

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
2021 年中期报告

2021 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 08 月 27 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 08 月 26 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	8
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	43

§ 8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	45
§ 9	开放式基金份额变动	45
§ 10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	47
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12	备查文件目录	49
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	中信保诚嘉鑫
基金主代码	005617
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018 年 01 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	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,165,306,058.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）类属资产配置策略</p> <p>在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。</p> <p>（2）普通债券投资策略</p> <p>对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>1) 目标久期控制</p> <p>本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产</p>

	<p>投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。</p> <p>2) 期限结构配置 在确定债券组合的久期之后，本基金将采用收益率曲线分析策略，自上而下进行期限结构配置。具体来说，本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹型、哑铃型、梯形等配置方法，确定在短、中、长期债券的投资比例。</p> <p>3) 信用利差策略 一般来说，信用债券的收益率主要由基准收益率与反应信用债券信用水平的信用利差组成。本基金将从宏观经济环境与信用债市场供需状况两个方面对市场信用利差进行分析。首先，对于宏观经济环境，当宏观经济向好时，企业盈利能力好，资金充裕，市场整体信用利差将可能收窄；当宏观经济恶化时，企业盈利能力差，资金紧缺，市场整体信用利差将可能扩大。其次，对于信用债市场供求，本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。</p> <p>4) 相对价值投资策略 本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。</p> <p>5) 回购放大策略 本基金将在控制杠杆风险的前提下，适当地通过回购融资来提高资金利用率，以增强组合收益。</p> <p>3、资产支持证券的投资策略 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来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。</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、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>6、开放期投资安排</p> <p>在开放期内，本基金将主要采用流动性管理策略进行基金投资管理。基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中信银行股份有限公司
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	95558
传真	021-50120888	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世	北京市朝阳区光华路 10 号

	纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	张翔燕	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	46,872,430.12
本期利润	144,062,586.71
加权平均基金份额本期利润	0.0234
本期加权平均净值利润率	2.22%
本期基金份额净值增长率	2.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	364,446,238.27
期末可供分配基金份额利润	0.0591
期末基金资产净值	6,578,552,036.91
期末基金份额净值	1.0670
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	16.60%

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。

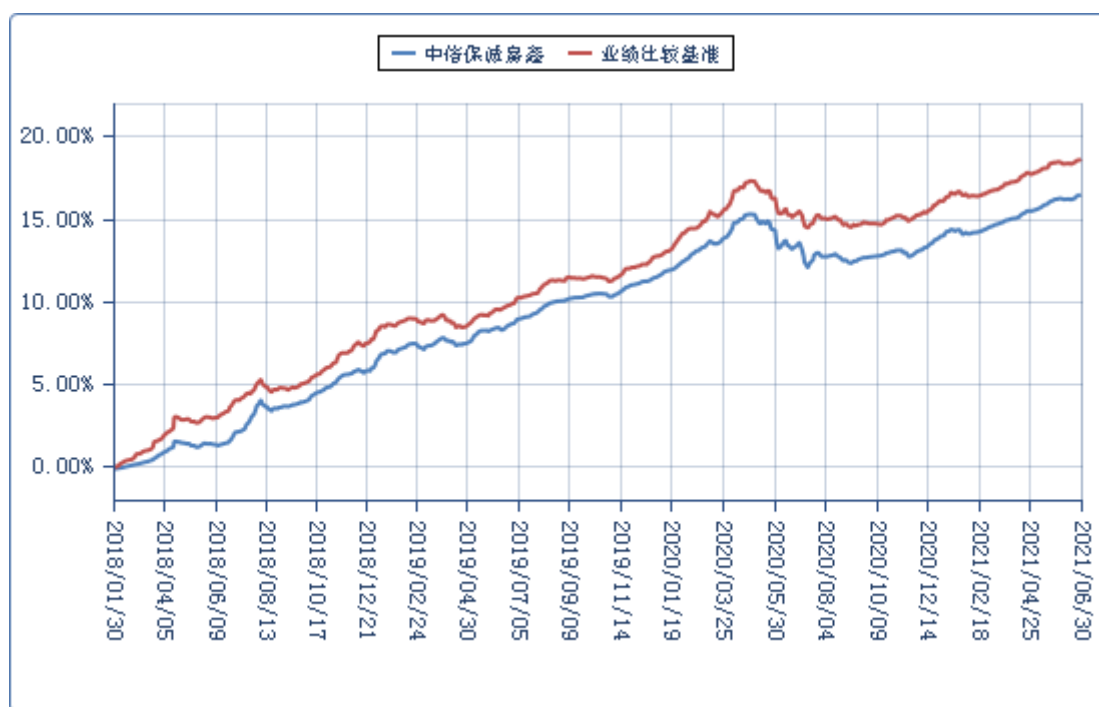
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	0.25%	0.03%	0.18%	0.03%	0.07%	0.00%
过去三个月	1.31%	0.02%	1.23%	0.03%	0.08%	-0.01%
过去六个月	2.23%	0.03%	2.19%	0.04%	0.04%	-0.01%
过去一年	2.64%	0.05%	2.84%	0.05%	-0.20%	0.00%
过去三年	14.61%	0.06%	14.46%	0.06%	0.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.60%	0.06%	18.77%	0.06%	-2.17%	0.00%

