

中信保诚红利精选混合型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	8
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合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对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）	16
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	49
7.1	期末基金资产组合情况	49
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	50
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	57
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12	投资组合报告附注	58

§ 8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9	开放式基金份额变动	60
§ 10	重大事件揭示	60
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8	其他重大事件	63
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚红利精选混合型证券投资基金	
基金简称	中信保诚红利精选	
基金主代码	008091	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 25 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	237,138,696.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信保诚红利精选 A	中信保诚红利精选 C
下属分级基金的交易代码	008091	008092
报告期末下属分级基金的份额总额	106,900,312.74 份	130,238,383.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极把握红利主题股票的投资机会，力争获得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>本基金主要通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、港股、债券、现金、金融衍生品等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的回报。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）红利主题股票的界定</p> <p>本基金所称红利主题股票指的是基本面良好、盈利能力较强、分红稳定或分红预期高、或进行股份回购的上市公司股票。本基金将深度挖掘这些红利主题股票的投资机会，并根据以下条件建立基础库。满足以下一项或多项条件的股票可以入选基础库：</p> <p>1) 稳定的分红历史。最近 3 年至少 2 年都进行现金分红；或最近 5 年至少 3 年都进行现金分</p>

	<p>红；对上市不足 3 年的公司，上市后每个完整会计年度均有现金分红或现金分红预案。</p> <p>2) 较高的分红预期：公司具有较好的资产负债和现金流情况，潜在分红预期高。</p> <p>3) 股份回购：过去一段时间进行过股份回购，或发布股份回购预案未来即将进行股份回购的公司。</p> <p>(2) 个股精选</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，选择其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，选择安全边际较高的个股。</p> <p>由于本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，因而本基金将在前述股票投资策略的基础上选择安全边际较高的港股通标的股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</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>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p>
--	--

	<p>6、股指期货投资策略 基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、国债期货投资策略 本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>8、股票期权投资策略 本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>9、融资投资策略 本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的，本基金将从其最新规定。</p> <p>10、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证红利指数收益率*70%+中证港股通高股息投资指数收益率*10%+中证综合债指数收益率*20%</p>

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	许俊
	联系电话	021-68649788	010-66594319
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张翔燕	刘连舸

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（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）	
	中信保诚红利精选 A	中信保诚红利精选 C
本期已实现收益	16,315,393.60	27,086,369.73
本期利润	9,718,436.65	15,931,672.12

加权平均基金份额本期利润	0.1170	0.1146
本期加权平均净值利润率	7.87%	7.76%
本期基金份额净值增长率	5.17%	4.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 06 月 30 日)	
	中信保诚红利精选 A	中信保诚红利精选 C
期末可供分配利润	52,355,987.28	62,615,965.90
期末可供分配基金份额利润	0.4898	0.4808
期末基金资产净值	159,256,300.02	192,854,349.42
期末基金份额净值	1.4898	1.4808
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 06 月 30 日)	
	中信保诚红利精选 A	中信保诚红利精选 C
基金份额累计净值增长率	48.98%	48.08%

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

中信保诚红利精选 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	-1.83%	0.60%	-1.09%	0.51%	-0.74%	0.09%
过去三个月	1.00%	0.68%	4.29%	0.53%	-3.29%	0.15%
过去六个月	5.17%	0.96%	9.62%	0.71%	-4.45%	0.25%
过去一年	44.19%	1.03%	18.79%	0.83%	25.40%	0.20%
自基金合同生效起至今	48.98%	0.95%	13.37%	0.93%	35.61%	0.02%

