

中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
§ 6	半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益 (基金净值) 变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	51

§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末上市基金前十名持有人	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9	开放式基金份额变动	54
§ 10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)
基金简称	中信保诚中证 800 金融
场内简称	信诚金融
基金主代码	165521
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	197,332,125.58 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 02 月 03 日

注：自 2021 年 8 月 23 日起，本基金场内简称扩位为“金融 LOF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 800 金融指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	<p>本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股(含存托凭证)组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当发生特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等),或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:</p>

	<p>(1) 基本面替代：按照与被替代股票基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；</p> <p>(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。</p>
业绩比较基准	95%×中证 800 金融价格指数收益率+5%×金融同业存款利率。
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	李申
	联系电话	021-68649788	021-60637102
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	021-60637111
传真		021-50120888	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	张翔燕	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	58,664,566.66
本期利润	1,915,392.06
加权平均基金份额本期利润	0.0075
本期加权平均净值利润率	0.65%
本期基金份额净值增长率	-1.13%
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	69,557,337.13
期末可供分配基金份额利润	0.3525
期末基金资产净值	224,426,052.15
期末基金份额净值	1.137
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	-1.13%

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。

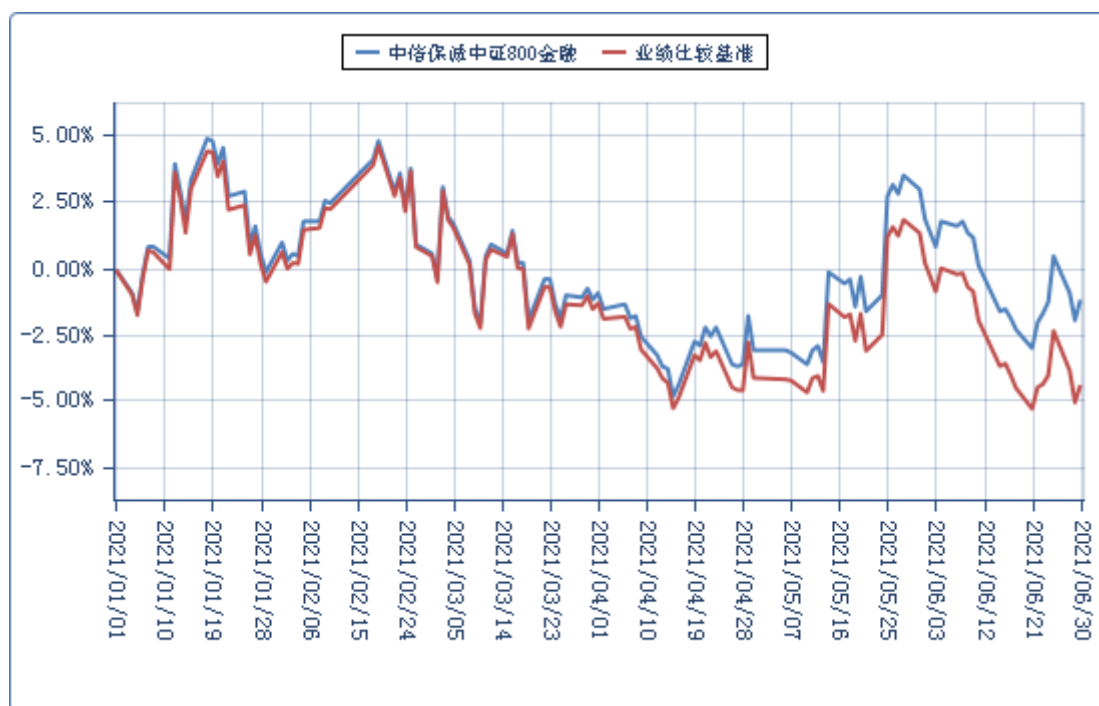
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-4.05%	0.87%	-5.67%	0.87%	1.62%	0.00%
过去三个月	0.00%	1.04%	-2.91%	1.04%	2.91%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.13%	1.16%	-4.35%	1.17%	3.22%	-0.01%

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



注：本基金转型日期为 2021 年 01 月 01 日，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