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



§ 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、英国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，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。

2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 76 只，分别为：信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、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、信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）、信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、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）、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（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）、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智慧金货币市场基金、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、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、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、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券

投资基金、中信保诚创新成长灵活配置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、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、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、中信保诚丰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 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚龙腾精选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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴胤希	固定收益部副总监、基金经理	2018 年 01 月 30 日	-	5	吴胤希先生，理学硕士。曾任职于远东国际租赁有限公司，担任投资分析师；于 Excel Markets 担任外汇交易员；于重庆农村商业银行股份有限公司，担任债券交易员。2016 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司。现任固定收益部副总监，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、信诚优质纯债债券型证券投资基金、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、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚嘉润

					66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚稳利债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、中信保诚稳丰债券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《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《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基金合同》、《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 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

2021 年上半年，随着疫苗接种持续推进，全球疫情整体改善，海外经济持续修复，国内出口保持较高景气度。国内方面，年内社融增速持续回落，生产仍处于相对高位，制造业投资逐渐修复，地产投资韧性犹存，居民消费缓慢回升。通胀方面，大宗商品价格上涨推动 PPI 持续超预期，但 CPI 在猪价压制下整体仍然较低。

货币政策方面，随着经济延续修复态势，央行货币政策正常化，强调以稳为主，更加注重对地产、地方政府隐性债务等结构性杠杆的控制。同时，信用风险持续存在，央行在流动性方面保持“不缺不溢”，上半年货币市场利率基本围绕政策利率小幅波动。7 月 9 日央行超预期全面降准，政策结构性宽松倾向加强，对中小微企业的支持进一步加强。

从债券市场看，上半年国内经济平稳复苏，流动性保持平稳，地方债发行低于预期，机构配置力量较强，10 年国债收益率基本在 3.0-3.3% 之间窄幅震荡；信用债方面，信用利差整体收窄，信用债市场整体情绪有所修复但尾部风险仍存；权益市场震荡分化，结构性行情较为明显，上半年沪深 300 上涨 0.24%，中证转债指数上涨 4.04%。

本基金在投资操作上，坚持高等级信用债，中短久期加杠杆的策略。上半年，基金杠杆率一直维持较高水平，总资产久期控制在 2 年左右的中性水平。未来，我们将继续坚持在保障基金资产本金安全和流动性的前提下为持有人争取有竞争力的收益。

