

中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定,于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 03 月 22 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	8
2.5	其他相关资料	8
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§ 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	14
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12	投资组合报告附注 .....	51
§ 8	基金份额持有人信息 .....	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.3	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 .....	53
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	53
§ 9	开放式基金份额变动 .....	53
§ 10	重大事件揭示 .....	54
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8	其他重大事件 .....	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§ 12	备查文件目录 .....	56
12.1	备查文件目录 .....	56
12.2	存放地点 .....	56
12.3	查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	中信保诚国企红利量化股票	
基金主代码	020768	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 03 月 22 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	131,494,327.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚国企红利量化股票 A	中信保诚国企红利量化股票 C
下属分级基金的交易代码	020768	020769
报告期末下属分级基金的份额总额	20,153,711.05 份	111,340,616.18 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注国企红利主题相关上市公司的投资机会,通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制,力争实现长期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>本基金通过对国内外宏观经济运行状况、政策环境、利率走势、证券市场走势的分析进行战略判断,确定投资组合中股票、债券、现金、金融衍生品等大类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 国企红利主题的界定</p> <p>本基金重点关注国企红利主题相关上市公司的投资机会,本基金所定义的国企红利主题相关股票(含存托凭证)是指经营状况良好,具有稳定分红能力,且满足以下第 1) 项和第 2) 项中任一项条件的上市公司发行的股票(含存托凭证):</p> <p>1) 中证国有企业红利指数成份股和备选成份股;</p> <p>2) 在过去两年中,至少有一年实施现金分红且现金分红率(现金分红/净利润)或股息率(现金分红/市值)处于市场前 50%的国有上市公司。</p> <p>本基金对国有上市公司的界定如下:</p> <p>1) 国有控股上市公司:指政府部门、机构、事业单位、国有独资企业(公司)、国有全资企业、国有控股企业单独或共同出资,直接或间接合计拥有股权比例超过 50%的上市公司;</p> <p>2) 国有实际控制上市公司:指政府部门、机构、事业单位、国有独资企业(公司)、国有全资企业、国有控股企业直接或间接合计持股比例未超过 50%,但其中之一构成控制,或通过股东协议、公</p>

	<p>司章程、董事会决议或者其他协议安排能够对其实际支配的上市公司；</p> <p>3) 国有参股上市公司：指国有出资并对企业有重大影响的上市公司，“重大影响”的界定参照《企业会计准则》相关规定。当国家政策、法律法规、相关准则发生变化，或基金管理人认为有更适当的国企红利主题界定标准，基金管理人在履行适当程序后，可以对界定方法进行变更并在更新的招募说明书中公告。</p> <p>(2) 股票投资策略</p> <p>本基金采用的量化选股模型，以对中国股票市场的长期研究为基础，结合前瞻性市场判断，构建量化选股模型。模型综合考虑股票的基本面（如分红能力、盈利能力、运营质量、成长性、估值等）、价量特征、事件性因素等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。本基金管理人会持续研究市场状态、市场变化以及模型运作状况，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。</p> <p>对于港股通标的股票，本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场。本基金主要采用“自下而上”的量化选股方式，精选出具有投资价值的优质标的。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>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选相应的存托凭证投资标的。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金出于对流动性、有效利用基金资产的考量，适时对债券进行投资。本基金的债券投资以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，进行相应的久期配置和个券选择，构建债券投资组合，以期获得与风险相匹配的投资收益。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，研究资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，评估其内在价值。</p> <p>6、可转换债券、可交换债券投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，研究上市公司对转股价的修正和转股意愿。</p>
--	---

	<p><b>7、衍生品投资策略</b></p> <p>为了更好地实现投资目标，基金还可投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。</p> <p>本基金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，本基金还可运用股指期货来对冲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>本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，结合期权定价模型投资股票期权，提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。</p> <p>本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。</p> <p><b>8、融资业务投资策略</b></p> <p>本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资业务。</p> <p>利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标和风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中证国有企业红利指数收益率×85%+恒生指数收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，如投资，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。</p>

### 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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	95597
传真	021-50120895	025-83387215
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	江苏省南京市江东中路 228 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪	江苏省南京市江东中路 228 号

