收利息	3,722.86
5	应收申购款	78,757.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	816,781.78

#### 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

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资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指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688981	中芯国际	6,032,604.60	0.85	锁定期股票
2	688336	三生国健	327,048.75	0.05	锁定期股票
3	688311	盟升电子	322,264.92	0.05	锁定期股票
4	688519	南亚新材	228,597.46	0.03	锁定期股票
5	688330	宏力达	212,634.30	0.03	新发未上市

#### 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	信诚中证 800 金融指数分级 A	信诚中证 800 金融指数分级 B	信诚中证 800 金融指数分级
报告期期初基金份额总额	347,977,548.00	347,977,549.00	35,128,661.14
报告期期间基金总申购份额	-	-	17,161,695.73
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	102,482,713.81
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-45,915,476.00	-45,915,476.00	91,830,952.00

报告期期末基金份额总额	302,062,072.00	302,062,073.00	41,638,595.06
-------------	----------------	----------------	---------------

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间：自 2020 年 9 月 24 日起至 2020 年 10 月 23 日 17:00 止（纸质表决以表决票收件人收到表决票时间为准；短信表决以基金管理人指定系统记录时间为准）；其中网络投票表决方式投票时间：自 2020 年 10 月 18 日 0:00 起至 2020 年 10 月 23 日 17:00 止（以基金管理人指定网络投票系统收到表决时间为准）。2020 年 10 月 27 日，因未达到法定的会议召开条件，本次基金份额持有人大会召开失败。会议详情请见 2020 年 10 月 28 日在《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站发布的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、信诚中证 800 金融指数分级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、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚中证 800 金融指数分级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

中信保诚基金管理有限公司办公地—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。

### 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

2020 年 10 月 28 日