4.4.2 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 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计海外经济将延续复苏趋势，重点关注美联储 QE 缩减进程。国内方面，当前经济呈现生产边际转弱，需求端修复结构分化特征。其中需求端的出口、房地产投资和基建投资有所回落，制造业投资和消费持续修复。下半年来看，全球供应链修复和高基数影响下，预计出口增速将有所回落，且净出口对经济的贡献将明显下降；在货币政策实际操作稳中趋松的情况下，社融增速下行速度或有所放缓；在实体经济层面，房地产投资和基建均将延续走弱，经济修复的内生动能主要来源于制造业投资和消费的修复幅度。在经济增长边际放缓的背景下，货币政策易松难紧，且针对下半年经济放缓的压力将采取结构性宽松的货币政策，以应对内外部不断上升的不确定性。

债券市场投资方面，超预期全面降准背景下，预计短期内资金面稳定性将进一步加强，长端利率有望小幅下行；信用方面，在信用分化环境中，仍然建议选择中高等级信用债进行投资，且当前信用期限利差较为陡峭，可以适当考虑资质较好的信用债的久期价值；权益方面，股债性价比显

示，当前沪深 300 相比债券而言仍然处于较贵区域，预计权益市场仍以结构性机会为主，将主要把握行业景气度和业绩增速较高且估值较为合理的个券。

基金投资操作上，我们考虑适当拉长久期，适当提高杠杆比例。信用债方面，由于今年是融资收缩的一年，不利于低评级债券，我们在持仓上也会坚持高等级信用债的配置方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导（委员会主席）、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管（委员会秘书）。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见，确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值决策委员会。

在每个估值日，本基金管理人的运营部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。

基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理，对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核，复核无误后，由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗，所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，具有基金从业人员资格。

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离，基金经理不直接参与或决定估值。

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注，在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时，可申请召开估值决策委员会临时会议，通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政

策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

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

中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会于 2019 年 12 月 16 日表决通过了《关于中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册有关事项的议案》。自本次持有人大会表决通过的下一工作日（即 2019 年 12 月 17 日）起，基金名称正式变更为“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”，修订后的《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基金合同》生效。自《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基金合同》生效之日起至本报告期末未满三年。本报告期内，不存在需要对本基金持有人数或基金资产净值进行预警的情形。

§ 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司在中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,318,559.30	578,695.13
结算备付金	-	17,574,424.85	1,641,583.36
存出保证金	-	20,873.80	28,112.94
交易性金融资产	6.4.7.2	8,592,322,340.00	8,334,747,000.00
其中：股票投资	-	-	-
基金投资	-	-	-
债券投资	-	8,398,397,340.00	7,762,021,000.00
资产支持证券投资	-	193,925,000.00	572,726,000.00
贵金属投资	-	-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	6.4.7.5	124,480,184.94	93,378,443.03
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	8,737,716,382.89	8,430,373,834.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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	-	2,155,096,007.34	1,990,121,303.81
应付证券清算款	-	-	-

应付赎回款	-	-	-
应付管理人报酬	-	1,618,743.05	1,627,303.60
应付托管费	-	539,581.04	542,434.53
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	49,915.52	65,144.34
应交税费	-	682,182.70	486,029.69
应付利息	-	884,725.20	2,763,168.29
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	293,191.13	279,000.00
负债合计	-	2,159,164,345.98	1,995,884,384.26
所有者权益：	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	6,165,306,058.60	6,165,306,058.60
未分配利润	6.4.7.10	413,245,978.31	269,183,391.60
所有者权益合计	-	6,578,552,036.91	6,434,489,450.20
负债和所有者权益总计	-	8,737,716,382.89	8,430,373,834.46