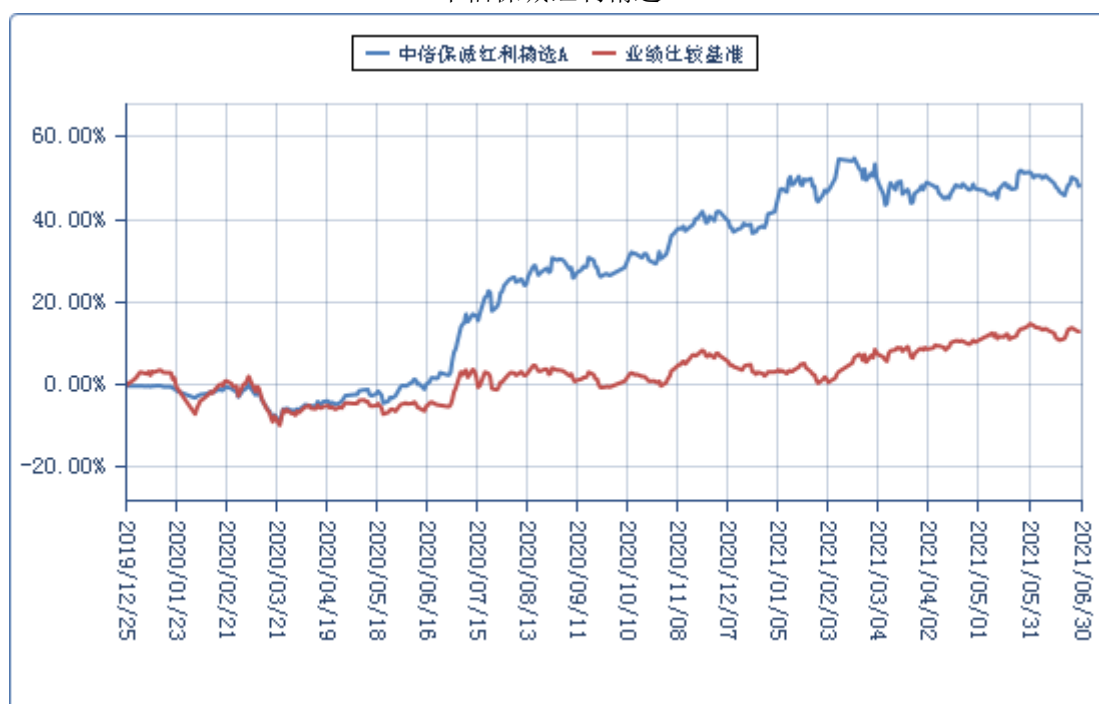
中信保诚红利精选 C

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	-1.86%	0.61%	-1.09%	0.51%	-0.77%	0.10%
过去三个月	0.90%	0.68%	4.29%	0.53%	-3.39%	0.15%
过去六个月	4.96%	0.96%	9.62%	0.71%	-4.66%	0.25%
过去一年	43.63%	1.03%	18.79%	0.83%	24.84%	0.20%
自基金合同生效起至今	48.08%	0.95%	13.37%	0.93%	34.71%	0.02%

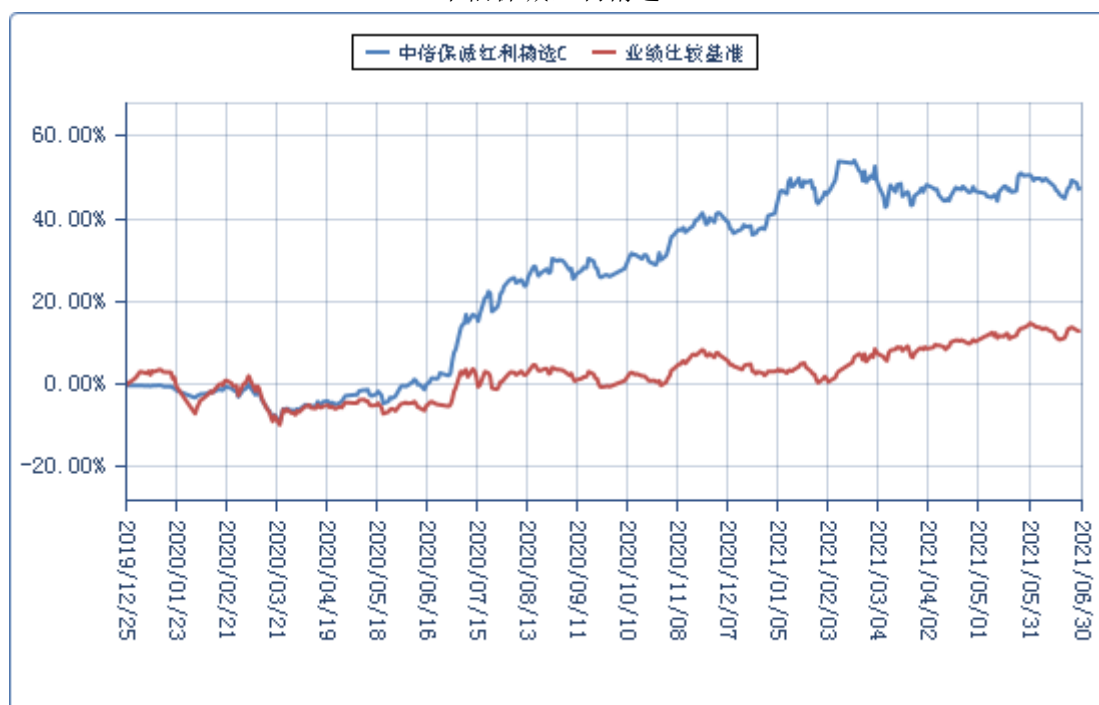
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收

收益率变动的比较

中信保诚红利精选 A



中信保诚红利精选 C



§ 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		
提云涛	量化投资总监、本基金的基金经理	2019 年 12 月 25 日	-	21	提云涛先生，经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于东方证券有限责任公司，担任研究所所长助理；于上海申银万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，担任量化投资总监。现兼任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、信诚新选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)、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业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《中信保诚红利精选混合型证券投资基金基金合同》、《中信保诚红利精选混合型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

上半年，国内社会生活进一步恢复正常，经济恢复加快，制造业 PMI 一直处于景气扩张区间，工业企业利润、居民收入都保持了较快增长。由于基数原因，一季度增速明显高于二季度，制造业 PMI 虽然处于扩张区间但也前高后低。海外，随着疫苗接种推广，各国社会经济活动逐步加速。在经济恢复下，大宗商品价格在一季度也出现了明显上涨，加重了市场对通胀的预期。

股票市场，A 股整体成冲高、回落、盘整、再逐步走高的趋势。从规模上看，大小盘呈分化趋势，上半年沪深 300 微涨 0.24%、中证 500 涨 6.93%、中证 1000 涨 6.58%；从行业看，新能源、半导体等新兴产业以及钢铁、煤炭、有色等资源品涨幅明显，传统的金融地产、食品饮料、家电表现不佳。

上半年，本基金从基本面出发采用“量化+主动”的方法选择个股。一方面，配置低估值高股息的银行、地产、交通运输、公用事业等行业的龙头公司作为防御组合；另外，配置医药、电子等虽然估值较高但长期预期增长较高的行业的公司，配置家电、化工等龙头公司。同时，在可能的情况下积极参与网下新股申购等投资以增强收益。因为低配钢铁、煤炭等周期性公司，表现不及预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚红利精选 A 份额净值增长率为 5.17%，同期业绩比较基准收益率为 9.62%；中信保诚红利精选 C 份额净值增长率为 4.96%，同期业绩比较基准收益率为 9.62%。

