

# 信诚至利灵活配置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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	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	8
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 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	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	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	49
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 .....	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	53
§ 9	开放式基金份额变动 .....	53
§ 10	重大事件揭示 .....	53
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4	基金投资策略的改变 .....	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8	其他重大事件 .....	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
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 .....	56
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§ 12	备查文件目录 .....	56
12.1	备查文件目录 .....	56
12.2	存放地点 .....	56
12.3	查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚至利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	信诚至利	
基金主代码	003234	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 09 月 02 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	695,716,510.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚至利 A	信诚至利 C
下属分级基金的交易代码	003234	003235
报告期末下属分级基金的份额总额	336,941,222.82 份	358,775,287.51 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策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股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上,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,严选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,严选安全边际较高的个股。</p> <p>3、固定收益投资策略</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。</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</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、权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。</p> <p>8、存托凭证投资策略</p> <p>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。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证综合债指数收益率。
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。
--	-------------------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	罗丹丹
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	luodandan@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120888	010-85230024
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		张翔燕	李庆萍

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

## 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）	
	信诚至利 A	信诚至利 C
本期已实现收益	6,555,146.77	7,343,293.16

本期利润	10,730,199.15	10,511,347.96
加权平均基金份额本期利润	0.0558	0.0528
本期加权平均净值利润率	4.67%	4.41%
本期基金份额净值增长率	4.27%	4.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 06 月 30 日)	
	信诚至利 A	信诚至利 C
期末可供分配利润	74,020,438.44	78,051,532.40
期末可供分配基金份额利润	0.2197	0.2175
期末基金资产净值	410,961,661.26	436,826,819.91
期末基金份额净值	1.2197	1.2175
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 06 月 30 日)	
	信诚至利 A	信诚至利 C
基金份额累计净值增长率	21.97%	21.75%

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

信诚至利 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	0.83%	0.16%	-0.47%	0.25%	1.30%	-0.09%
过去三个月	3.33%	0.17%	1.96%	0.30%	1.37%	-0.13%
过去六个月	4.27%	0.23%	1.82%	0.40%	2.45%	-0.17%
过去一年	4.29%	0.16%	9.66%	0.40%	-5.37%	-0.24%
过去三年	17.87%	0.24%	25.67%	0.40%	-7.80%	-0.16%
自基金合同生效起至今	21.97%	0.23%	31.41%	0.35%	-9.44%	-0.12%