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.0670 元，基金份额总额 6,165,306,058.60 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入	-	179,311,375.75	157,604,821.90
1. 利息收入	-	133,439,152.98	169,857,515.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	76,308.08	1,859,894.45
债券利息收入	-	121,279,028.64	145,133,224.15
资产支持证券利息收入	-	11,935,293.40	22,101,275.49
买入返售金融资产收入	-	148,522.86	763,121.17
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	-51,317,933.82	177,714,419.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-51,317,933.82	177,698,822.22
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	15,596.96
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	97,190,156.59	-189,967,112.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用	-	35,248,789.04	42,064,178.14
1. 管理人报酬	-	9,668,498.21	9,732,968.28
2. 托管费	-	3,222,832.78	3,244,322.79
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	31,072.53	74,449.73
5. 利息支出	-	21,823,354.51	28,367,339.08
其中：卖出回购金融资产支出	-	21,823,354.51	28,367,339.08
6. 税金及附加	-	344,465.33	483,259.91
7. 其他费用	6.4.7.19	158,565.68	161,838.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	144,062,586.71	115,540,643.76
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	144,062,586.71	115,540,643.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,165,306,058.60	269,183,391.60	6,434,489,450.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	144,062,586.71	144,062,586.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,165,306,058.60	413,245,978.31	6,578,552,036.91
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,165,306,058.60	239,866,872.41	6,405,172,931.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	115,540,643.76	115,540,643.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,165,306,058.60	355,407,516.17	6,520,713,574.77

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：

<u>唐世春</u>	<u>陈逸辛</u>	<u>刘卓</u>
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

中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2018]61 号《关于准予信诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,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》、《证券投资基金运作管理办法》、《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》负责募集。本基金为契约型定期开放式,存续期不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,509,999,000.00 元,业经普华永道中天验字(2018)第 0087 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,509,999,000.00 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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2019 年 12 月 16 号召开基金份额持有人大会。根据此次会议议案、《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册方案说明书》,基金名称由“中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金”变更为“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”。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金以定期开放方式运作,即本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作。本基金的封闭期为自《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基金合同》生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)3 个月的期间,如果封闭期到期日的次日为非工作日,封闭期相应顺延。本基金自封闭期结束之后第 1 个工作日(包括该日)起进入开放期,

期间可以办理申购与赎回业务。每个开放期不少于 5 个工作日且不超过 20 个工作日。投资人办理基金份额的申购和赎回等业务的开放日为本基金开放期的每个工作日。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算。在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，开放期时间顺延，直至满足开放期的时间要求。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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基金合同》和最新公布的《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招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、证券公司短期公司债券、非金融企业债务融资工具、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场工具、国债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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。在每次开放期前 10 个工作日内、开放期和开放期后 10 个工作日内，不受上述投资组合比例限制。在开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受前述限制，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准：中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外，与最近一期年度报告相一致。

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[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	3,318,559.30
定期存款	-
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	-
合计	3,318,559.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	904,041,146.02	911,483,240.00
	银行间市场	7,464,139,411.33	7,486,914,100.00
	合计	8,368,180,557.35	8,398,397,340.00
资产支持证券	192,041,111.11	193,925,000.00	1,883,888.89
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,560,221,668.46	8,592,322,340.00	32,100,671.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	288.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7,908.50
应收债券利息	120,386,635.54
应收资产支持证券利息	4,085,342.85
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.40
合计	124,480,184.94

注：其他包括应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	49,915.52
合计	49,915.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	224,383.76
应付信息披露费	59,507.37

应付账户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	293,191.13

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,165,306,058.60	6,165,306,058.60
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,165,306,058.60	6,165,306,058.60

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）。

6.4.7.10 未分配利润

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	317,573,808.15	-48,390,416.55	269,183,391.60
本期利润	46,872,430.12	97,190,156.59	144,062,586.71
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	364,446,238.27	48,799,740.04	413,245,978.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
	活期存款利息收入
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	70,345.96
其他	155.53
合计	76,308.08

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益—买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-51,317,933.82
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	-51,317,933.82

6.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	3,777,534,718.32
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	3,783,524,317.02
减：应收利息总额	45,328,335.12
买卖债券差价收入	-51,317,933.82

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	392,222,234.00
减：卖出资产支持证券成本总额	379,866,000.00
减：应收利息总额	12,356,234.00
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	97,190,156.59
-- 股票投资	-
-- 债券投资	96,125,156.59
-- 资产支持证券投资	1,065,000.00
-- 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	97,190,156.59

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	225.53
银行间市场交易费用	30,847.00
合计	31,072.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,524.55
账户维护费	17,250.00
其他	900.00
合计	158,565.68

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（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人

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

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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。