§ 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		
HAN YILING	本基金基金经理、 量化二部副总监	2018 年 04 月 10 日	-	7	HAN YILING 先生, 计算机学硕士、信息技术硕士。曾任职于澳大利亚国立信息通信技术研究院, 担任研究员; 于中信保诚基金管理有限公司, 担任量化投资部金融工程师; 于华宝兴业基金管理有限公司, 担任量化部投资经理。2016 年 6 月重新加入中信保诚基金管理有限公司, 历任投资经理、基金经理助理。现任量化二部副总监, 中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 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

《中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 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 年上半年行业风格变化比较快。以春节作为断点,节前龙头效应较为明显。节后成长性板块估值大幅回调。二季度后以新能源、化工、有色为代表的能源周期性板块涨幅较大。以房地产、金融、家电等传统大行业为主的板块均有一定程度的跌幅。我们在前期较为关注的市场抱团行情略有松动。从目前的市场情况来看,前期抱团炒高的板块很大程度上并不能保持持续的涨幅。而市场信心集中的板块中,上涨也在逐步转到二三线公司。

海外方面,印度疫情仍然严峻。美联储 6 月议息会议态度偏鹰,维持基准利率和资产购买规模未变,但大幅上调了经济增长和通胀预期,加息预期有所升温;随后,海外市场波动率抬升,美元指数大幅反弹,但由于流动性环境极度宽松美债收益率表现疲软。国内方面,5 月公布经济数据显示,出口和社融增速略低于市场预期;制造业投资持续修复,房地产和基建投资增速有所放缓,消

费回暖但修复缓慢。央行主管媒体维持流动性预期稳定。

策略角度来看,国内复工复产稳步进行,出口数据较好,短期不需要太担心经济的状况。长期来看银行有低估值机会,同时基本面没有太大扰动,具有配置价值。券商基本面最好,两市成交额接连破万亿,利好券商,估值角度来看券商也并未被高估。保险行业受制于保费数据一直不及预期,市场情绪较为悲观,当下估值已反应未来几年相对悲观的盈利预期,处于超跌状态,长期来看也具有配置价值。金融板块建议关注盈利能力高,估值低的龙头企业。

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

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-1.13%,同期业绩比较基准收益率为-4.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

我们坚持以“价值”作为投资,看好未来在各行业聚集效用,做价值股的长期投资。

4.6 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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:中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)

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
资产:		
银行存款	6.4.7.1	13,342,867.59
结算备付金	-	520,673.31
存出保证金	-	80,835.58
交易性金融资产	6.4.7.2	211,905,939.80
其中:股票投资	-	211,391,939.80
基金投资	-	-
债券投资	-	514,000.00
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	-	-
应收利息	6.4.7.5	6,431.20
应收股利	-	131,501.00
应收申购款	-	192,344.78

递延所得税资产	-	-
其他资产	6.4.7.6	27,483.71
资产总计	-	226,208,076.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30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	-	1,152,610.29
应付赎回款	-	101,055.31
应付管理人报酬	-	195,024.02
应付托管费	-	42,905.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	60,363.89
应交税费	-	425.08
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	6.4.7.8	229,640.93
负债合计	-	1,782,024.82
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	106,102,752.35
未分配利润	6.4.7.10	118,323,299.80
所有者权益合计	-	224,426,052.15
负债和所有者权益总计	-	226,208,076.97

注：1、截止本报告期末，基金份额净值 1.137 元，基金份额总额 197,332,125.58 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 01 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)

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
一、收入	-	4,646,293.18
1. 利息收入	-	77,399.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,130.91
债券利息收入	-	806.86

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
证券出借利息收入	-	46,462.09
其他利息收入	-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)	-	60,726,877.51
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	57,935,304.87
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	297,372.22
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	-
股利收益	6.4.7.15	2,494,200.42
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-56,749,174.60
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	591,190.41
减: 二、费用	-	2,730,901.12
1. 管理人报酬	-	1,474,592.93
2. 托管费	-	324,410.43
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	713,110.46
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	167.72
7. 其他费用	6.4.7.19	218,619.58
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-	1,915,392.06
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-	1,915,392.06

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)

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)	264,151,272.85	300,895,342.49	565,046,615.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	1,915,392.06	1,915,392.06
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)	-158,048,520.50	-	-342,535,955.25
其中: 1. 基金申购款	10,328,638.84	12,154,654.11	22,483,292.95
2. 基金赎回款	-168,377,159.34	-	-365,019,248.20