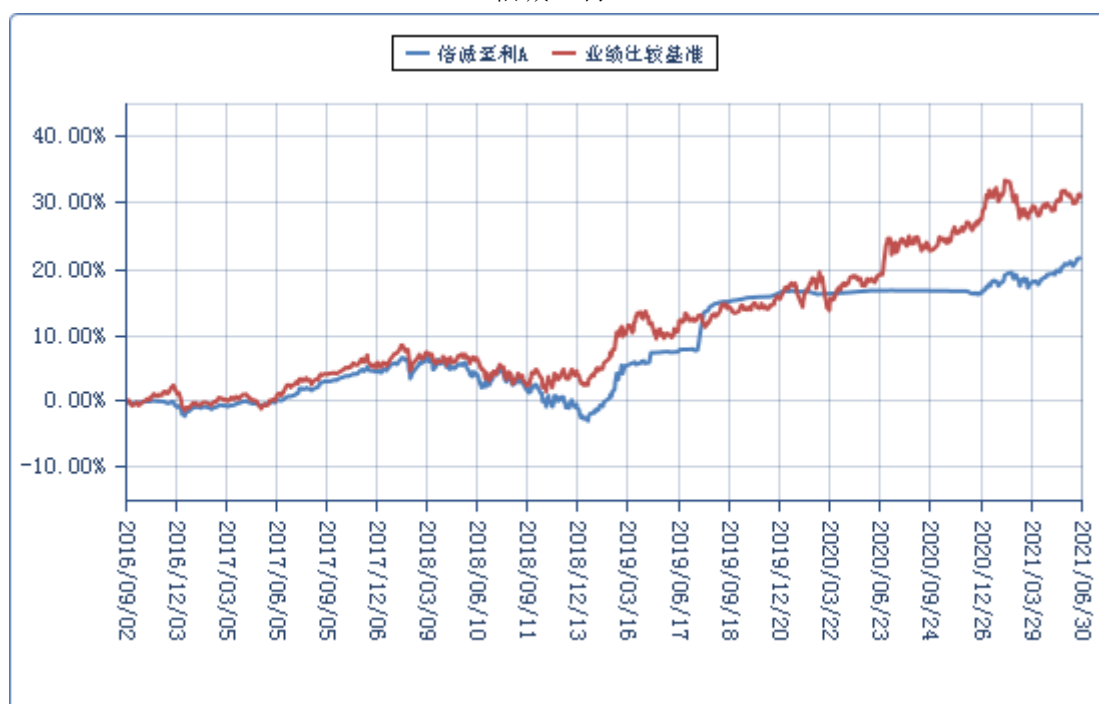
信诚至利 C

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	0.82%	0.16%	-0.47%	0.25%	1.29%	-0.09%
过去三个月	3.30%	0.17%	1.96%	0.30%	1.34%	-0.13%
过去六个月	4.20%	0.23%	1.82%	0.40%	2.38%	-0.17%
过去一年	4.20%	0.16%	9.66%	0.40%	-5.46%	-0.24%
过去三年	18.28%	0.26%	25.67%	0.40%	-7.39%	-0.14%
自基金合同生效起至今	21.75%	0.24%	31.41%	0.35%	-9.66%	-0.11%

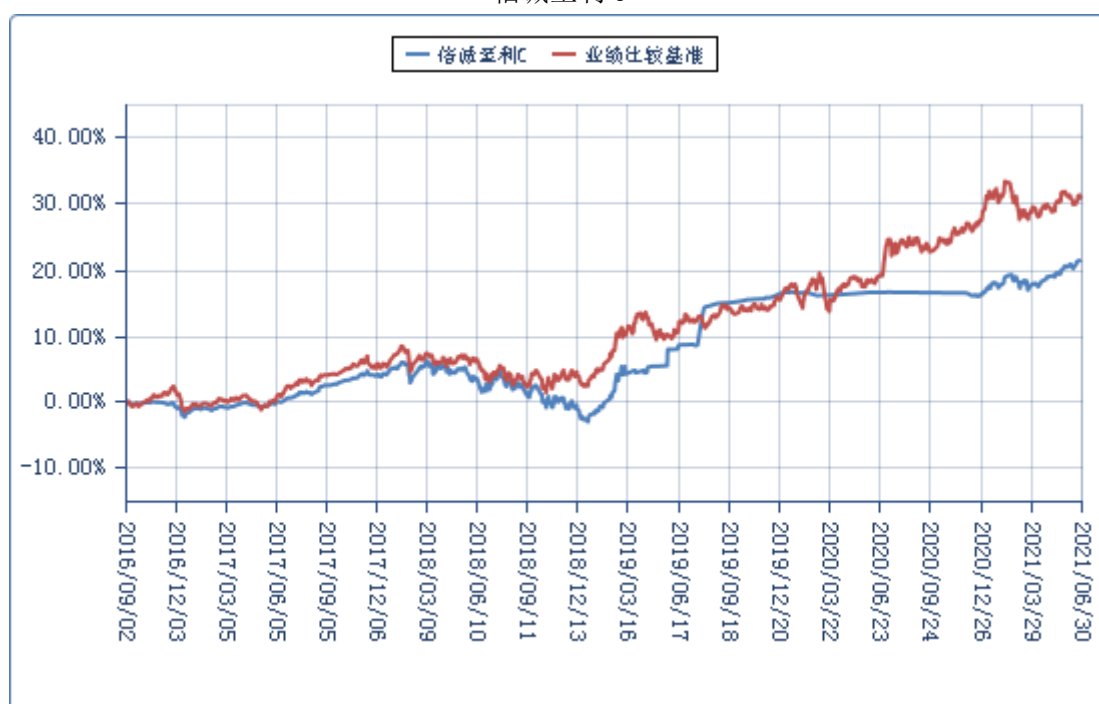


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信诚至利 A



信诚至利 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		
王颖	本基金基金经理	2017 年 09 月 14 日	-	8	王颖女士，经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司，担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、基金经理助理。现任信诚至利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、信诚至诚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的基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚至利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《信诚至利灵活配置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

2021 年上半年,国内经济延续复苏但动能不足、结构分化。出口受益海外经济活动恢复而超预期维持高位,消费修复缓慢低于预期。一季度,全球疫苗有序接种,海外经济复苏超预期,大宗商品涨价,市场对全球流动性拐点的担忧提升,资本市场出现较大的波动;二季度,印度疫情爆发,欧洲疫情时有反复,国内局部地区也不断有疫情出现,加诸国内经济复苏乏力,货币政策较一季度预期的更为温和。