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,668,498.21	9,732,968.28
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.30% 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×0.30%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,222,832.78	3,244,322.79

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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×0.10%/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。

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

份额单位：份

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 01 月 30 日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	0.16%	0.16%

注：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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
中信银行	6,155,306,058.60	99.84%	6,155,306,058.60	99.84%

注：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。

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	3,318,559.30	5,806.59	6,997,106.12	21,356.17

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末 2021 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

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。

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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金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 1,515,096,007.34 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
091918002	19 农发清发 02	2021 年 07 月 07 日	100.45	1,000,000	100,450,000.00
092018001	20 农发清发 01	2021 年 07 月 01 日	99.86	1,063,000	106,151,180.00
092018001	20 农发清发 01	2021 年 07 月 05 日	99.86	724,000	72,298,640.00
092018001	20 农发清发 01	2021 年 07 月 06 日	99.86	1,369,000	136,708,340.00
092018003	20 农发清	2021 年 07 月	100.67	890,000	89,596,300.00

	发 03	06 日			
092018003	20 农发清发 03	2021 年 07 月 07 日	100.67	150,000	15,100,500.00
112106078	21 交通银行 CD078	2021 年 07 月 06 日	97.12	1,800,000	174,816,000.00
112114040	21 江苏银行 CD040	2021 年 07 月 07 日	97.06	326,000	31,641,560.00
200302	20 进出 02	2021 年 07 月 07 日	99.67	100,000	9,967,000.00
200312	20 进出 12	2021 年 07 月 01 日	100.40	1,135,000	113,954,000.00
200312	20 进出 12	2021 年 07 月 06 日	100.40	2,100,000	210,840,000.00
200312	20 进出 12	2021 年 07 月 07 日	100.40	765,000	76,806,000.00
2028020	20 兴业银行小微债 03	2021 年 07 月 01 日	99.09	1,100,000	108,999,000.00
210004	21 付息国债 04	2021 年 07 月 07 日	100.22	450,000	45,099,000.00
210205	21 国开 05	2021 年 07 月 01 日	101.25	425,000	43,031,250.00
210205	21 国开 05	2021 年 07 月 06 日	101.25	800,000	81,000,000.00
210205	21 国开 05	2021 年 07 月 07 日	101.25	580,000	58,725,000.00
210210	21 国开 10	2021 年 07 月 01 日	99.36	1,000,000	99,360,000.00
210210	21 国开 10	2021 年 07 月 07 日	99.36	100,000	9,936,000.00
合计				15,877,000	1,584,479,770.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 640,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 06 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。

公司风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计与风控委员会）、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等。董事会下设审计与风控委员会，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 and 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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	754,231,000.00	319,873,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	960,520,300.00	1,171,904,000.00
合计	1,714,751,300.00	1,491,777,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	50,000,000.00	49,960,000.00
未评级	-	-
合计	50,000,000.00	49,960,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	873,600,000.00	291,090,000.00
合计	873,600,000.00	291,090,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	3,448,282,240.00	3,183,007,000.00
AAA 以下	983,796,000.00	449,767,000.00
未评级	1,377,967,800.00	2,346,380,000.00
合计	5,810,046,040.00	5,979,154,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的

债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	143,925,000.00	522,766,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	143,925,000.00	522,766,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

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及上年度末均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于开放期内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,除所持有的卖出回购金融资产款将在一年以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所持有的其他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(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约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》且于基金开放期内按照《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、流通受限制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%。于开放期内，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。于开放期内，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%。

于开放期内，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。

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。

本报告期末，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。

本基金持有有一定比例的交易所及银行间市场交易的固定收益品种, 因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2021 年 06 月 30 日	1 个月内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,318,559.30	-	-	-	-	-	3,318,559.30
结算备付金	17,574,424.85	-	-	-	-	-	17,574,424.85
存出保证金	20,873.80	-	-	-	-	-	20,873.80
交易性金融资产	241,489,000.00	725,100,000.00	3,658,521,540.00	3,605,537,800.00	361,674,000.00	-	8,592,322,340.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	124,480,184.94	124,480,184.94
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	262,402,857.95	725,100,000.00	3,658,521,540.00	3,605,537,800.00	361,674,000.00	124,480,184.94	8,737,716,382.89
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	2,155,096.07	-	-	-	-	-	2,155,096.07