		196,642,088.86	
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)	106,102,752.35	118,323,299.80	224,426,052.15

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

中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金(以下简称“信诚中证 800 金融指数分级基金”)转型而来。根据本基金的基金管理人于 2020 年 12 月 31 日发布的《关于信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金名称变更的公告》以及于 2021 年 1 月 5 日发布的《关于信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金之信诚金融 A 份额和信诚金融 B 份额基金份额折算结果的公告》，信诚金融 A 份额和信诚金融 B 份额终止运作，并以 2020 年 12 月 31 日作为基金份额折算日折算为信诚金融份额。信诚中证 800 金融指数分级基金自 2021 年 1 月 1 日起转型为本基金。《中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。信诚中证 800 金融指数分级基金于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为 565,046,615.34 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]133 号核准，本基金 234,370,304.00 份基金份额于 2021 年 2 月 3 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和最新公布的《中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 800 金融指数的成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)、新股(含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 金融指数成份股和备选

成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 金融价格指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

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(基金合同生效日)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(基金合同生效日)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

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不

应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益

部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)和银行间同业市场固定收益品种按照第三方估值机构提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁

后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	13,342,867.59
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	13,342,867.59

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	190,660,090.31	211,391,939.80	20,731,849.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	514,000.00	514,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	514,000.00	514,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	191,174,090.31	211,905,939.80	20,731,849.49

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	1,009.00
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	93.55
应收债券利息	36.05
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	5,259.93
其他	32.67
合计	6,431.20

注：其他包括应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	27,483.71
合计	27,483.71

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	60,363.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	60,363.89

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	380.78
应付证券出借违约金	-
应付审计费	109,752.78
应付信息披露费	69,507.37
应付指数使用费	50,000.00
合计	229,640.93

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
基金合同生效日	491,247,984.78	264,151,272.85
本期申购	19,210,052.28	10,328,638.84
本期赎回 (以“-”号填列)	-313,125,911.48	-168,377,159.34
本期末	197,332,125.58	106,102,752.35

注： 1、申购含红利再投 (如有)、转换入份额 (如有)，赎回含转换出份额 (如有)。

2、本基金本报告期末场内外基金份额如下：

		本报告期末	
基金代码	基金名称	场内	场外
165521	中信保诚中证800金融	178,756,937.00	18,575,188.58

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
基金合同生效日	77,903,716.72	222,991,625.77	300,895,342.49
本期利润	58,664,566.66	-56,749,174.60	1,915,392.06
本期基金份额交易产生的变动数	-67,010,946.25	117,476,488.50	-184,487,434.75
其中：基金申购款	4,791,004.94	7,363,649.17	12,154,654.11
基金赎回款	-71,801,951.19	124,840,137.67	-196,642,088.86
本期已分配利润	-	-	-

本期末	69,557,337.13	48,765,962.67	118,323,299.80
-----	---------------	---------------	----------------

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	27,440.05	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	1,999.14	
其他	691.72	
合计	30,130.91	

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	343,294,817.02	
减：卖出股票成本总额	285,359,512.15	
买卖股票差价收入	57,935,304.87	

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	297,372.22	
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	297,372.22	

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	3,273,141.64	
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	2,974,400.00	
减：应收利息总额	1,369.42	

买卖债券差价收入	297,372.22
----------	------------

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

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

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	2,494,200.42
其中：证券出借权益补偿收入	270,019.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,494,200.42

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	-56,749,174.60
--股票投资	-56,594,172.40
--债券投资	-155,002.20
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-56,749,174.60

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	588,940.43
转换费收入	2,249.98
合计	591,190.41

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 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	713,110.46
银行间市场交易费用	-
合计	713,110.46

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	1,793.14
基金上市费	27,516.29
其他	50.00
合计	218,619.58

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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,474,592.93

其中：支付销售机构的客户维护费	124,772.77
-----------------	------------

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 1.00% 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×1.00%/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
当期发生的基金应支付的托管费	324,410.43

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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×0.22%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	13,342,867.59	27,440.05

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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
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	497	12,226.20	81,011.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 02 日	锁定期股票	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