	大道 8 号上海国金中心汇丰银行 大楼 9 层	
邮政编码	200120	210009
法定代表人	涂一锴	张伟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日）	
	中信保诚国企红利量化股票 A	中信保诚国企红利量化股票 C
本期已实现收益	77,373.99	664,051.73
本期利润	-432,261.12	-1,925,772.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0163	-0.0082
本期加权平均净值利润率	-1.63%	-0.82%
本期基金份额净值增长率	-2.23%	-2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
	中信保诚国企红利量化股票 A	中信保诚国企红利量化股票 C
期末可供分配利润	-448,535.63	-2,669,126.36
期末可供分配基金份额利润	-0.0223	-0.0240
期末基金资产净值	19,705,175.42	108,671,489.82
期末基金份额净值	0.9777	0.9760
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
	中信保诚国企红利量化股票 A	中信保诚国企红利量化股票 C
基金份额累计净值增长率	-2.23%	-2.40%

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。

4、本基金合同在当期生效，本报告期不足半年。

### 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

中信保诚国企红利量化股票 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
过去一个月	-3.32%	0.79%	-4.44%	0.74%	1.12%	0.05%
过去三个月	-2.24%	0.58%	0.23%	0.75%	-2.47%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-2.23%	0.54%	-0.30%	0.72%	-1.93%	-0.18%

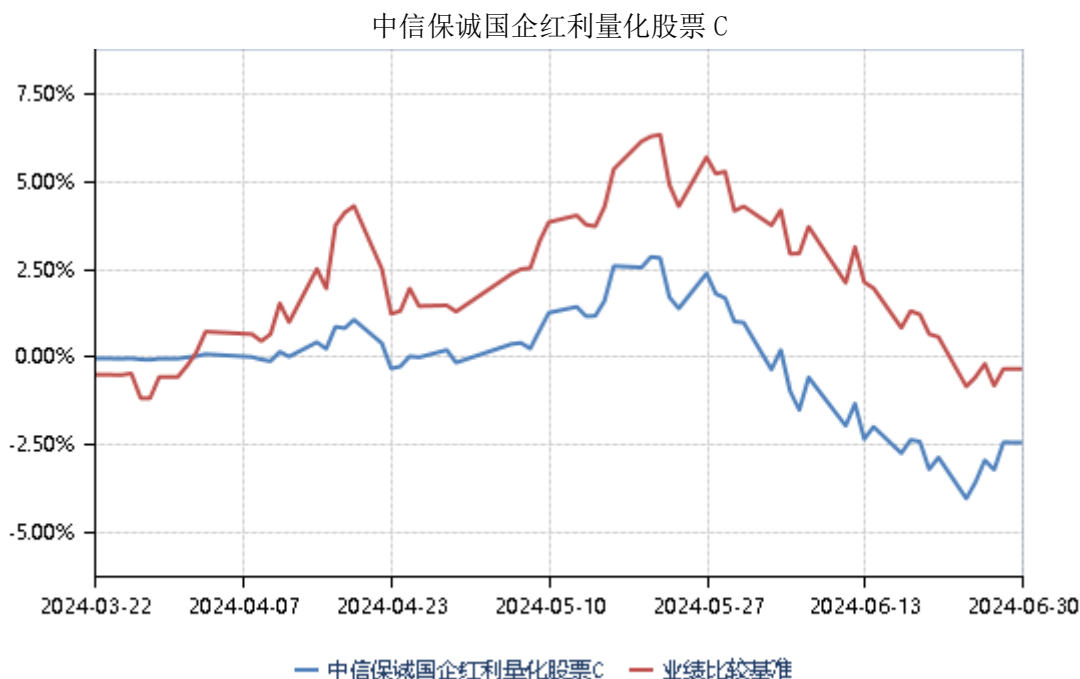
中信保诚国企红利量化股票 C

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
过去一个月	-3.39%	0.79%	-4.44%	0.74%	1.05%	0.05%
过去三个月	-2.39%	0.58%	0.23%	0.75%	-2.62%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-2.40%	0.54%	-0.30%	0.72%	-2.10%	-0.18%

#### 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

中信保诚国企红利量化股票 A





注：1、本基金合同生效日为 2024 年 03 月 22 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

2、本基金建仓期自 2024 年 03 月 22 日至 2024 年 09 月 22 日，截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、保诚集团股份有限公司和新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 84 只，分别为：中信保诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、中信保诚三得益债券型证券投资基金、中信保诚优胜精选混合型证券投资基金、中信保诚中小盘混合型证券投资基金、中信保诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、中

信保诚至远动力混合型证券投资基金、中信保诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证建筑工程指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金、中信保诚薪金宝货币市场基金、中信保诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳健债券型证券投资基金、中信保诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳悦债券型证券投资基金、中信保诚稳鑫债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、中信保诚稳泰债券型证券投资基金、中信保诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、中信保诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚智惠金货币市场基金、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、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投