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，尽管新冠病毒变异仍可能会干扰社会生活和经济，但预计社会将进一步复苏和回归常态。国内经济经过前面快速恢复，后续增长可能放缓；欧美等经济体因经济恢复滞后，预期继续保持前期速度。从政策看，国内政策可能继续保持稳健。但是如果有向下扰动，不排除适当积极。海外，随着经济恢复，政策可能逐步从宽松向中性回归。股票市场，新能源半导体等新兴行业公司的盈利仍将保持增长，但是估值偏高，预期后续波动加大；传统价值蓝筹行业经过前期调整，风险进一步释放，预计后续将有所表现。从结构上看，一方面，低估值优质蓝筹股仍能赚取长期盈利的收益；另一方面，前期涨幅较大的新兴行业公司股票如果估值趋于合理后也可以作为长期配置标的。

下半年，一方面，坚持“与好公司共成长”的策略，兼顾当前估值和红利以及未来红利增长，从公司治理、企业文化、经验稳健性等视角选择好公司。另一方面，在传统行业、新兴行业等寻找

预期未来盈利和分红都稳定增长且估值相对合适股票构建积极组合获取预期增长的收益。同时，综合考虑个股的估值与盈利增长匹配情况在预期可控范围内适当积极调整组合。另外，在可能的情况下积极参与网下新股申购等投资以增强收益。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在中信保诚红利精选混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《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有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 本托管人根据《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, 对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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：中信保诚红利精选混合型证券投资基金

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	7,694,566.31	28,345,731.84
结算备付金	-	5,622,490.85	5,135,415.15
存出保证金	-	70,475.55	704,196.76
交易性金融资产	6.4.7.2	338,399,116.73	480,826,210.25
其中：股票投资	-	326,018,736.73	452,869,160.25
基金投资	-	-	-
债券投资	-	12,380,380.00	27,957,050.00
资产支持证券投资	-	-	-
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	-	600,709.56	206,785.87
应收利息	6.4.7.5	251,240.98	398,296.92
应收股利	-	21,280.00	-
应收申购款	-	569,392.61	130,400.26
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	353,229,272.59	515,747,037.05
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	-	-	-
应付证券清算款	-	0.09	283,302.68
应付赎回款	-	311,715.32	3,012,608.68
应付管理人报酬	-	448,719.40	633,477.50
应付托管费	-	74,786.56	105,579.58
应付销售服务费	-	64,957.02	103,595.89
应付交易费用	6.4.7.7	109,087.74	328,839.92
应交税费	-	0.38	11,902.81
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	109,356.64	217,775.98

负债合计	-	1,118,623.15	4,697,083.04
所有者权益：	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	237,138,696.26	361,703,680.60
未分配利润	6.4.7.10	114,971,953.18	149,346,273.41
所有者权益合计	-	352,110,649.44	511,049,954.01
负债和所有者权益总计	-	353,229,272.59	515,747,037.05

注：截止本报告期末，基金份额总额 237,138,696.26 份。下属分级基金：中信保诚红利精选 A 的基金份额净值 1.4898 元，基金份额总额 106,900,312.74 份；中信保诚红利精选 C 的基金份额净值 1.4808 元，基金份额总额 130,238,383.52 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚红利精选混合型证券投资基金

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	-	29,805,049.86	10,493,636.47
1. 利息收入	-	196,377.80	1,364,081.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	56,622.16	459,813.74
债券利息收入	-	139,755.64	127,956.02
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	776,311.59
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	46,771,134.33	4,222,871.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,040,198.21	-62,330.04
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	151,522.88	-30,880.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	230,604.72	249,203.88
股利收益	6.4.7.15	3,348,808.52	4,066,878.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-17,751,654.56	4,750,853.22
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	589,192.29	155,830.10
减：二、费用	-	4,154,941.09	3,699,305.08
1. 管理人报酬	-	2,460,171.61	2,455,989.57
2. 托管费	-	410,028.59	409,331.58
3. 销售服务费	-	409,124.11	178,158.08

4. 交易费用	6.4.7.18	753,576.59	522,276.58
5. 利息支出	-	216.99	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	216.99	-
6. 税金及附加	-	831.05	897.33
7. 其他费用	6.4.7.19	120,992.15	132,651.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	25,650,108.77	6,794,331.39
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	25,650,108.77	6,794,331.39

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信保诚红利精选混合型证券投资基金

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）	361,703,680.60	149,346,273.41	511,049,954.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,650,108.77	25,650,108.77
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）	-124,564,984.34	-60,024,429.00	-184,589,413.34
其中：1. 基金申购款	158,315,842.82	74,672,944.83	232,988,787.65
2. 基金赎回款	-282,880,827.16	-134,697,373.83	-417,578,200.99
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）	237,138,696.26	114,971,953.18	352,110,649.44
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）	359,445,956.14	13,847.81	359,459,803.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,794,331.39	6,794,331.39
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）	-127,409,641.34	786,075.65	-126,623,565.69
其中：1. 基金申购款	1,078,355.08	-18,417.01	1,059,938.07
2. 基金赎回款	-128,487,996.42	804,492.66	-127,683,503.76
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）	232,036,314.80	7,594,254.85	239,630,569.65

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：

唐世春

基金管理人负责人

陈逸辛

主管会计工作负责人

刘卓

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚红利精选混合型证券投资基金(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”)《关于准予中信保诚红利精选混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2019】1646号)批准,由中信保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》及其配套法规和《中信保诚红利精选混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2019年12月25日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币359,445,956.14元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《中信保诚红利精选混合型证券投资基金基金合同》和《中信保诚红利精选混合型证券投资基金招募说明书》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(包含中小板、创业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、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)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为60%—95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%,投资于红利主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%;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、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证红利指数收益率*70%+中证港股通高股息投资指数收益率*10%+中证综合债指数收益率*20%。