		日	月 12 日							
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	-
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	-
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	-
688067	爱威科技	2021 年 06 月 07 日	2021 年 12 月 16 日	锁定期股票	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688083	中望软件	2021 年 03 月 04 日	2021 年 09 月 13 日	锁定期股票	150.50	524.08	479	72,089.50	251,034.32	-
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	-
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	-
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	1,918	74,514.30	74,514.30	-
68862	翔宇	2021 年	2021	锁定期	28.82	104.16	1,670	48,129.40	173,947.2	-

6	医疗	03 月 23 日	年 10 月 08 日	股票						0
688660	电气风电	2021 年 05 月 11 日	2021 年 11 月 19 日	锁定期股票	5.44	7.26	10,930	59,459.20	79,351.80	-

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	5,140	514,000.00	514,000.00	-

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末估值总额
----	------	------	-------	--------	------------	--------

1	000001	平安银行	2021年07月05日-2021年07月08日	22.62	97,400	2,203,188.00
2	000166	申万宏源	2021年07月01日	4.68	54,800	256,464.00
3	000686	东北证券	2021年07月05日	8.45	10,000	84,500.00
4	000728	国元证券	2021年07月06日	7.97	30,600	243,882.00
5	000750	国海证券	2021年07月06日	4.24	38,200	161,968.00
6	000776	广发证券	2021年07月08日	15.14	29,700	449,658.00
7	002142	宁波银行	2021年07月01日	38.97	21,900	853,443.00
8	002500	山西证券	2021年07月13日	6.71	25,900	173,789.00
9	002670	国盛金控	2021年07月08日	11.39	11,700	133,263.00
10	002673	西部证券	2021年07月06日	8.25	17,900	147,675.00
11	002736	国信证券	2021年07月05日	10.75	23,100	248,325.00
12	002926	华西证券	2021年07月06日	9.63	15,800	152,154.00
13	600016	民生银行	2021年07月08日	4.41	213,600	941,976.00
14	600155	华创阳安	2021年07月13日	10.70	14,600	156,220.00
15	600369	西南证券	2021年07月05日-2021年07月06日	4.87	33,300	162,171.00
16	600705	中航产融	2021年07月05日	3.87	43,000	166,410.00
17	600837	海通证券	2021年07月01日-2021年07月08日	11.50	96,900	1,114,350.00
18	600909	华安证券	2021年07月05日	5.57	22,600	125,882.00
19	600926	杭州银行	2021年07月01日-2021年07月13日	14.75	34,600	510,350.00
20	600958	东方证券	2021年07月01日	9.99	15,400	153,846.00

21	601009	南京银行	2021年07月06日	10.52	50,200	528,104.00
22	601099	太平洋	2021年07月05日	3.39	54,700	185,433.00
23	601128	常熟银行	2021年07月05日	6.20	22,000	136,400.00
24	601162	天风证券	2021年07月01日	4.86	26,300	127,818.00
25	601166	兴业银行	2021年07月08日	20.55	134,300	2,759,865.00
26	601198	东兴证券	2021年07月05日	10.93	11,000	120,230.00
27	601377	兴业证券	2021年07月06日	9.66	20,000	193,200.00
28	601696	中银证券	2021年07月13日	20.59	10,000	205,900.00
29	601788	光大证券	2021年07月01日-2021年07月13日	17.89	22,800	407,892.00
30	601838	成都银行	2021年07月06日	12.64	21,700	274,288.00
31	601878	浙商证券	2021年07月08日	13.08	15,500	202,740.00
32	601881	中国银河	2021年07月05日	10.78	10,000	107,800.00
33	601901	方正证券	2021年07月05日	9.36	33,000	308,880.00
34	601988	中国银行	2021年07月05日	3.08	10,000	30,800.00
35	601990	南京证券	2021年07月01日	10.52	11,200	117,824.00
36	601997	贵阳银行	2021年07月05日	7.16	20,500	146,780.00
合计					1,324,200	14,293,468.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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

1、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。

2、本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日
AAA	514,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	514,000.00