资基金、中信保诚先进制造混合型证券投资基金、中信保诚远见成长混合型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信保诚嘉盛三个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信保诚中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、中信保诚景气优选混合型证券投资基金、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金、中信保诚中证 500 指数增强型证券投资基金、中信保诚 60 天持有期债券型证券投资基金、中信保诚中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
HAN YILING	量化投资部副总监、基金经理	2024 年 03 月 22 日	-	10	HAN YILING 先生，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、量化二部副总监。现任量化投资部副总监，中信保诚沪深 300 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 500 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）、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金的基金经理。
黄稚	基金经理	2024 年 03 月	-	12	黄稚女士，理学硕士。

		22 日			曾任职于中国国际金融有限公司,担任资产管理部产品经理;于平安证券有限责任公司,担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司,历任金融工程师、基金经理助理。现任中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证建设工程指数型证券投资基金 (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 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)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚国企红利量化选股股票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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资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 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

回顾 2024 年上半年，海外方面，美国通胀有所缓和，但美联储降息预期反复波动，美债利率仍在高位运行。国内方面，经济继续修复，社零边际改善，外需拉动下出口表现较好，制造业韧性较强，而基建增速略有放缓，房地产投资仍然承压。房地产政策持续优化，对稳定市场预期有一定积极作用。

报告期内，A 股市场经历年初调整后反弹修复，之后总体呈现弱势震荡格局，二季度成交额有

所下降，市场整体风险偏好回落。上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 指数下跌 8.96%。分行业来看，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，而计算机、商贸零售、社会服务、传媒、医药生物等行业跌幅较大。从风格上看，在经济总量弹性较为缺乏的背景下，大盘和红利风格相对占优。从量化角度看，市场存量博弈格局之下，基本面因子如价值因子等表现较强。

在基金投资上，本基金前期逐步建仓，之后维持较高股票仓位。本基金重点关注高分红国有企业上市公司的投资机会，坚持采取量化策略进行股票投资，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚国企红利量化股票 A 份额净值增长率为-2.23%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%；中信保诚国企红利量化股票 C 份额净值增长率为-2.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，全球通胀压力有望继续缓和，海外经济面临下行压力，美联储降息时点临近，或利于外部流动性改善和风险偏好提振。国内仍处于经济修复期，但面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战，国内政策有望继续发力，政策的实施和影响、基本面恢复有待进一步观察。随着外部环境缓和、内生动能逐步恢复，预计国内经济将延续企稳回升态势。

随着经济预期改善、资本市场制度不断完善，投资者信心也将逐渐恢复，A 股市场也有望逐步企稳。整体来看，经过震荡回调后目前 A 股估值水平处于历史较低水平，权益资产具备较好的配置性价比。新质生产力、高端制造和国企改革等结构性投资机会可能进一步增加。

国有企业是国民经济的重要支柱。在国内经济转型升级的过程中，国有企业经营韧性较强，承担着保障安全、稳定经济、产业引领等重要功能。近年来随着内外部不确定性提高，投资者从追求“高成长”逐渐转向追求“确定性”。在此过程中，综合实力较强、经营稳定性和分红持续性较好的央国企上市公司比较符合投资者偏好。因此，我们重点关注经营稳定、有持续分红能力的国有企业的中长期投资价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，

在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、海外投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

在每个估值日，本基金管理人使用估值政策确定的估值方法，确定证券投资基金的份额净值，托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元或者基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2024 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	13,794,759.92
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	115,185,562.41
其中：股票投资		115,185,562.41
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		31,997.33
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		129,012,319.66
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		336,329.95
应付管理人报酬		154,331.86
应付托管费		25,721.99
应付销售服务费		66,617.16
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	52,653.46
负债合计		635,654.42
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	131,494,327.23
未分配利润	6.4.7.8	-3,117,661.99
净资产合计		128,376,665.24
负债和净资产总计		129,012,319.66

注：1、截止本报告期末，基金份额总额 131,494,327.23 份。其中：中信保诚国企红利量化股票 A 的基金份额净值 0.9777 元，基金份额总额 20,153,711.05 份；中信保诚国企红利量化股票 C 的基金份额净值 0.9760 元，基金份额总额 111,340,616.18 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-911,566.70
1. 利息收入		634,846.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	116,661.62
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		518,185.04
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,521,413.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,684,658.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	3,206,072.68
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-3,099,458.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	31,631.76
<b>减：二、营业总支出</b>		1,446,466.46
1. 管理人报酬		862,272.61