从债券市场看,从债券市场看,上半年国内经济平稳复苏,流动性保持平稳,地方债发行低于预期,机构配置力量较强,10 年国债收益率基本在 3.0-3.3%之间窄幅震荡;信用债方面,信用利

差整体收窄，信用债市场整体情绪有所修复但尾部风险仍存。

从权益市场看，一季度由于流动性预期收紧，全球资本市场均出现了较大的波动。二季度 A 股市场整体震荡为主，小幅上行，但是结构性机会较多。特别是伴随商品价格回落，流动性预期向好，5、6 月市场呈现明显的成长风格，部分行业和板块超额收益明显。

本基金在运作期内按照既定的投资策略，按照中低股票仓位平稳运作，股票部分主要投资于基本面持续向好、且估值具备性价比的行业和个股。债券部分组合利率仓位主要投资于短端品种，满足现金配置要求，信用仓位以风险可控、性价比合适的中短久期优质国企信用债、国有股份行大额存单为主，以及部分风险可控的产业债龙头。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚至利 A 份额净值增长率为 4.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%；信诚至利 C 份额净值增长率为 4.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

#### 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，一方面，PPI 处于高位，美联储开始讨论缩减 QE，货币政策的压力犹在；另一方面，国内经济压力逐步显现，疫情始终有所反复，流动性过于宽松或快速收紧的可能性都不大。

债券市场投资方面，超预期全面降准背景下，预计短期内资金面稳定性将进一步加强，长端利率有望小幅下行；信用方面，在信用分化环境中，仍重点投资于中高信用等级信用债，且当前信用期限利差较为陡峭，可适当考虑资质较好的信用债的久期价值。

权益方面，三季度宏观经济压力可能增大，后续本基金将持续关注经济走向和全球货币政策变化，聚焦高景气行业和赛道，并在其中选择相对估值较低的行业和个股进行投资。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同和托管协议的规定，对信诚至利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信保诚基金管理有限公司在信诚至利灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：信诚至利灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	64,244,585.66	229,884.24
结算备付金	-	10,489,474.46	35,009,625.00
存出保证金	-	1,219,897.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	710,907,052.43	41,369,533.00
其中：股票投资	-	168,501,337.93	14,939,733.00
基金投资	-	-	-
债券投资	-	542,405,714.50	26,429,800.00
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	100,000,000.00	29,900,000.00

应收证券清算款	-	10,614,829.03	-
应收利息	6.4.7.5	5,650,958.71	332,841.74
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	13.00
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	6,200.00
资产总计	-	903,126,797.29	106,848,096.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2021年06月30日</b>	<b>2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	54,509,707.50	-
应付管理人报酬	-	417,366.56	50,978.03
应付托管费	-	69,561.11	8,496.34
应付销售服务费	-	38,500.32	2,584.08
应付交易费用	6.4.7.7	180,440.81	13,737.45
应交税费	-	22,908.85	-
应付利息	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	99,830.97	10,187.90
负债合计	-	55,338,316.12	85,983.80
<b>所有者权益:</b>	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	695,716,510.33	91,296,530.34
未分配利润	6.4.7.10	152,071,970.84	15,465,582.84
所有者权益合计	-	847,788,481.17	106,762,113.18
负债和所有者权益总计	-	903,126,797.29	106,848,096.98

注：截止本报告期末，基金份额总额 695,716,510.33 份。下属分级基金：信诚至利 A 的基金份额净值 1.2197 元，基金份额总额 336,941,222.82 份；信诚至利 C 的基金份额净值 1.2175 元，基金份额总额 358,775,287.51 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚至利灵活配置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	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
<b>一、收入</b>	-	23,656,268.32	1,534.75
1. 利息收入	-	4,106,795.79	773.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	406,106.47	773.60
债券利息收入	-	2,796,678.72	-
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	904,010.60	-
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	11,536,145.40	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,676,868.22	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	83,531.82	-
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	948,834.17	-
股利收益	6.4.7.15	826,911.19	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	7,343,107.18	-
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	670,219.95	761.15
<b>减：二、费用</b>	-	2,414,721.21	2,065.16
1. 管理人报酬	-	1,389,565.26	390.64
2. 托管费	-	231,594.27	64.97
3. 销售服务费	-	117,966.19	49.30
4. 交易费用	6.4.7.18	552,035.66	-
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 税金及附加	-	10,646.92	-
7. 其他费用	6.4.7.19	112,912.91	1,560.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-	21,241,547.11	-530.41
减：所得税费用	-	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-	21,241,547.11	-530.41