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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103 号文《关于

股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股

息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	7,694,566.31
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	7,694,566.31

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	318,553,323.30	326,018,736.73	7,465,413.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	12,306,885.71	12,380,380.00	73,494.29
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,306,885.71	12,380,380.00	73,494.29
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	330,860,209.01	338,399,116.73	7,538,907.72	

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	1,202.74
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	2,572.36
应收债券利息	247,437.35
应收资产支持证券利息	-
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	28.53
合计	251,240.98

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	109,087.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	109,087.74

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	718.29
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,630.98
应付信息披露费	59,507.37
应付账户维护费	4,500.00
合计	109,356.64

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 实收基金

中信保诚红利精选 A

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	132,104,619.44	132,104,619.44
本期申购	76,338,584.34	76,338,584.34
本期赎回（以“-”号填列）	-101,542,891.04	-101,542,891.04
本期末	106,900,312.74	106,900,312.74

中信保诚红利精选 C

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	229,599,061.16	229,599,061.16
本期申购	81,977,258.48	81,977,258.48
本期赎回（以“-”号填列）	-181,337,936.12	-181,337,936.12
本期末	130,238,383.52	130,238,383.52

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

中信保诚红利精选 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	39,047,511.75	15,977,715.46	55,025,227.21
本期利润	16,315,393.60	-6,596,956.95	9,718,436.65
本期基金份额交易产生的变动数	-2,878,922.39	-9,508,754.19	-12,387,676.58
其中：基金申购款	33,957,328.18	2,369,866.81	36,327,194.99
基金赎回款	-36,836,250.57	-11,878,621.00	-48,714,871.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,483,982.96	-127,995.68	52,355,987.28

中信保诚红利精选 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	66,639,541.56	27,681,504.64	94,321,046.20
本期利润	27,086,369.73	-11,154,697.61	15,931,672.12
本期基金份额交易产生的变动数	-30,985,492.43	-16,651,259.99	-47,636,752.42
其中：基金申购款	32,129,286.18	6,216,463.66	38,345,749.84
基金赎回款	-63,114,778.61	-22,867,723.65	-85,982,502.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,740,418.86	-124,452.96	62,615,965.90

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	33,551.38
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	22,347.27
其他	723.51
合计	56,622.16

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

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	295,645,800.71
减：卖出股票成本总额	252,605,602.50
买卖股票差价收入	43,040,198.21

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	151,522.88
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	151,522.88
----	------------

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	16,716,403.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,279,914.29
减：应收利息总额	284,966.74
买卖债券差价收入	151,522.88

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年06月30日
股指期货投资收益	230,604.72

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,348,808.52
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	3,348,808.52

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	-17,520,603.08
--股票投资	-17,543,047.37
--债券投资	22,444.29
--资产支持证券投资	-

--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-238,842.86
--权证投资	-
--期货投资	-238,842.86
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-7,791.38
合计	-17,751,654.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	588,747.96
转换费收入	444.33
合计	589,192.29

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。

6.4.7.18 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	753,445.82
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	130.77
合计	753,576.59

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,853.80
账户维护费	9,000.00
合计	120,992.15

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	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	2,460,171.61	2,455,989.57
其中：支付销售机构的客户维护费	711,596.49	1,375,021.61

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 1.50% 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×1.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年 06月30日	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	410,028.59	409,331.58

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/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		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信保诚红利精选 A	中信保诚红利精 选C	合计
中信保诚基金	-	174,999.61	174,999.61
中国银行	-	10,977.90	10,977.90
合计	-	185,977.51	185,977.51
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	中信保诚红利精选	中信保诚红利精	合计

	A	选 C	
中信保诚基金	-	-	-
中国银行	-	15,481.64	15,481.64
合计	-	15,481.64	15,481.64

注：本基金中信保诚红利精选 A 基金份额不收取销售服务费，中信保诚红利精选 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

中信保诚红利精选 C 的销售服务费按前一日中信保诚红利精选 C 资产净值的 0.40%年费率计提。

计算公式为：中信保诚红利精选 C 基金日销售服务费=中信保诚红利精选 C 基金份额前一日资产净值×0.40%/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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行，本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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本基金基金合同公布的费率执行，本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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
中国银行	7,694,566.31	33,551.38	18,398,518.51	132,091.27

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国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

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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021 年 05 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	锁定期股票	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 07 月 02 日	锁定期股票	24.60	163.00	515	12,669.00	83,945.00	-
30092	博俊	2020 年	2021	锁定期	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

6	科技	12月29日	2021年07月12日	股票						
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年07月07日	锁定期股票	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年01月12日	2021年07月21日	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年01月13日	2021年07月21日	锁定期股票	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300932	三友联众	2021年01月15日	2021年07月22日	锁定期股票	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年01月15日	2021年07月22日	锁定期股票	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年01月20日	2021年07月27日	锁定期股票	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年01月27日	2021年08月03日	锁定期股票	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021年02月02日	2021年08月09日	锁定期股票	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年02月03日	2021年08月10日	锁定期股票	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年02月03日	2021年08月10日	锁定期股票	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