款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,618,743.05	1,618,743.05
应付托管费	-	-	-	-	-	539,581.04	539,581.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,915.52	49,915.52
应交税费	-	-	-	-	-	682,182.70	682,182.70
应付利息	-	-	-	-	-	884,725.20	884,725.20
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	293,191.13	293,191.13
负债总计	2,155,096,007.34	-	-	-	-	4,068,338.64	2,159,164,345.98
利率敏感度缺口	1,892,693,149.39	725,100,000.00	3,658,521,540.00	3,605,537,800.00	361,674,000.00	120,411,846.30	6,578,552,036.91
上年度末 2020 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							
银行存款	578,695.13	-	-	-	-	-	578,695.13
结算备付金	1,641,583.36	-	-	-	-	-	1,641,583.36
存出保证金	28,112.94	-	-	-	-	-	28,112.94
交易性金融资产	1,671,000.00	200,430,000.00	3,209,792,000.00	4,603,464,000.00	319,390,000.00	-	8,334,747,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	93,378.44	93,378,443.

						3.03	03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,919,391.43	200,430,000.00	3,209,792,000.00	4,603,464,000.00	319,390,000.00	93,378,443.03	8,430,373,834.46
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	1,990,121,303.81	-	-	-	-	-	1,990,121,303.81
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,627,303.60	1,627,303.60
应付托管费	-	-	-	-	-	542,434.53	542,434.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	65,144.34	65,144.34
应交税费	-	-	-	-	-	486,029.69	486,029.69
应付利息	-	-	-	-	-	2,763,168.29	2,763,168.29
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	279,000.00	279,000.00
负债总计	1,990,121,303.81	-	-	-	-	5,763,080.45	1,995,884,384.26
利率敏感度缺口	1,986,201,912.38	200,430,000.00	3,209,792,000.00	4,603,464,000.00	319,390,000.00	87,615,362.58	6,434,489,450.20

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

假设	除市场利率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（2021 年 06 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	30,689,080.34	33,691,984.48
市场利率上升 25 个基点	-30,274,043.84	-33,362,694.21	

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。

本基金未持有证券交易所上市股票,因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于本报告期末及上年度末,本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末,本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债。因此其他价格风险的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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中属于第二层次的余额为 8,592,322,340.00 元，无属于第一或第三层次的余额(上年度末：第二层次

8,334,747,000.00 元，无第一或第三层次)

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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(上年度末：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,592,322,340.00	98.34

	其中：债券	8,398,397,340.00	96.12
	资产支持证券	193,925,000.00	2.22
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	20,892,984.15	0.24
8	其他各项资产	124,501,058.74	1.42
9	合计	8,737,716,382.89	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

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未进行股票买入交易。

7.4.2 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

本基金本报告期末未进行股票卖出交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票买卖交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	50,110,000.00	0.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,840,544,800.00	27.98
	其中：政策性金融债	1,287,855,800.00	19.58
4	企业债券	911,483,240.00	13.86
5	企业短期融资券	1,714,751,300.00	26.07

6	中期票据	3,007,908,000.00	45.72
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	873,600,000.00	13.28
9	其他	-	-
10	合计	8,398,397,340.00	127.66

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200312	20 进出 12	4,000,000	401,600,000.00	6.10
2	2028015	20 兴业银行小微债 01	3,500,000	344,540,000.00	5.24
3	092018001	20 农发清发 01	3,300,000	329,538,000.00	5.01
4	112106078	21 交通银行 CD078	3,000,000	291,360,000.00	4.43
5	112114040	21 江苏银行 CD040	3,000,000	291,180,000.00	4.43

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	137070	中借 03A	1,000,000	101,880,000.00	1.55
2	169664	蚁借 01A	500,000	50,000,000.00	0.76
3	165644	PR 安吉 4A	1,000,000	26,580,000.00	0.40
4	165814	PR 安吉 5A	500,000	15,465,000.00	0.24