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未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(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	13,342,867.59	-	-	-	-	-	13,342,867.59
结算备付金	520,673.31	-	-	-	-	-	520,673.31
存出保证金	80,835.58	-	-	-	-	-	80,835.58
交易性金融资产	-	-	-	-	514,000.00	211,391,939.80	211,905,939.80
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	-	-	-	-	-	6,431.20	6,431.20
应收股利	-	-	-	-	-	131,501.00	131,501.00
应收申购款	-	-	-	-	-	192,344.78	192,344.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	27,483.71	27,483.71
资产总计	13,944,376.48	-	-	514,000.00	211,749,700.49	226,208,076.97
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	-	-	-	-	1,152,610.29	1,152,610.29
应付赎回款	-	-	-	-	101,055.31	101,055.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	195,024.02	195,024.02
应付托管费	-	-	-	-	42,905.30	42,905.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	60,363.89	60,363.89
应交税费	-	-	-	-	425.08	425.08
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	229,640.93	229,640.93
负债总计	-	-	-	-	1,782,024.82	1,782,024.82
利率敏感度缺口	13,944,376.48	-	-	514,000.00	209,967,675.67	224,426,052.15

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。本基金合同自 2021 年 01 月 01 日起生效，无上年度末数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。

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

本基金持有有一定比例的证券交易所上市股票,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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	211,391,939.80	94.19
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	211,391,939.80	94.19

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)
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	10,548,024.45
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-10,548,024.45

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一层次的余额为 210,611,328.63 元, 属于第二层次的余额为 1,294,611.17 元, 无属于第三层次的余额

(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	211,391,939.80	93.45
	其中: 股票	211,391,939.80	93.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	514,000.00	0.23
	其中: 债券	514,000.00	0.23
	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	13,863,540.90	6.13
8	其他各项资产	438,596.27	0.19
9	合计	226,208,076.97	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 14,293,468.00 元，占基金资产净值比例为 6.37%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	210,442,564.69	93.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	210,442,564.69	93.77

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	627,354.46	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	263,264.72	0.12

J	金融业	34,721.10	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	949,375.11	0.42

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	426,433	27,411,113.24	12.21
2	600036	招商银行	487,280	26,405,703.20	11.77
3	601166	兴业银行	571,556	11,745,475.80	5.23
4	300059	东方财富	325,544	10,674,587.76	4.76
5	000001	平安银行	381,350	8,626,137.00	3.84
6	600030	中信证券	334,950	8,353,653.00	3.72
7	601398	工商银行	1,379,772	7,133,421.24	3.18
8	002142	宁波银行	141,627	5,519,204.19	2.46
9	601328	交通银行	1,081,692	5,300,290.80	2.36
10	600000	浦发银行	462,168	4,621,680.00	2.06
11	600837	海通证券	380,090	4,371,035.00	1.95
12	601601	中国太保	134,709	3,902,519.73	1.74
13	600016	民生银行	836,566	3,689,256.06	1.64
14	601288	农业银行	1,125,684	3,410,822.52	1.52
15	600919	江苏银行	465,140	3,302,494.00	1.47
16	601229	上海银行	391,453	3,209,914.60	1.43
17	601688	华泰证券	202,782	3,203,955.60	1.43
18	601211	国泰君安	177,569	3,043,532.66	1.36
19	601169	北京银行	582,601	2,837,266.87	1.26
20	600999	招商证券	146,095	2,778,726.90	1.24