2. 托管费		143,712.15
3. 销售服务费		387,552.61
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	52,929.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,358,033.16</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,358,033.16</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-2,358,033.16</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	306,399,798.59	-	306,399,798.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-174,905,471.36	-3,117,661.99	-178,023,133.35
（一）、综合收益总额	-	-2,358,033.16	-2,358,033.16
（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）	-174,905,471.36	-759,628.83	-175,665,100.19
其中：1. 基金申购款	1,332,115.78	-24,237.87	1,307,877.91
2. 基金赎回款	-176,237,587.14	-735,390.96	-176,972,978.10
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	131,494,327.23	-3,117,661.99	128,376,665.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

董元星

桂思毅

刘卓

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]165号《关于准予中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金注册的批复》准予注册,由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”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 306,365,881.80 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0111 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》于 2024 年 03 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 306,399,798.59 份基金份额,其中认购资金利息折合 33,916.79 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购或申购时收取认购费或申购费,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费,但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费,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》和《中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券)、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证的资产不低于基金资产的 80%,其中,投资于国企红利主题相关股票(含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金,存出保证金及应收申购款等。基金的业绩比较基准为:中证国有企业红利指数收益率 $\times$ 85%+恒生指数收益率 $\times$ 5%+中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 10%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加

权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)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；或者(3)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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。



应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 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、债券投资和资产支持证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)对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.05%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	12,679,893.58
等于：本金	12,674,152.13

加：应计利息	5,741.45
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	1,114,866.34
等于：本金	1,114,811.38
加：应计利息	54.96
合计	13,794,759.92

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	118,285,021.29	-	115,185,562.41	-3,099,458.88
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	118,285,021.29	-	115,185,562.41	-3,099,458.88

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	124.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	19,490.98
应付信息披露费	33,038.11
合计	52,653.46

### 6.4.7.7 实收基金

中信保诚国企红利量化股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 03 月 22 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	28,580,573.97	28,580,573.97
本期申购	315,427.72	315,427.72
本期赎回(以“-”号填列)	-8,742,290.64	-8,742,290.64
本期末	20,153,711.05	20,153,711.05

中信保诚国企红利量化股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 03 月 22 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	277,819,224.62	277,819,224.62
本期申购	1,016,688.06	1,016,688.06
本期赎回(以“-”号填列)	-167,495,296.50	-167,495,296.50
本期末	111,340,616.18	111,340,616.18

注：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)。

### 6.4.7.8 未分配利润

中信保诚国企红利量化股票 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	77,373.99	-509,635.11	-432,261.12
本期基金份额交易产生的变动数	-40,283.44	24,008.93	-16,274.51
其中：基金申购款	-437.17	-6,895.53	-7,332.70
基金赎回款	-39,846.27	30,904.46	-8,941.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,090.55	-485,626.18	-448,535.63

中信保诚国企红利量化股票 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	664,051.73	-2,589,823.77	-1,925,772.04
本期基金份额交易产生的变动数	-654,802.69	-88,551.63	-743,354.32
其中：基金申购款	1,821.77	-18,726.94	-16,905.17
基金赎回款	-656,624.46	-69,824.69	-726,449.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,249.04	-2,678,375.40	-2,669,126.36

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日
活期存款利息收入	114,085.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,576.44
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	116,661.62

注：1、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日

卖出股票成交总额	263,920,593.29
减：卖出股票成本总额	265,015,466.19
减：交易费用	589,786.02
买卖股票差价收入	-1,684,658.92

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月22日(基金合同生效日)至2024 年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,206,072.68
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	3,206,072.68

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年03月22日(基金合同生效日)至2024 年06月30日
1. 交易性金融资产	-3,099,458.88
--股票投资	-3,099,458.88
--债券投资	-
--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	-3,099,458.88

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月22日(基金合同生效日)至2024 年06月30日
基金赎回费收入	31,631.65
转换费收入	0.11
合计	31,631.76

注：1、本基金的场外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月22日(基金合同生效日)至2024 年06月30日
审计费用	19,490.98
信息披露费	33,038.11
证券出借违约金	-
证券开户费	400.00



合计	52,929.09
----	-----------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	647,073,368.38	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日
-------	--

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	1,249,400,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份 有限公司	489,260.38	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金支付收取方为本基金提供的证券研究综合服务和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	862,272.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	426,275.19
应支付基金管理人的净管理费	435,997.42

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月22日（基金合同生效日）至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	143,712.15