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

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

兴业银行股份有限公司于 2020 年 8 月 31 日、2020 年 9 月 4 日分别受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），因向同业投资用途不合规等违法违规行为被没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元；因向无证机构提供转接清算服务等违法违规行为被给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。根据 2021 年 1 月 11 日银保监会消费者权益保护局发布的《关于兴业银行互联网保险销售违规问题的通报》（银保监消保发〔2021〕2 号），兴业银行因互联网保险销售行为存在未充分履行《保险法》规定的提示和明确说明义务、可回溯管理不健全等问题被通报批评。

江苏银行股份有限公司于 2020 年 12 月 30 日受到江苏银保监局处罚（苏银保监罚决字〔2020〕88 号），因个人贷款资金用途管控不严等违法违规事实被罚款人民币 240 万元。

重庆农村商业银行股份有限公司分别于 2020 年 8 月 4 日、2020 年 9 月 2 日受到重庆银保监局两份处罚（渝银保监罚决字〔2020〕41 号、渝银保监罚决字〔2020〕42 号），因通过信托计划回购实现不良资产虚假转让出表、未严格监控贷款资金流向致部分贷款被土储机构使用等违法违规事实共计罚款人民币 270 万元。

国家开发银行于 2020 年 10 月 26 日分别收到国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚（京汇罚〔2020〕32 号、京汇罚〔2020〕33 号），因违反银行交易记录管理规定被处 60 万元人民币罚款，因违规开展外汇交易被处 60 万元人民币罚款。又于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕67 号），因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规事实被罚款 4880 万元。

对“20 兴业银行小微债 01、21 江苏银行 CD040、20 重庆农村商行 CD256、21 国开 05、20 兴业银行小微债 03”投资决策程序的说明：基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该等投资标的的信用资质，我们认为，上述处罚事项未对该等发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，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。

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

本基金本报告期末未持有股票投资，没有超过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	20,873.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	124,480,184.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	124,501,058.74

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

本基金本报告期末未持有股票投资，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

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
2	3,082,653,029.30	6,165,306,058.60	100.00%	-	-

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末本基金管理人的从业人员未持有本基金的基金份额。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理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

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.16%	10,000,000.00	0.16%	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.16%	10,000,000.00	0.16%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年01月30日）基金份额总额	5,509,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	6,165,306,058.60
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-

本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	6,165,306,058.60

§ 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，胡喆女士、韩海平先生于 2021 年 5 月 21 日新任中信保诚基金管理有限公司副总经理职务，上述事项已按监管要求备案并公告。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-

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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	224,000,764.77	100.00%	11,928,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十一个开放期开放申购、赎回业务的公告	《证券时报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年01月14日
2	中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发	同上	2021年01月22日

	起式证券投资基金 2020 年第四季度报告		
3	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	同上	2021年01月22日
4	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 2020 年年度报告	同上	2021年03月26日
5	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	同上	2021年03月26日
6	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 2021 年第一季度报告	同上	2021年04月21日
7	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	同上	2021年04月21日
8	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基金合同修改前后文对照表	同上	2021年05月06日
9	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招募说明书	同上	2021年05月06日
10	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托管协议	同上	2021年05月06日
11	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基金合同	同上	2021年05月06日
12	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基金产品资料概要更新	同上	2021年05月06日
13	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第十二个开放期开放申购、赎回业务的公告	同上	2021年05月06日
14	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并修改基金合同及托管协议的公告	同上	2021年05月06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	1	2021-01-01 至 2021-06-30	6,155,306,058.60	-	-	6,155,306,058.60	99.84%

个人							
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 5 月 6 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金就增加侧袋机制调整了基金合同、托管协议、招募说明书（更新）及基金产品资料概要。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、（原）中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式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、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 4、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招募说明书
- 5、（原）中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 6、（原）中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 7、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。

中信保诚基金管理有限公司
2021 年 08 月 27 日