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚至利灵活配置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）	91,296,530.34	15,465,582.84	106,762,113.18

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,241,547.11	21,241,547.11
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）	604,419,979.99	115,364,840.89	719,784,820.88
其中：1. 基金申购款	915,968,767.23	177,508,629.87	1,093,477,397.10
2. 基金赎回款	-311,548,787.24	-62,143,788.98	-373,692,576.22
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）	695,716,510.33	152,071,970.84	847,788,481.17
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）	442,773.78	74,772.50	517,546.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-530.41	-530.41
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）	-419,150.74	-70,243.10	-489,393.84
其中：1. 基金申购款	180,468.79	30,295.08	210,763.87
2. 基金赎回款	-599,619.53	-100,538.18	-700,157.71
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）	23,623.04	3,998.99	27,622.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>唐世春</u>	<u>陈逸辛</u>	<u>刘卓</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信诚至利灵活配置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”)证监许可[2016]1623号《关于准予信诚至利灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信诚至利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币500,190,068.40元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1155号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚至利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为500,210,069.31份基金份额,

其中认购资金利息折合 20,000.91 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》,经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准,公司名称由“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”,并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据《信诚至利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费、申购费与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购时收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费的,称为 A 类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费,且对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的,称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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上市的股票)、存托凭证、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、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债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、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;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,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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:  $30\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 70\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月

30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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	64,244,585.66
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	64,244,585.66

### 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	161,182,310.28	168,501,337.93	7,319,027.65

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	83,796,363.71	83,721,714.50	-74,649.21
	银行间市场	458,286,045.19	458,684,000.00	397,954.81
	合计	542,082,408.90	542,405,714.50	323,305.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		703,264,719.18	710,907,052.43	7,642,333.25

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-9,171,360.00	-	-	-
IF2107	-9,171,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-9,171,360.00	-	-	-

注：1、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资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。

2、于本报告期末，本基金持有 6 手沪深 300 股指期货 IF2107，合约市值为-9,344,160.00 元，公允价值变动为-172,800.00 元。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-

##### 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	4,221.16
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	4,774.20
应收债券利息	5,640,978.97
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	939.98
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	44.40
合计	5,650,958.71

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	177,940.81
银行间市场应付交易费用	2,500.00
合计	180,440.81

#### 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	382.92
应付证券出借违约金	-
应付审计费	30,640.68
应付信息披露费	59,507.37
应付账户维护费	9,000.00
其他	300.00

合计	99,830.97
----	-----------

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 实收基金

信诚至利 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	63,890,930.41	63,890,930.41
本期申购	378,220,667.89	378,220,667.89
本期赎回（以“-”号填列）	-105,170,375.48	-105,170,375.48
本期末	336,941,222.82	336,941,222.82

信诚至利 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	27,405,599.93	27,405,599.93
本期申购	537,748,099.34	537,748,099.34
本期赎回（以“-”号填列）	-206,378,411.76	-206,378,411.76
本期末	358,775,287.51	358,775,287.51

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

信诚至利 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	22,428,332.40	-11,576,566.63	10,851,765.77
本期利润	6,555,146.77	4,175,052.38	10,730,199.15
本期基金份额交易产生的变动数	97,831,243.54	-45,392,770.02	52,438,473.52
其中：基金申购款	135,905,695.23	-62,378,012.84	73,527,682.39
基金赎回款	-38,074,451.69	16,985,242.82	-21,089,208.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,814,722.71	-52,794,284.27	74,020,438.44

信诚至利 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	9,538,933.83	-4,925,116.76	4,613,817.07
本期利润	7,343,293.16	3,168,054.80	10,511,347.96
本期基金份额交易产生的变动数	116,869,826.15	-53,943,458.78	62,926,367.37



其中：基金申购款	191,222,752.09	-87,241,804.61	103,980,947.48
基金赎回款	-74,352,925.94	33,298,345.83	-41,054,580.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,752,053.14	-55,700,520.74	78,051,532.40

#### 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	194,498.25	
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	210,287.74	
其他	1,320.48	
合计	406,106.47	

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	160,149,159.72	
减：卖出股票成本总额	150,472,291.50	
买卖股票差价收入	9,676,868.22	