注：支付基金托管人华泰证券股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/

当年天数

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 03 月 22 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚国企红利量化股票 A	中信保诚国企红利量化股票 C	合计
中信保诚基金管理有限公司	-	87.60	87.60
华泰证券股份有限公司	-	380,051.65	380,051.65
合计	-	380,139.25	380,139.25

注：本基金中信保诚国企红利量化股票 A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚国企红利量化股票 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

中信保诚国企红利量化股票 C 的销售服务费按前一日中信保诚国企红利量化股票 C 资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算公式为：中信保诚国企红利量化股票 C 基金日销售服务费=中信保诚国企红利量化股票 C 基金份额前一日资产净值×0.60%/当年天数

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期	
	2024年03月22日(基金合同生效日)至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券股份有限公司	13,794,759.92	116,661.62

注:本基金的活期银行存款由基金托管人华泰证券股份有限公司委托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。本基金券商资金账户的存款为本基金存放于华泰证券股份有限公司证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金,按协议约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末 2024 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

603285	键邦股份	2024年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	646	12,047.90	12,047.90	-
603285	键邦股份	2024年06月28日	6个月	锁定期股票	18.65	18.65	72	1,342.80	1,342.80	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	695	14,289.20	14,289.20	-
603350	安乃达	2024年06月26日	6个月	锁定期股票	20.56	20.56	78	1,603.68	1,603.68	-
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	锁定期股票	23.35	25.13	66	1,541.10	1,658.58	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	锁定期股票	86.96	174.93	119	10,348.24	20,816.67	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

本基金管理人风险管理组织体系包括董事会（及其下设的风控与审计委员会）、管理层（及其下

设的经营层面风险管理委员会) 及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任, 负责确定公司风险管理总体目标, 制定公司风险管理战略和风险应对策略等。董事会下设风控与审计委员会, 根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任, 根据董事会的风险管理战略, 制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度, 确保风险管理制度全面、有效执行; 批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等。管理层下设经营层面风险管理委员会, 负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作; 识别公司各项业务所涉及各类重大风险, 对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估, 制定重大风险的解决方案等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程, 定期对本部门的风险进行评估, 对其风险管理的有效性负责, 并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时, 公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部, 协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险, 或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险, 及因交易对手违约而产生的交割风险等情况。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行, 本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外, 本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 审慎进行债券投资, 通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有短期债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有短期资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有短期同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有长期债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有长期资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有长期同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基

金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。



本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024年06月30 日	1个月以内	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	13,794,759.92	-	-	-	-	-	13,794,759.92
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	115,185,562.41	115,185,562.41
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	-	-	-	-	-	31,997.33	31,997.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,794,759.92	-	-	-	-	115,217,559.74	129,012,319.66
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	-	-	-	-	-	336,329.95	336,329.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	154,331.86	154,331.86
应付托管费	-	-	-	-	-	25,721.99	25,721.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	66,617.16	66,617.16
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	-	-	-	-	-	52,653.46	52,653.46
负债总计	-	-	-	-	-	635,654.42	635,654.42
利率敏感度缺口	13,794,759.92	-	-	-	-	-114,581,905.32	128,376,665.24

注:上表统计了本基金面临的利率风险敞口,表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合

约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，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。本基金合同自 2024 年 03 月 22 日起生效，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	115,185,562.41	89.72
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	115,185,562.41	89.72

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2024 年 06 月 30 日）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	3,654,363.75

业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-3,654,363.75
-------------------	---------------

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日
第一层次	115,133,803.58
第二层次	29,283.58
第三层次	22,475.25
合计	115,185,562.41

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	115,185,562.41	89.28
	其中：股票	115,185,562.41	89.28
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	13,794,759.92	10.69
8	其他各项资产	31,997.33	0.02
9	合计	129,012,319.66	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,055,062.00	2.38
C	制造业	34,652,346.06	26.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,970,122.00	2.31
E	建筑业	9,251,343.80	7.21
F	批发和零售业	740,015.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	8,327,945.00	6.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	459,764.67	0.36
J	金融业	44,493,112.88	34.66
K	房地产业	3,837,132.00	2.99
L	租赁和商务服务业	6,803,844.00	5.30

M	科学研究和技术服务业	227,810.00	0.18
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	367,065.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	115,185,562.41	89.72