21	601988	中国银行	825,905	2,543,787.40	1.13
22	601818	光大银行	649,003	2,453,231.34	1.09
23	601628	中国人寿	65,602	2,223,251.78	0.99
24	601658	邮储银行	425,000	2,133,500.00	0.95
25	601009	南京银行	195,583	2,057,533.16	0.92
26	601377	兴业证券	208,874	2,017,722.84	0.90
27	000776	广发证券	115,413	1,747,352.82	0.78
28	600926	杭州银行	115,580	1,704,805.00	0.76
29	000166	申万宏源	355,013	1,661,460.84	0.74
30	600958	东方证券	162,858	1,626,951.42	0.72
31	601901	方正证券	160,460	1,501,905.60	0.67
32	601336	新华保险	32,566	1,495,105.06	0.67
33	600015	XD 华夏银	239,923	1,485,123.37	0.66
34	601788	光大证券	76,131	1,361,983.59	0.61
35	601916	浙商银行	325,800	1,293,426.00	0.58
36	002736	国信证券	112,435	1,208,676.25	0.54
37	601066	中信建投	38,300	1,203,769.00	0.54
38	600109	国金证券	94,351	1,197,314.19	0.53
39	000783	长江证券	150,914	1,104,690.48	0.49
40	601838	成都银行	84,500	1,068,080.00	0.48
41	601108	财通证券	97,900	1,026,971.00	0.46
42	601555	东吴证券	120,993	1,009,081.62	0.45
43	601077	渝农商行	241,300	962,787.00	0.43
44	000728	国元证券	119,102	949,242.94	0.42
45	300033	同花顺	8,400	947,352.00	0.42
46	002797	第一创业	131,116	936,168.24	0.42
47	601099	太平洋	265,700	900,723.00	0.40
48	600061	国投资本	100,243	851,063.07	0.38
49	601162	天风证券	168,940	821,048.40	0.37
50	600705	中航产融	211,766	819,534.42	0.37
51	601878	浙商证券	60,500	791,340.00	0.35
52	601990	南京证券	71,900	756,388.00	0.34
53	601997	贵阳银行	99,764	714,310.24	0.32
54	601696	中银证券	33,500	689,765.00	0.31
55	601128	常熟银行	106,900	662,780.00	0.30
56	601995	中金公司	10,300	633,450.00	0.28
57	600369	西南证券	129,512	630,723.44	0.28
58	000750	国海证券	148,592	630,030.08	0.28
59	601998	中信银行	122,116	622,791.60	0.28
60	600909	华安证券	110,150	613,535.50	0.27
61	002926	华西证券	63,300	609,579.00	0.27

62	601198	东兴证券	55,399	605,511.07	0.27
63	002673	西部证券	71,780	592,185.00	0.26
64	601319	中国人保	99,800	591,814.00	0.26
65	002500	山西证券	86,465	580,180.15	0.26
66	601881	中国银河	51,800	558,404.00	0.25
67	600390	五矿资本	90,380	540,472.40	0.24
68	600155	华创阳安	48,900	523,230.00	0.23
69	002670	国盛金控	45,253	515,431.67	0.23
70	002966	苏州银行	66,900	491,715.00	0.22
71	002958	青农商行	108,300	463,524.00	0.21
72	000686	东北证券	54,732	462,485.40	0.21
73	601577	长沙银行	48,900	437,166.00	0.19
74	002939	长城证券	37,800	420,714.00	0.19
75	601236	红塔证券	29,500	400,020.00	0.18
76	601456	国联证券	23,600	363,440.00	0.16
77	600908	无锡银行	60,400	350,320.00	0.16
78	600918	中泰证券	30,400	328,928.00	0.15
79	600120	浙江东方	70,460	301,568.80	0.13
80	002839	张家港行	51,300	279,072.00	0.12
81	601860	紫金银行	74,300	269,709.00	0.12
82	002936	郑州银行	71,080	260,863.60	0.12
83	000563	陕国投 A	80,437	259,007.14	0.12
84	600643	爱建集团	36,820	257,003.60	0.11
85	600901	江苏租赁	48,500	252,200.00	0.11
86	600928	西安银行	54,100	252,106.00	0.11
87	600095	湘财股份	20,000	234,200.00	0.10
88	002948	青岛银行	33,400	165,998.00	0.07
89	002945	华林证券	11,000	152,020.00	0.07
90	000046	泛海控股	63,200	145,360.00	0.06
91	601187	厦门银行	11,700	110,916.00	0.05
92	002423	中粮资本	7,500	67,875.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688083	中望软件	479	251,034.32	0.11
2	688626	翔宇医疗	1,670	173,947.20	0.08
3	300919	中伟股份	497	81,011.00	0.04
4	688660	电气风电	10,930	79,351.80	0.04
5	688499	利元亨	1,918	74,514.30	0.03

6	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
7	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
8	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
9	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
10	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
11	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
12	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
13	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
14	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
15	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
16	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
17	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
18	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
19	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,684,715.00	1.64
2	601658	邮储银行	1,504,828.00	0.67
3	601916	浙商银行	777,164.00	0.35
4	600837	海通证券	759,367.00	0.34
5	002142	宁波银行	752,180.00	0.34
6	601077	渝农商行	741,768.00	0.33
7	601995	中金公司	670,453.00	0.30
8	000750	国海证券	647,000.00	0.29
9	601696	中银证券	528,663.00	0.24
10	600095	湘财股份	257,489.00	0.11
11	688819	天能股份	255,002.58	0.11
12	600036	招商银行	254,125.00	0.11
13	601456	国联证券	163,288.00	0.07
14	002966	苏州银行	161,950.00	0.07
15	688317	之江生物	155,937.76	0.07
16	600918	中泰证券	154,280.00	0.07
17	601162	天风证券	133,280.00	0.06
18	688538	和辉光电	119,496.45	0.05
19	300059	东方财富	115,519.00	0.05
20	601990	南京证券	112,286.00	0.05