#### 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	83,531.82	
债券投资收益—赎回差价收入	-	
债券投资收益—申购差价收入	-	
合计	83,531.82	

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,177,630.71
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,574,940.00
减：应收利息总额	519,158.89
买卖债券差价收入	83,531.82

#### 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	948,834.17

#### 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	826,911.19
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	826,911.19

#### 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	7,515,907.18
--股票投资	7,256,961.58
--债券投资	258,945.60
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-172,800.00
--权证投资	-
--期货投资	-172,800.00

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	7,343,107.18

#### 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	639,029.31
转换费收入	31,190.64
合计	670,219.95

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，赎回费不低於其总额的 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於其总额的 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	544,860.72
银行间市场交易费用	4,200.00
期货交易费用	2,974.94
合计	552,035.66

#### 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	-
银行费用	5,052.76
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	112,912.91

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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	1,389,565.26	390.64
其中：支付销售机构的客户维护费	419,402.96	181.24

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/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	231,594.27	64.97

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

## 6.4.10.2.3 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		
	信诚至利 A	信诚至利 C	合计
中信保诚基金	-	53,023.32	53,023.32
中信银行	-	57,413.88	57,413.88
合计	-	110,437.20	110,437.20
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		
	信诚至利 A	信诚至利 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金信诚至利 A 基金份额不收取销售服务费，信诚至利 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

信诚至利 C 的销售服务费按前一日信诚至利 C 资产净值的 0.10% 年费率计提。

计算公式为：信诚至利 C 基金日销售服务费=信诚至利 C 基金份额前一日资产净值×0.10%/当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

信诚至利 A

份额单位：份

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 09 月 02 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	15,483,663.76	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	15,483,663.76	-
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	4.60%	-

注：本基金的基金管理人运用自有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行。

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

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
中信银行	64,244,585.66	194,498.25	31,024.02	756.42

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末 2021 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

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

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
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	-

301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	锁定期股票	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
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	-



			日							
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	-
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	-
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	-
688269	凯立新材	2021年06月01日	2021年12月09日	锁定期股票	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
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	-
688517	金冠电气	2021年06月10日	2021年12月	锁定期股票	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-

		日	月 20 日							
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	-

#### 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17 日	2021 年07 月01 日	新发未上市	100.00	100.00	2,470	247,000.00	247,000.00	-

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 and 监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部 and 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	298,302,410.00	6,993,800.00
合计	298,302,410.00	6,993,800.00

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

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	106,903,000.00	19,436,000.00
合计	106,903,000.00	19,436,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	131,761,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	5,439,304.50	-
合计	137,200,304.50	-

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时间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上市公司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。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末	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
-----	-------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2021年06月30日							
资产							
银行存款	64,244,585.66	-	-	-	-	-	64,244,585.66
结算备付金	10,489,474.46	-	-	-	-	-	10,489,474.46
存出保证金	98,597.80	-	-	-	-	1,121,299.20	1,219,897.00
交易性金融资产	35,082,500.00	51,119,000.00	364,557,214.50	91,400,000.00	247,000.00	168,501,337.93	710,907,052.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,614,829.03	10,614,829.03
应收利息	-	-	-	-	-	5,650,958.71	5,650,958.71
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	-
资产总计	209,915,157.92	51,119,000.00	364,557,214.50	91,400,000.00	247,000.00	185,888,424.87	903,126,797.29
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	54,509,707.50	54,509,707.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	417,366.56	417,366.56
应付托管费	-	-	-	-	-	69,561.11	69,561.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	38,500.32	38,500.32

应付交易费用	-	-	-	-	-	180,440.81	180,440.81
应交税费	-	-	-	-	-	22,908.85	22,908.85
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	99,830.97	99,830.97
负债总计	-	-	-	-	-	55,338,316.12	55,338,316.12
利率敏感度缺口	209,915,157.92	51,119,000.00	364,557,214.50	91,400,000.00	247,000.00	130,550,108.75	847,788,481.17
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	229,884.24	-	-	-	-	-	229,884.24
结算备付金	35,009,625.00	-	-	-	-	-	35,009,625.00
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,999,800.00	-	24,430,000.00	-	-	14,939,733.00	41,369,533.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	29,900,000.00	-	-	-	-	-	29,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	332,841.74	332,841.74
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	13.00	13.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	6,200.00	6,200.00
资产总计	67,139,309.24	-	24,430,000.00	-	-	15,278,787.74	106,848,096.98
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							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,978.03	50,978.03
应付托管费	-	-	-	-	-	8,496.34	8,496.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,584.08	2,584.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,737.45	13,737.45
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	10,187.90	10,187.90
负债总计	-	-	-	-	-	85,983.80	85,983.80
利率敏感度缺口	67,139,309.24	-	24,430,000.00	-	-	15,192,803.94	106,762,113.18