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601009	南京银行	373,900	3,884,821.00	3.03
2	601288	农业银行	852,500	3,716,900.00	2.90
3	600901	江苏金租	719,700	3,634,485.00	2.83
4	600919	江苏银行	480,400	3,569,372.00	2.78
5	000932	华菱钢铁	786,900	3,485,967.00	2.72
6	600153	建发股份	390,000	3,482,700.00	2.71
7	000090	天健集团	829,840	3,335,956.80	2.60
8	600755	厦门国贸	463,200	3,321,144.00	2.59
9	000830	鲁西化工	284,700	3,299,673.00	2.57
10	601166	兴业银行	181,900	3,205,078.00	2.50
11	600019	宝钢股份	477,700	3,176,705.00	2.47
12	600064	南京高科	519,000	3,150,330.00	2.45
13	600585	海螺水泥	127,000	2,995,930.00	2.33
14	601963	重庆银行	367,200	2,845,800.00	2.22
15	601187	厦门银行	531,300	2,831,829.00	2.21
16	601000	唐山港	600,100	2,820,470.00	2.20
17	601229	上海银行	385,100	2,795,826.00	2.18
18	601328	交通银行	365,400	2,729,538.00	2.13
19	601398	工商银行	471,900	2,689,830.00	2.10
20	601169	北京银行	456,082	2,663,518.88	2.07
21	600928	西安银行	810,000	2,648,700.00	2.06
22	600741	华域汽车	159,700	2,615,886.00	2.04
23	600028	中国石化	413,700	2,614,584.00	2.04

24	600820	隧道股份	391,600	2,557,148.00	1.99
25	601997	贵阳银行	484,500	2,553,315.00	1.99
26	600033	福建高速	696,600	2,333,610.00	1.82
27	600282	南钢股份	461,900	2,300,262.00	1.79
28	000030	富奥股份	465,200	2,284,132.00	1.78
29	601668	中国建筑	387,800	2,059,218.00	1.60
30	002267	陕天然气	270,600	2,045,736.00	1.59
31	601577	长沙银行	246,300	2,014,734.00	1.57
32	600000	浦发银行	226,900	1,867,387.00	1.45
33	601866	中远海发	683,000	1,762,140.00	1.37
34	600479	千金药业	142,600	1,450,242.00	1.13
35	600170	上海建工	481,500	1,035,225.00	0.81
36	601919	中远海控	33,300	515,817.00	0.40
37	601860	紫金银行	199,700	499,250.00	0.39
38	600008	首创环保	182,000	487,760.00	0.38
39	000900	现代投资	132,500	484,950.00	0.38
40	002540	亚太科技	91,400	483,506.00	0.38
41	601216	君正集团	129,000	476,010.00	0.37
42	600596	新安股份	61,400	466,640.00	0.36
43	002004	华邦健康	122,600	465,880.00	0.36
44	002048	宁波华翔	35,200	455,488.00	0.35
45	000930	中粮科技	90,300	454,209.00	0.35
46	603156	养元饮品	21,200	450,924.00	0.35
47	002557	洽洽食品	15,700	442,583.00	0.34
48	002322	理工能科	27,400	438,948.00	0.34
49	600655	豫园股份	84,100	433,115.00	0.34
50	601339	百隆东方	81,600	425,136.00	0.33
51	000718	苏宁环球	248,700	417,816.00	0.33
52	002283	天润工业	96,300	413,127.00	0.32
53	600018	上港集团	71,100	410,958.00	0.32
54	688298	东方生物	15,026	407,955.90	0.32
55	002001	新 和 成	19,500	374,400.00	0.29
56	603882	金域医学	13,500	367,065.00	0.29
57	002948	青岛银行	101,700	342,729.00	0.27
58	002563	森马服饰	56,900	330,589.00	0.26
59	000333	美的集团	5,000	322,500.00	0.25
60	002536	飞龙股份	33,200	316,064.00	0.25
61	600210	紫江企业	59,200	314,944.00	0.25
62	600219	南山铝业	81,000	308,610.00	0.24
63	301177	迪阿股份	16,500	306,900.00	0.24
64	600987	航民股份	41,800	295,108.00	0.23