300948	冠中生态	2021年02月18日	2021年08月25日	锁定期股票	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年02月24日	2021年09月03日	锁定期股票	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年03月03日	2021年09月13日	锁定期股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年03月11日	2021年09月22日	锁定期股票	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年03月16日	2021年09月24日	锁定期股票	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年03月16日	2021年09月27日	锁定期股票	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年03月18日	2021年09月27日	锁定期股票	47.33	251.96	198	9,371.34	49,888.08	-
300958	建工修复	2021年03月18日	2021年09月29日	锁定期股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300961	深水海纳	2021年03月23日	2021年09月30日	锁定期股票	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年03月29日	2021年10月11日	锁定期股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年03月30日	2021年10月11日	锁定期股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

			日							
300966	共同药业	2021年03月31日	2021年10月11日	锁定期股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年04月02日	2021年10月13日	锁定期股票	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年04月06日	2021年10月15日	锁定期股票	6.87	12.07	1,152	7,914.24	13,904.64	-
300971	博亚精工	2021年04月07日	2021年10月15日	锁定期股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年04月08日	2021年10月19日	锁定期股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年04月08日	2021年10月15日	锁定期股票	28.28	115.71	240	6,787.20	27,770.40	-
300975	商络电子	2021年04月14日	2021年10月21日	锁定期股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年04月15日	2021年10月26日	锁定期股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年04月15日	2021年10月26日	锁定期股票	33.22	87.50	375	12,457.50	32,812.50	-
300982	苏文电能	2021年04月19日	2021年10月27日	锁定期股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年04月21日	2021年11月	锁定期股票	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

		日	月 01 日							
300987	川网传媒	2021年 04月28 日	2021 年11 月11 日	锁定期 股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年 05月12 日	2021 年11 月22 日	锁定期 股票	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年 05月17 日	2021 年11 月25 日	锁定期 股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021年 05月17 日	2021 年11 月26 日	锁定期 股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 05月26 日	2021 年12 月03 日	锁定期 股票	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年 05月26 日	2021 年12 月02 日	锁定期 股票	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年 05月25 日	2021 年12 月02 日	锁定期 股票	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 05月27 日	2021 年12 月07 日	锁定期 股票	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年 06月18 日	2021 年12 月27 日	锁定期 股票	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年 06月04 日	2021 年12 月16 日	锁定期 股票	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
30101	晶雪	2021年	2021	锁定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

0	节能	06月09日	2021年12月20日	股票						
301011	华立科技	2021年06月09日	2021年12月17日	锁定期股票	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年06月15日	2021年12月22日	锁定期股票	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年06月21日	2021年12月29日	锁定期股票	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	锁定期股票	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	锁定期股票	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新发未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	锁定期股票	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2021年07月06日	新发未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	锁定期股票	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年06月28日	2021年07月06日	新发未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	锁定期股票	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021年06月02日	2021年12月10日	锁定期股票	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021年06月29日	2021年07月07日	新发未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年06月28日	2021年07月06日	新发未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021年05月12日	2021年11月22日	锁定期股票	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021年06月30日	2021年07月09日	新发未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021年03月12日	2021年09月22日	锁定期股票	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688183	生益电子	2021年02月10日	2021年08月25日	锁定期股票	12.42	14.19	9,932	123,355.44	140,935.08	-
688201	信安世纪	2021年04月13日	2021年10月21日	锁定期股票	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688226	威腾电气	2021年06月28日	2021年07月07日	新发未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年06月25日	2021年07月05日	新发未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-

			日							
688316	青云科技	2021年03月05日	2021年09月16日	锁定期股票	63.70	65.00	1,333	84,912.10	86,645.00	-
688499	利元亨	2021年06月23日	2021年07月01日	新发未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688538	和辉光电	2021年05月20日	2021年11月29日	锁定期股票	2.65	3.38	94,689	250,925.85	320,048.82	-
688601	力芯微	2021年06月18日	2021年12月28日	锁定期股票	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688662	富信科技	2021年03月25日	2021年10月08日	锁定期股票	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688682	霍莱沃	2021年04月13日	2021年10月20日	锁定期股票	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
688685	迈信林	2021年04月30日	2021年11月15日	锁定期股票	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688700	东威科技	2021年06月07日	2021年12月15日	锁定期股票	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年06月15日	2021年07月01日	新发未上市	100.00	100.00	3,060	306,000.00	306,000.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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。

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	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,001,200.00	25,482,050.00
合计	12,001,200.00	25,482,050.00

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

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及上年度末均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

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	306,000.00	2,475,000.00
AAA 以下	73,180.00	-
未评级	-	-
合计	379,180.00	2,475,000.00

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

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(所有者权益)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发行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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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 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	7,694,566.31	-	-	-	-	-	7,694,566.31
结算备付金	5,622,490.85	-	-	-	-	-	5,622,490.85
存出保证金	70,475.55	-	-	-	-	-	70,475.55
交易性金融资产	12,001,200.00	-	-	-	379,180.00	326,018,736.73	338,399,116.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	600,709.56	600,709.56
应收利息	-	-	-	-	-	251,240.98	251,240.98
应收股利	-	-	-	-	-	21,280.00	21,280.00
应收申购款	-	-	-	-	-	569,392.61	569,392.61
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	25,388,732.71	-	-	-	379,180.00	327,461,359.88	353,229,272.59
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							
应付证券清算款						0.09	0.09
应付赎回款						311,715.32	311,715.32
应付管理人报酬						448,719.40	448,719.40
应付托管费						74,786.56	74,786.56
应付销售服务费						64,957.02	64,957.02
应付交易费用						109,087.74	109,087.74
应交税费						0.38	0.38
应付利息						-	-
应付利润						-	-
其他负债						109,356.64	109,356.64
负债总计						1,118,623.15	1,118,623.15
利率敏感度缺口	25,388,732.71				379,180.00	326,342,736.73	352,110,649.44
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	28,345,731.84						28,345,731.84
结算备付金	5,135,415.15						5,135,415.15
存出保证金	49,572.76					654,624.00	704,196.76
交易性金融资产	11,498,850.00		13,983,200.00		2,475,000.00	452,869,160.25	480,826,210.25
衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收证券清算款						206,785.87	206,785.87
应收利息						398,296.92	398,296.92
应收股利							
应收申购款						130,400.26	130,400.26
递延所得税资产							
其他资产							
资产总计	45,029,569.75		13,983,200.00		2,475,000.00	454,259,267.30	515,747,037.05
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	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	283,302.68	283,302.68
应付赎回款	-	-	-	-	3,012,608.68	3,012,608.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	633,477.50	633,477.50
应付托管费	-	-	-	-	105,579.58	105,579.58
应付销售服务费	-	-	-	-	103,595.89	103,595.89
应付交易费用	-	-	-	-	328,839.92	328,839.92
应交税费	-	-	-	-	11,902.81	11,902.81
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	217,775.98	217,775.98
负债总计	-	-	-	-	4,697,083.04	4,697,083.04
利率敏感度缺口	45,029,569.75	-	13,983,200.00	-	2,475,000.00	449,562,184.26
						511,049,954.01