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年06月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降25个基点	830,078.43	37,351.92
	市场利率上升25个基点	-826,944.70	-37,238.51

#### 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公司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。

本基金持有的证券交易所上市的股票的比例较低，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	168,501,337.93	19.88	14,939,733.00	13.99
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	168,501,337.93	19.88	14,939,733.00	13.99

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为162,389,977.06元，属于第二层次的余额为548,517,075.37元，无属于第三层次的余

额(上年度末: 第一层次 14,939,733.00 元, 第二层次 26,429,800.00 元, 无第三层次)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	168,501,337.93	18.66
	其中: 股票	168,501,337.93	18.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	542,405,714.50	60.06
	其中: 债券	542,405,714.50	60.06
	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	100,000,000.00	11.07
	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	74,734,060.12	8.28
8	其他各项资产	17,485,684.74	1.94
9	合计	903,126,797.29	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,642,653.00	0.19
B	采矿业	2,883,720.00	0.34
C	制造业	97,356,437.24	11.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,280,684.60	0.86
E	建筑业	668,737.44	0.08
F	批发和零售业	4,746,094.96	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	3,938,949.00	0.46
H	住宿和餐饮业	1,788,230.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,276,860.39	0.15
J	金融业	32,115,712.10	3.79
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	4,589,401.20	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	6,032,176.00	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,103,650.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	1,078,032.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	168,501,337.93	19.88

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601818	光大银行	2,538,900	9,597,042.00	1.13
2	601398	工商银行	1,335,900	6,906,603.00	0.81
3	600036	招商银行	120,400	6,524,476.00	0.77

4	601166	兴业银行	309,600	6,362,280.00	0.75
5	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.61
6	601233	桐昆股份	212,500	5,119,125.00	0.60
7	000683	远兴能源	932,000	4,352,440.00	0.51
8	002438	江苏神通	361,100	3,990,155.00	0.47
9	688598	金博股份	14,100	3,792,900.00	0.45
10	002266	浙富控股	743,400	3,709,566.00	0.44
11	000963	华东医药	80,300	3,694,603.00	0.44
12	000807	云铝股份	295,600	3,517,640.00	0.41
13	600111	北方稀土	168,200	3,481,740.00	0.41
14	002626	金达威	75,900	3,392,730.00	0.40
15	000733	振华科技	52,400	3,200,068.00	0.38
16	002466	天齐锂业	50,800	3,150,616.00	0.37
17	000516	国际医学	165,000	3,103,650.00	0.37
18	603259	药明康德	19,680	3,081,691.20	0.36
19	000059	华锦股份	363,200	2,963,712.00	0.35
20	002192	融捷股份	42,000	2,883,720.00	0.34
21	002597	金禾实业	79,900	2,772,530.00	0.33
22	601939	建设银行	404,600	2,690,590.00	0.32
23	002402	和而泰	111,100	2,663,067.00	0.31
24	603128	华贸物流	183,000	2,578,470.00	0.30
25	002139	拓邦股份	134,600	2,421,454.00	0.29
26	000933	神火股份	255,900	2,418,255.00	0.29
27	002025	航天电器	39,861	1,999,826.37	0.24
28	002129	中环股份	51,000	1,968,600.00	0.23
29	603179	新泉股份	58,800	1,933,344.00	0.23
30	688198	佰仁医疗	8,200	1,869,600.00	0.22
31	300705	九典制药	48,800	1,856,840.00	0.22
32	600765	中航重机	81,100	1,836,915.00	0.22
33	688389	普门科技	59,100	1,812,006.00	0.21
34	600754	锦江酒店	31,400	1,788,230.00	0.21
35	300390	天华超净	36,500	1,753,095.00	0.21
36	300726	宏达电子	24,600	1,734,054.00	0.20
37	002179	中航光电	21,900	1,730,538.00	0.20
38	688208	道通科技	19,695	1,713,268.05	0.20
39	002034	旺能环境	106,000	1,690,700.00	0.20
40	601615	明阳智能	103,600	1,677,284.00	0.20
41	300087	荃银高科	73,300	1,642,653.00	0.19
42	601058	赛轮轮胎	164,400	1,642,356.00	0.19
43	603566	普莱柯	72,000	1,641,600.00	0.19
44	603267	鸿远电子	12,700	1,624,584.00	0.19