65	603002	宏昌电子	62,300	292,187.00	0.23
66	002745	木林森	35,700	287,742.00	0.22
67	000683	远兴能源	41,300	285,383.00	0.22
68	002408	齐翔腾达	50,500	282,800.00	0.22
69	000157	中联重科	36,100	277,248.00	0.22
70	600618	氯碱化工	31,500	276,570.00	0.22
71	300303	聚飞光电	56,800	276,048.00	0.22
72	601512	中新集团	35,300	268,986.00	0.21
73	600284	浦东建设	49,400	263,796.00	0.21
74	000581	威孚高科	16,200	263,736.00	0.21
75	603589	口子窖	6,600	258,654.00	0.20
76	000589	贵州轮胎	51,000	258,570.00	0.20
77	002274	华昌化工	34,700	257,474.00	0.20
78	600801	华新水泥	18,600	255,750.00	0.20
79	301219	腾远钴业	6,500	248,690.00	0.19
80	603508	思维列控	13,200	247,500.00	0.19
81	002925	盈趣科技	19,500	247,065.00	0.19
82	300741	华宝股份	16,200	246,888.00	0.19
83	601636	旗滨集团	36,600	236,070.00	0.18
84	601101	昊华能源	25,200	231,588.00	0.18
85	002585	双星新材	46,600	231,136.00	0.18
86	301047	义翘神州	3,800	227,810.00	0.18
87	600461	洪城环境	19,500	225,810.00	0.18
88	600742	一汽富维	29,300	218,285.00	0.17
89	601566	九牧王	25,900	218,078.00	0.17
90	600577	精达股份	54,700	217,159.00	0.17
91	600623	华谊集团	37,000	213,860.00	0.17
92	600746	江苏索普	36,000	212,040.00	0.17
93	000958	电投产融	57,600	210,816.00	0.16
94	002128	电投能源	9,900	208,890.00	0.16
95	688692	达梦数据	119	20,816.67	0.02
96	603350	安乃达	773	15,892.88	0.01
97	603285	键邦股份	718	13,390.70	0.01
98	603381	永臻股份	66	1,658.58	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600901	江苏金租	9,617,566.00	7.49

2	000830	鲁西化工	8,401,764.00	6.54
3	000932	华菱钢铁	8,283,627.00	6.45
4	600153	建发股份	8,140,001.00	6.34
5	600585	海螺水泥	7,642,794.00	5.95
6	600755	厦门国贸	7,625,218.00	5.94
7	000090	天健集团	7,418,325.79	5.78
8	600057	厦门象屿	7,037,516.00	5.48
9	600919	江苏银行	6,961,185.00	5.42
10	601006	大秦铁路	6,911,999.00	5.38
11	601009	南京银行	6,889,153.00	5.37
12	000906	浙商中拓	6,883,474.28	5.36
13	601166	兴业银行	6,829,756.00	5.32
14	600064	南京高科	6,789,598.40	5.29
15	600820	隧道股份	6,770,065.00	5.27
16	601288	农业银行	6,523,238.00	5.08
17	601229	上海银行	6,438,276.03	5.02
18	600188	兖矿能源	6,390,143.00	4.98
19	601398	工商银行	6,142,566.00	4.78
20	601169	北京银行	6,093,733.22	4.75
21	600741	华域汽车	6,022,902.00	4.69
22	600928	西安银行	5,884,347.00	4.58
23	600028	中国石化	5,866,358.00	4.57
24	601000	唐山港	5,864,929.00	4.57
25	601328	交通银行	5,848,331.00	4.56
26	601997	贵阳银行	5,786,383.00	4.51
27	601225	陕西煤业	5,786,283.00	4.51
28	000030	富奥股份	5,760,044.00	4.49
29	601699	潞安环能	5,482,081.84	4.27
30	600123	兰花科创	5,413,845.20	4.22
31	601098	中南传媒	5,338,610.00	4.16
32	600502	安徽建工	5,299,860.00	4.13
33	000789	万年青	5,281,404.40	4.11
34	600015	华夏银行	5,278,330.00	4.11
35	600019	宝钢股份	5,222,974.00	4.07
36	601077	渝农商行	5,188,641.00	4.04
37	600350	山东高速	5,163,582.80	4.02
38	601668	中国建筑	5,041,653.00	3.93
39	002267	陕天然气	4,879,463.00	3.80
40	000002	万科A	4,791,925.00	3.73
41	601988	中国银行	4,540,922.00	3.54
42	600000	浦发银行	4,400,477.00	3.43



43	001965	招商公路	4,367,669.00	3.40
44	600461	洪城环境	4,311,664.87	3.36
45	601211	国泰君安	4,184,431.00	3.26
46	601866	中远海发	3,972,257.00	3.09
47	600048	保利发展	3,635,004.00	2.83
48	601963	重庆银行	3,362,983.00	2.62
49	600479	千金药业	3,313,313.20	2.58
50	601187	厦门银行	2,955,909.00	2.30
51	600033	福建高速	2,944,126.00	2.29