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，并按照合同约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

于本报告期末及上年度末，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。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	379,428.48	-	379,428.48
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	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	379,428.48	-	379,428.48
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	379,428.48	-	379,428.48
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
-	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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
		所有外币相对人民币升值 5%	18,971.42
所有外币相对人民币贬值 5%	-18,971.42	-	

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公司的发行

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 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	326,018,736.73	92.59	452,869,160.25	88.62
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	326,018,736.73	92.59	452,869,160.25	88.62

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 (2021 年 06 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	13,204,149.35	15,749,589.07
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-13,204,149.35	-15,749,589.07

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) 以公允价值计量的资产和负债

如下列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

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一层

次的余额为 318,629,146.73 元，属于第二层次的余额为 19,769,970.00 元，无属于第三层次的余额(上年度末：第一层次 451,612,186.52 元，第二层次 29,214,023.73 元，无第三层次)

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的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时，本基金不会于停牌期间、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。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

(2) 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、卖出回购金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3) 除以上事项外，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	326,018,736.73	92.30
	其中：股票	326,018,736.73	92.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,380,380.00	3.50
	其中：债券	12,380,380.00	3.50
	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	13,317,057.16	3.77
8	其他各项资产	1,513,098.70	0.43
9	合计	353,229,272.59	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 379,428.48 元，占净值比例为 0.11%。

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	1,816,162.28	0.52
B	采矿业	8,784,816.00	2.49
C	制造业	161,611,325.34	45.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,167,875.96	5.73
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	9,582,387.58	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	25,457,211.66	7.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,664,922.63	1.04
J	金融业	63,791,838.10	18.12
K	房地产业	27,101,967.00	7.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,635,430.33	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	325,639,308.25	92.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	379,428.48	0.11
合计	379,428.48	0.11

注：以上分类采用全球行业分类系统(GICS)提供的国际通用分类标准。

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	600519	贵州茅台	7,900	16,247,930.00	4.61

2	600900	长江电力	727,124	15,007,839.36	4.26
3	000333	美的集团	195,000	13,917,150.00	3.95
4	600377	宁沪高速	1,362,000	13,293,120.00	3.78
5	000002	万科A	537,900	12,807,399.00	3.64
6	600048	保利地产	1,022,600	12,312,104.00	3.50
7	600036	招商银行	218,700	11,851,353.00	3.37
8	600309	万华化学	103,100	11,219,342.00	3.19
9	601398	工商银行	1,837,100	9,497,807.00	2.70
10	600612	老凤祥	171,000	9,057,870.00	2.57
11	600585	海螺水泥	212,000	8,702,600.00	2.47
12	601601	中国太保	270,000	7,821,900.00	2.22
13	601166	兴业银行	380,500	7,819,275.00	2.22
14	600196	复星医药	92,500	6,672,025.00	1.89
15	600188	兖州煤业	414,900	6,372,864.00	1.81
16	600655	豫园股份	530,000	6,142,700.00	1.74
17	300059	东方财富	160,000	5,246,400.00	1.49
18	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.46
19	600887	伊利股份	139,000	5,119,370.00	1.45
20	000100	TCL 科技	660,300	5,051,295.00	1.43
21	002601	龙佰集团	142,700	4,934,566.00	1.40
22	002202	金风科技	403,200	4,902,912.00	1.39
23	600104	上汽集团	214,700	4,716,959.00	1.34
24	601006	大秦铁路	691,500	4,550,070.00	1.29
25	600012	皖通高速	685,471	4,428,142.66	1.26
26	600183	生益科技	187,500	4,389,375.00	1.25
27	601818	光大银行	1,100,000	4,158,000.00	1.18
28	601939	建设银行	599,000	3,983,350.00	1.13
29	002415	海康威视	61,200	3,947,400.00	1.12
30	002001	新和成	129,600	3,716,928.00	1.06
31	600741	华域汽车	137,000	3,598,990.00	1.02
32	600323	瀚蓝环境	164,800	3,590,992.00	1.02
33	600660	福耀玻璃	64,000	3,574,400.00	1.02
34	601636	旗滨集团	185,000	3,433,600.00	0.98
35	000513	丽珠集团	67,800	3,391,356.00	0.96
36	002727	一心堂	101,000	3,344,110.00	0.95
37	002142	宁波银行	85,000	3,312,450.00	0.94
38	300760	迈瑞医疗	6,900	3,312,345.00	0.94
39	603444	吉比特	5,800	3,074,000.00	0.87
40	600176	中国巨石	197,053	3,056,292.03	0.87
41	000001	平安银行	130,000	2,940,600.00	0.84
42	000858	五粮液	8,400	2,502,276.00	0.71