45	002991	甘源食品	26,800	1,616,844.00	0.19
46	688202	美迪西	2,900	1,507,710.00	0.18
47	300573	兴齐眼药	10,600	1,494,918.00	0.18
48	600380	健康元	108,400	1,488,332.00	0.18
49	600483	福能股份	139,200	1,460,208.00	0.17
50	600519	贵州茅台	700	1,439,690.00	0.17
51	603901	永创智能	79,000	1,424,370.00	0.17
52	002242	九阳股份	43,800	1,423,062.00	0.17
53	000063	中兴通讯	42,700	1,418,921.00	0.17
54	002563	森马服饰	117,400	1,402,930.00	0.17
55	002092	中泰化学	136,200	1,398,774.00	0.16
56	002756	永兴材料	23,500	1,395,665.00	0.16
57	603066	音飞储存	170,700	1,360,479.00	0.16
58	603605	珀莱雅	6,600	1,298,286.00	0.15
59	603337	杰克股份	42,600	1,138,698.00	0.13
60	603801	志邦家居	35,000	1,118,600.00	0.13
61	688408	中信博	5,400	1,084,320.00	0.13
62	300133	华策影视	182,100	1,078,032.00	0.13
63	002315	焦点科技	59,100	1,069,710.00	0.13
64	603939	益丰药房	17,550	984,379.50	0.12
65	603225	新凤鸣	44,500	903,350.00	0.11
66	603583	捷昌驱动	16,800	850,416.00	0.10
67	688002	睿创微纳	8,000	798,640.00	0.09
68	603855	华荣股份	40,000	684,000.00	0.08
69	600116	三峡水利	79,000	660,440.00	0.08
70	600039	四川路桥	104,900	657,723.00	0.08
71	600323	瀚蓝环境	29,000	631,910.00	0.07
72	002064	华峰化学	16,000	227,200.00	0.03
73	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.02
74	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
75	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.01
76	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
77	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
78	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
79	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
80	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
81	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
82	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
83	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
84	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
85	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00

86	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
87	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
88	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
89	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
90	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
91	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
92	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
93	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
94	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
95	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
96	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
97	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
98	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
99	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	601818	光大银行	9,424,868.00	8.83
2	601166	兴业银行	8,977,764.00	8.41
3	600036	招商银行	8,854,424.00	8.29
4	600519	贵州茅台	6,508,905.68	6.10
5	601398	工商银行	6,163,842.00	5.77
6	002034	旺能环境	5,673,564.23	5.31
7	000683	远兴能源	5,459,406.00	5.11
8	002266	浙富控股	4,855,962.85	4.55
9	002438	江苏神通	4,570,980.00	4.28
10	600111	北方稀土	4,563,780.00	4.27
11	601601	中国太保	4,517,701.03	4.23
12	002179	中航光电	4,274,585.00	4.00
13	603566	普莱柯	4,232,999.00	3.96
14	601233	桐昆股份	4,185,674.00	3.92
15	000963	华东医药	4,071,944.60	3.81
16	601318	中国平安	3,780,590.60	3.54
17	000933	神火股份	3,744,345.00	3.51
18	000651	格力电器	3,651,785.52	3.42
19	002466	天齐锂业	3,647,143.28	3.42
20	603259	药明康德	3,641,455.00	3.41
21	300087	荃银高科	3,516,547.00	3.29

22	000807	云铝股份	3,438,466.00	3.22
23	600905	三峡能源	3,436,527.95	3.22
24	000516	国际医学	3,435,497.00	3.22
25	688598	金博股份	3,390,531.08	3.18
26	600323	瀚蓝环境	3,383,989.00	3.17
27	002092	中泰化学	3,179,721.00	2.98
28	300390	天华超净	3,109,662.00	2.91
29	601058	赛轮轮胎	3,069,489.25	2.88
30	000733	振华科技	3,022,731.00	2.83
31	002991	甘源食品	3,002,022.00	2.81
32	002532	天山铝业	2,985,966.00	2.80
33	002626	金达威	2,915,799.67	2.73
34	002597	金禾实业	2,839,817.00	2.66
35	600409	三友化工	2,812,769.00	2.63
36	000059	华锦股份	2,796,323.00	2.62
37	688202	美迪西	2,791,167.73	2.61
38	603128	华贸物流	2,777,796.60	2.60
39	300726	宏达电子	2,641,900.00	2.47
40	000858	五粮液	2,607,972.00	2.44
41	002192	融捷股份	2,565,373.00	2.40
42	002402	和而泰	2,497,416.80	2.34
43	002025	航天电器	2,366,617.85	2.22
44	002756	永兴材料	2,360,591.40	2.21
45	000822	山东海化	2,300,175.00	2.15
46	002139	拓邦股份	2,171,801.00	2.03