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600057	厦门象屿	7,777,555.31	6.06
2	601006	大秦铁路	6,694,283.00	5.21
3	600188	兖矿能源	6,479,836.50	5.05
4	600901	江苏金租	6,345,999.60	4.94
5	000906	浙商中拓	6,042,017.86	4.71
6	000830	鲁西化工	5,956,148.00	4.64
7	601098	中南传媒	5,632,812.00	4.39
8	601225	陕西煤业	5,436,400.00	4.23
9	600502	安徽建工	5,413,218.00	4.22
10	600015	华夏银行	5,375,317.00	4.19
11	601699	潞安环能	5,353,539.32	4.17
12	601077	渝农商行	5,309,065.00	4.14
13	600350	山东高速	5,262,348.00	4.10
14	600585	海螺水泥	4,956,651.00	3.86
15	600123	兰花科创	4,808,591.70	3.75
16	000002	万科A	4,693,057.00	3.66
17	000789	万年青	4,575,394.80	3.56
18	600461	洪城环境	4,545,421.40	3.54
19	000932	华菱钢铁	4,443,503.00	3.46
20	601988	中国银行	4,430,262.00	3.45
21	001965	招商公路	4,369,686.00	3.40
22	600755	厦门国贸	4,351,866.00	3.39
23	601211	国泰君安	4,293,511.00	3.34
24	600820	隧道股份	4,215,966.00	3.28
25	601166	兴业银行	4,171,791.00	3.25
26	600048	保利发展	4,033,594.00	3.14
27	601229	上海银行	3,987,914.00	3.11

28	600153	建发股份	3,880,964.00	3.02
29	601398	工商银行	3,640,283.00	2.84
30	000090	天健集团	3,488,386.00	2.72
31	601169	北京银行	3,481,092.00	2.71
32	601009	南京银行	3,457,081.00	2.69
33	601328	交通银行	3,395,254.00	2.64
34	600064	南京高科	3,393,680.00	2.64
35	600741	华域汽车	3,273,178.00	2.55
36	600028	中国石化	3,177,618.00	2.48
37	601668	中国建筑	3,084,455.00	2.40
38	600919	江苏银行	3,048,431.00	2.37
39	601997	贵阳银行	3,030,969.00	2.36
40	601000	唐山港	3,011,947.00	2.35
41	600928	西安银行	2,971,216.00	2.31
42	000030	富奥股份	2,949,347.00	2.30
43	601288	农业银行	2,867,443.00	2.23
44	600000	浦发银行	2,687,860.71	2.09
45	002267	陕天然气	2,649,561.00	2.06

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	383,300,487.48
卖出股票收入（成交）总额	263,920,593.29

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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，本基金还可运用股指期货来对冲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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，报告编制日前一年内，江苏银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局江苏监管局处罚（苏金罚决字[2023]2号）；南京银行股份有限公司受到国家外汇管理局江苏省分局处罚（苏汇检罚[2023]4号）；厦门建发股份有限公司受到中国证券监督管理委员会厦门监管局处罚（厦门证监局[2024]7号）；中国农业银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局处罚（金罚决字[2023]21号、金罚决字[2023]8号、京汇罚[2023]32号）。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金采取量化选股策略。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,997.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,997.33

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 国企红利 量化股票 A	567	35,544.46	266,805.62	1.32%	19,886,905.43	98.68%
中信保诚 国企红利 量化股票 C	3,989	27,911.91	1,802,288.36	1.62%	109,538,327.82	98.38%
合计	4,556	28,861.79	2,069,093.98	1.57%	129,425,233.25	98.43%

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。

## 8.2 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	中信保诚国企红利量化股票 A	751,522.90	3.73%
	中信保诚国企红利量化股票 C	52,000.18	0.05%
	合计	803,523.08	0.61%

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。

## 8.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中信保诚国企红利量化股票 A	0
	中信保诚国企红利量化股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚国企红利量化股票 A	50~100
	中信保诚国企红利量化股票 C	0~10
	合计	50~100

注：期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金的基金份额。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚国企红利量化股票 A	中信保诚国企红利量化股票 C
基金合同生效日（2024 年 03 月 22 日）基金份额总额	28,580,573.97	277,819,224.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	315,427.72	1,016,688.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,742,290.64	167,495,296.50
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	20,153,711.05	111,340,616.18

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2024 年 3 月 26 日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
华泰证券	2	647,073,368.38	100.00%	489,260.38	100.00%	本报告期新增

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实

力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	1,249,400,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年03月23日
2	中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	同上	2024年05月30日
3	中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	同上	2024年06月28日
4	中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	同上	2024年06月28日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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						

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中信保诚国企红利量化选股股票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、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚国企红利量化选股股票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

### 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2024 年 08 月 29 日