43	600436	片仔癀	5,400	2,420,820.00	0.69
44	600028	中国石化	553,200	2,411,952.00	0.68
45	600009	上海机场	50,000	2,406,500.00	0.68
46	601688	华泰证券	149,600	2,363,680.00	0.67
47	300122	智飞生物	12,500	2,334,125.00	0.66
48	601238	广汽集团	172,000	2,227,400.00	0.63
49	000895	双汇发展	70,000	2,226,000.00	0.63
50	000776	广发证券	142,800	2,161,992.00	0.61
51	000568	泸州老窖	8,500	2,005,490.00	0.57
52	600690	海尔智家	76,800	1,989,888.00	0.57
53	600383	金地集团	193,600	1,982,464.00	0.56
54	300408	三环集团	43,200	1,832,544.00	0.52
55	300498	温氏股份	125,600	1,804,872.00	0.51
56	601877	正泰电器	54,000	1,802,520.00	0.51
57	000581	威孚高科	83,330	1,735,763.90	0.49
58	601012	隆基股份	18,200	1,616,888.00	0.46
59	601009	南京银行	153,000	1,609,560.00	0.46
60	600089	特变电工	103,800	1,333,830.00	0.38
61	000789	万年青	107,900	1,234,376.00	0.35
62	600019	宝钢股份	160,300	1,224,692.00	0.35
63	600276	恒瑞医药	18,000	1,223,460.00	0.35
64	000538	云南白药	10,100	1,168,772.00	0.33
65	600398	海澜之家	133,700	967,988.00	0.27
66	300124	汇川技术	12,450	924,537.00	0.26
67	600346	恒力石化	34,500	905,280.00	0.26
68	000876	新希望	54,700	802,449.00	0.23
69	000429	粤高速 A	108,700	779,379.00	0.22
70	000157	中联重科	82,400	761,376.00	0.22
71	002271	东方雨虹	12,298	680,325.36	0.19
72	000651	格力电器	13,000	677,300.00	0.19
73	002110	三钢闽光	98,100	661,194.00	0.19
74	002233	塔牌集团	63,700	654,836.00	0.19
75	601318	中国平安	10,000	642,800.00	0.18
76	002475	立讯精密	10,200	469,200.00	0.13
77	01398	工商银行	100,000	379,428.48	0.11
78	688538	和辉光电	94,689	320,048.82	0.09
79	600406	国电南瑞	12,000	278,880.00	0.08
80	002242	九阳股份	8,000	259,920.00	0.07
81	601128	常熟银行	40,000	248,000.00	0.07
82	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.07
83	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.04

84	688183	生益电子	9,932	140,935.08	0.04
85	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.03
86	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.03
87	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.03
88	688316	青云科技	1,333	86,645.00	0.02
89	300919	中伟股份	515	83,945.00	0.02
90	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
91	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.02
92	601838	成都银行	5,000	63,200.00	0.02
93	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
94	600298	安琪酵母	1,000	54,380.00	0.02
95	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
96	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
97	300957	贝泰妮	198	49,888.08	0.01
98	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
99	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
100	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
101	002966	苏州银行	5,000	36,750.00	0.01
102	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
103	300979	华利集团	375	32,812.50	0.01
104	300973	立高食品	240	27,770.40	0.01
105	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
106	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
107	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
108	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
109	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
110	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
111	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
112	300968	格林精密	1,152	13,904.64	0.00
113	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
114	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
115	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
116	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
117	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
118	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
119	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
120	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
121	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
122	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
123	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
124	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00

125	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
126	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
127	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
128	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
129	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
130	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
131	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
132	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
133	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
134	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
135	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
136	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
137	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
138	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
139	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
140	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
141	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
142	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
143	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
144	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
145	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
146	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
147	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
148	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
149	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
150	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
151	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
152	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
153	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
154	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
155	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
156	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
157	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
158	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
159	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600655	豫园股份	7,512,083.00	1.47
2	000333	美的集团	5,364,272.00	1.05
3	000002	万 科A	5,068,694.00	0.99
4	600519	贵州茅台	4,872,354.00	0.95
5	600900	长江电力	4,793,993.00	0.94
6	600012	皖通高速	4,706,691.08	0.92
7	600309	万华化学	4,671,414.00	0.91
8	601601	中国太保	4,356,555.00	0.85
9	600048	保利地产	4,333,517.00	0.85
10	600377	宁沪高速	4,289,987.52	0.84
11	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.67
12	600028	中国石化	3,323,630.00	0.65
13	600612	老凤祥	3,170,101.00	0.62
14	601166	兴业银行	3,133,222.00	0.61
15	600036	招商银行	3,054,085.50	0.60
16	600176	中国巨石	3,048,428.00	0.60
17	601398	工商银行	2,976,830.00	0.58
18	601636	旗滨集团	2,873,967.00	0.56
19	000776	广发证券	2,290,837.00	0.45
20	600585	海螺水泥	2,234,597.00	0.44