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	42,896,360.46	19.11
2	600036	招商银行	37,253,241.15	16.60
3	601166	兴业银行	19,169,555.00	8.54
4	300059	东方财富	14,541,657.06	6.48
5	600030	中信证券	14,349,032.56	6.39
6	000001	平安银行	12,629,279.73	5.63
7	601398	工商银行	10,685,322.00	4.76
8	688981	中芯国际	9,837,880.94	4.38
9	601601	中国太保	7,839,541.76	3.49
10	601328	交通银行	7,505,676.00	3.34
11	600000	浦发银行	7,074,629.00	3.15
12	002142	宁波银行	6,889,171.69	3.07
13	601688	华泰证券	6,863,386.00	3.06
14	600016	民生银行	6,557,641.24	2.92
15	600837	海通证券	5,649,973.07	2.52
16	601288	农业银行	5,493,783.00	2.45
17	600999	招商证券	5,380,854.00	2.40
18	601229	上海银行	4,951,641.00	2.21
19	601211	国泰君安	4,722,557.00	2.10
20	601169	北京银行	4,362,601.00	1.94

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	16,780,998.89
卖出股票收入(成交)总额	343,294,817.02

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	-	-
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)	514,000.00	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	514,000.00	0.23

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	113050	南银转债	5,140	514,000.00	0.23

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

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

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

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

宁波银行股份有限公司分别于 2020 年 10 月 16 日、2021 年 6 月 10 日收到宁波银保监局的处罚（甬银保监罚决字〔2020〕48 号、甬银保监罚决字〔2021〕36 号），因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位、代理销售保险不规范，被处以罚款人民币共计 55 万元。

上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 8 月 10 日、2020 年 12 月 11 日、2021 年 4 月 23 日分别受到上海银保监局、国家外汇管理局上海市分局和中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚（沪银保监银罚决字〔2020〕12 号、上海汇管罚字〔2020〕20200007 号、沪银保监罚决字〔2021〕9 号），因于 2013 年至 2019 年期间存在未按专营部门制规定开展同业业务等多项违法违规事实被责令改正，并处罚款共计 2100 万元；因违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易，违反银行交易记录管理规定等违法事实被责令限期改正，并处罚款 140 万元；因未按规定开展代销业务被责令改正，并处罚款共计 760 万元。

平安银行股份有限公司于 2020 年 10 月 16 日、2021 年 5 月 28 日分别收到宁波银保监局、中国银保监会云南监管局的处罚（甬银保监罚决字〔2020〕66 号、云银保监罚决字〔2021〕34 号），因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售等违法违规事项，被合计罚款人民币 100 万元；因贷款用途审查监控不到位等违法违规事实被处以罚款人民币 210 万元。

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），兴业银行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。

中国工商银行股份有限公司于 2020 年 10 月 26 日收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被处以罚款 100 万元；于 2020 年 11 月 6 日收到中国人民银行衡水市中心支行处罚（衡银罚字〔2020〕第 1

号), 工商银行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 12 月 25 日收到银保监会处罚 (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。

招商银行股份有限公司于 2020 年 9 月 29 日、2020 年 11 月 27 日、2021 年 5 月 17 日分别收到国家外汇管理局深圳市分局和中国银行保险监督管理委员会的 3 份处罚 (深外管检[2020]76 号、深外管检 (2020) 92 号、银保监罚决字 (2021) 16 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; 因理财产品之间风险隔离不到位、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品等违法违规事实被罚款 7170 万元。

中信证券股份有限公司于 2020 年 10 月 27 日、2021 年 1 月 23 日分别收到中国证监会和深圳证监局的责令改正措施的决定 (《关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》、《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(深圳证监局[2021]5 号)), 因投资银行类业务内部控制不完善、廉洁从业风险防控机制不完善等问题被采取出具责令改正的监管措施。