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600612	老凤祥	12,874,730.37	2.52
2	600585	海螺水泥	12,722,917.08	2.49
3	000333	美的集团	12,541,679.85	2.45
4	600519	贵州茅台	12,227,512.00	2.39
5	600309	万华化学	11,060,239.21	2.16
6	000002	万 科A	9,675,501.70	1.89
7	600887	伊利股份	9,122,564.58	1.79
8	600377	宁沪高速	8,820,449.14	1.73
9	600900	长江电力	8,769,307.00	1.72
10	600183	生益科技	8,039,525.87	1.57
11	002601	龙佰集团	8,008,110.00	1.57
12	600690	海尔智家	6,697,968.00	1.31
13	600196	复星医药	5,679,715.00	1.11
14	600036	招商银行	5,675,265.00	1.11
15	300059	东方财富	5,110,038.40	1.00
16	000100	TCL 科技	4,909,102.00	0.96

17	000568	泸州老窖	4,806,818.22	0.94
18	600048	保利地产	4,805,833.76	0.94
19	000001	平安银行	4,797,257.02	0.94
20	601318	中国平安	4,787,487.00	0.94

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	143,298,226.35
卖出股票收入（成交）总额	295,645,800.71

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

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	12,001,200.00	3.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	379,180.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,380,380.00	3.52

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	019640	20 国债 10	120,000	12,001,200.00	3.41
2	113050	南银转债	3,060	306,000.00	0.09
3	123111	东财转 3	500	73,180.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					230,604.72
股指期货投资本期公允价值变动					-231,886.27

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

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。

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

招商银行股份有限公司于 2020 年 9 月 29 日、2020 年 11 月 27 日受到国家外汇管理局深圳市分局处罚（深外管检[2020]76 号、深外管检（2020）92 号），因违反外汇市场交易管理被责令改正、处以罚款人民币 120 万元，对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分，因违反规定办理结汇、售汇被责令改正、处以罚款人民币 55 万元，没收违法所得 129 万元人民币；于 2021 年 5 月 17 日受到银保监会处罚（银保监罚决字（2021）16 号），因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规事实被处罚款 7170 万元。

中国工商银行股份有限公司于 2020 年 11 月 6 日受到中国人民银行衡水市中心支行处罚（衡银罚字[2020]第 1 号），因违反反洗钱法被处以 21 万元罚款，高管及直接责任人各处 1 万元罚款，共计 23 万元；于 2020 年 11 月 10 日受到国家外汇管理局北京外汇管理部处罚（京汇罚（2020）31 号），因违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务等违法事实被处 100 万元人民币罚款，并被要求对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分；又于 2020 年 12 月 25 日受到银保监会处罚（银保监罚决字（2020）71 号），因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告等违法违规事实被处罚款 5470 万元。

对“招商银行、工商银行”投资决策程序的说明：本基金管理人对招商银行、工商银行是依据该等公司的行业地位、竞争优势、业绩增长和估值综合分析而得出的决策，本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该等投资标的，我们认为，该处罚事项未对招商银行、工商银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响，我们对该等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	70,475.55
2	应收证券清算款	600,709.56
3	应收股利	21,280.00
4	应收利息	251,240.98
5	应收申购款	569,392.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,513,098.70

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
中信保诚红利精选 A	1,859	57,504.20	68,445,747.34	64.03%	38,454,565.40	35.97%
中信保诚红利精选 C	8,987	14,491.86	71,145,575.72	54.63%	59,092,807.80	45.37%
合计	10,846	21,864.16	139,591,323.06	58.86%	97,547,373.20	41.14%

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	中信保诚红利精选 A	592,599.51	0.55%
	中信保诚红利精选 C	637,415.62	0.49%
	合计	1,230,015.13	0.52%

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	中信保诚红利精选 A	50~100
	中信保诚红利精选 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	中信保诚红利精选 A	50~100
	中信保诚红利精选 C	0
	合计	50~100

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	中信保诚红利精选 A	中信保诚红利精选 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 25 日）基金份额总额	256,683,241.15	102,762,714.99
本报告期期初基金份额总额	132,104,619.44	229,599,061.16
本报告期基金总申购份额	76,338,584.34	81,977,258.48
减：本报告期基金总赎回份额	101,542,891.04	181,337,936.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	106,900,312.74	130,238,383.52

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

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

1. 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。

2. 本报告期内,无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本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毕马威华振会计师事务所(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

本报告期内,本基金管理人、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	
安信证券	1	64,221,683.55	15.02%	59,810.06	15.14%	-
长江证券	2	5,875,074.76	1.37%	4,178.58	1.06%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	83,932,415.72	19.63%	78,167.43	19.79%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-

国盛证券	2	1,220,928.56	0.29%	868.46	0.22%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	31,196,033.87	7.30%	28,429.10	7.20%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	3,409,873.36	0.80%	3,107.60	0.79%	-
浙商证券	1	41,150,876.20	9.62%	37,501.33	9.50%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	196,550,707.79	45.97%	182,863.95	46.30%	-

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	318,380.40	5.67%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	143,219.29	2.55%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	255,895.82	4.56%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	365,800.00	6.52%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

中信证券	4,529,358.40	80.70%	1,500,000.00	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	中信保诚红利精选混合型证券投资基金 2020 年第四季度报告	《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	2021年01月22日
2	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
3	中信保诚红利精选混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2021年03月19日
4	中信保诚红利精选混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	同上	2021年03月19日
5	中信保诚红利精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 3 月）	同上	2021年03月19日
6	中信保诚红利精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021年03月26日
7	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
8	中信保诚红利精选混合型证券投资基金 2021 年第一季度报告	同上	2021年04月21日
9	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

§ 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	2021-04-27 至 2021-04-27	17,063,390.50	20,856,507.23	-	37,919,897.73	15.99%
	2	2021-04-28 至 2021-06-30	-	67,818,921.67	-	67,818,921.67	28.60%

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 7 月 22 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）等法律文件。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中信保诚红利精选混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚红利精选混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚红利精选混合型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

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