对“招商银行”, “兴业银行”、“中信证券”、“平安银行”、“工商银行”、“宁波银行”和“浦发银行”的投资决策程序的说明: 招商银行、中信证券、兴业银行、平安银行、工商银行、宁波银行和浦发银行均为中证 800 金融指数的成分股。这些公司分别于 2020 至 2021 年间发生的违规事件受到监管部门处罚。基金经理对事件的影响做了分析后认为, 此类类型的处罚事件不会对公司的企业经营和投资价值产生太大的影响; 另外, 根据量化模型, 基金经理也控制了其在投资组合中的占比, 防止意外风险发生。因此我们认为投资策略没有决策性问题。

除此之外, 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	80,835.58
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	131,501.00
4	应收利息	6,431.20
5	应收申购款	192,344.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	27,483.71
8	其他	-
9	合计	438,596.27

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601166	兴业银行	2,759,865.00	1.23	转融通流通受限
2	000001	平安银行	2,203,188.00	0.98	转融通流通受限
3	002142	宁波银行	853,443.00	0.38	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688083	中望软件	251,034.32	0.11	锁定期股票
2	688626	翔宇医疗	173,947.20	0.08	锁定期股票
3	688660	电气风电	79,351.80	0.04	锁定期股票
4	688499	利元亨	74,514.30	0.03	新发未上市

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

14,993	13,161.62	11,353,124.47	5.75%	185,979,001.11	94.25%
--------	-----------	---------------	-------	----------------	--------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	8,341,263.00	4.67%
2	秦至红	3,576,396.00	2.00%
3	陈奉娥	3,047,801.00	1.70%
4	邹建	2,850,000.00	1.59%
5	潘水苗	2,324,888.00	1.30%
6	深圳市鸿富自动化设备有限公司	2,090,204.00	1.17%
7	宋伟铭	1,920,000.00	1.07%
8	吴嫣	1,860,142.00	1.04%
9	孙毅	1,751,082.00	0.98%
10	李燕欢	1,476,039.00	0.83%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	16,819.71	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.5 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

基金合同生效日 (2021 年 01 月 01 日) 基金份额总额	491,247,984.78
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,210,052.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	313,125,911.48
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	197,332,125.58

§ 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未发生重大人事变动。

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	
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-

大通证券	1	-	-	-	-
东北证券	2	32,371,014.19	9.10%	23,024.85	7.17%
东方证券	1	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-
东兴证券	1	11,657,538.51	3.28%	10,623.34	3.31%
方正证券	1	44,039,635.22	12.38%	40,133.30	12.49%
高盛高华	1	-	-	-	-
光大证券	1	7,909,502.76	2.22%	5,784.35	1.80%
广发证券	1	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-
华泰证券	2	252,133,223.03	70.86%	234,736.92	73.08%
华西证券	2	-	-	-	-
金通证券	1	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-

西藏东财	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	7,123,906.00	2.00%	6,492.09	2.02%	-
野村东方 国际证券有 限公司	1	600,812.31	0.17%	427.35	0.13%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	787,703.44	13.92%	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,870,838.20	86.08%	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年01月01日
2	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要	同上	2021年01月01日
3	关于信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金之信诚金融 A 份额和信诚金融 B 份额基金份额折算结果的公告	同上	2021年01月05日
4	信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金 2020 年第四季度报告	同上	2021年01月22日
5	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
6	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书	同上	2021年01月29日
7	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2021年02月03日

8	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易提示性公告	同上	2021年02月03日
9	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金场内单笔最低申购金额的公告》	同上	2021年02月26日
10	信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021年03月26日
11	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
12	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改法律文件的公告	同上	2021年03月31日
13	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2021年03月31日
14	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2021年03月31日
15	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2021年04月02日
16	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2021年04月02日
17	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第一季度报告	同上	2021年04月21日
18	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
19	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	同上	2021年05月14日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金赎回费率优惠活动的公告	同上	2021年05月14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

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 3 月 31 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引〉修改法律文件的公告》，本基金就投资范围增加存托凭证、增加侧袋机制、标的指数事项修订事项调

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。

本基金管理人于 2021 年 8 月 25 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 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2021 年 8 月 26 日起增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并对基金合同和托管协议的相关条款进行修订。招募说明书及基金产品资料概要相应更新。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、(原) 信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 4、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 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