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	600519	贵州茅台	6,260,283.79	5.86
2	601601	中国太保	5,280,005.00	4.95
3	600036	招商银行	4,807,691.00	4.50
4	002034	旺能环境	3,844,674.00	3.60
5	601318	中国平安	3,669,978.20	3.44
6	000651	格力电器	3,501,475.00	3.28
7	002179	中航光电	3,187,575.00	2.99
8	000822	山东海化	3,066,668.00	2.87
9	002532	天山铝业	2,955,825.00	2.77
10	603566	普莱柯	2,925,076.00	2.74
11	600409	三友化工	2,697,161.00	2.53



12	000858	五 粮 液	2,691,527.00	2.52
13	600323	瀚蓝环境	2,631,895.00	2.47
14	603520	司太立	2,459,607.00	2.30
15	601166	兴业银行	2,397,609.00	2.25
16	688202	美迪西	2,344,935.63	2.20
17	603588	高能环境	2,204,030.00	2.06
18	601168	西部矿业	2,166,702.72	2.03
19	300390	天华超净	2,099,815.00	1.97
20	601398	工商银行	1,986,899.00	1.86

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	296,776,934.85
卖出股票收入（成交）总额	160,149,159.72

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	37,921,410.00	4.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,439,304.50	0.64
	其中：政策性金融债	5,439,304.50	0.64
4	企业债券	40,114,000.00	4.73
5	企业短期融资券	260,381,000.00	30.71
6	中期票据	91,400,000.00	10.78
7	可转债（可交换债）	247,000.00	0.03
8	同业存单	106,903,000.00	12.61
9	其他	-	-
10	合计	542,405,714.50	63.98

#### 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	112105103	21 建设银行 CD103	1,000,000	97,180,000.00	11.46
2	101900893	19 中建材 MTN002	400,000	40,560,000.00	4.78
3	101901120	19 中电投 MTN015A	300,000	30,294,000.00	3.57
4	012100791	21 中粮 SCP002	300,000	30,072,000.00	3.55

5	012101841	21 外高桥 SCP001	300,000	30,027,000.00	3.54
---	-----------	---------------	---------	---------------	------

### 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
IF2107	IF2107	-6	9,344,160.00	-172,800.00	-
公允价值变动总额合计					-172,800.00
股指期货投资本期收益					948,834.17
股指期货投资本期公允价值变动					-172,800.00

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

中国建设银行股份有限公司于 2020 年 7 月 13 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）32 号），因内控管理不到位等违法违规事实被罚款合计 3920 万元。

对“21 建设银行 CD103”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对建设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	1,219,897.00
2	应收证券清算款	10,614,829.03
3	应收股利	-
4	应收利息	5,650,958.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,485,684.74

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.61	锁定期股票

## 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
信诚至利 A	589	572,056.41	241,416,006.10	71.65%	95,525,216.72	28.35%
信诚至利 C	442	811,708.80	275,434,584.70	76.77%	83,340,702.81	23.23%
合计	1,031	674,797.78	516,850,590.80	74.29%	178,865,919.53	25.71%

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	信诚至利 A	14,415.70	0.00%
	信诚至利 C	419,785.36	0.12%
	合计	434,201.06	0.06%

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)
	信诚至利 A	0~10
	信诚至利 C	10~50

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	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚至利 A	0
	信诚至利 C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚至利 A	信诚至利 C
基金合同生效日（2016 年 09 月 02 日）基金份额总额	500,140,923.86	69,145.45
本报告期期初基金份额总额	63,890,930.41	27,405,599.93
本报告期基金总申购份额	378,220,667.89	537,748,099.34
减：本报告期基金总赎回份额	105,170,375.48	206,378,411.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	336,941,222.82	358,775,287.51

### § 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，基金托管人的专门基金托管部门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

本报告期内，本基金就参与存托凭证投资事宜修订基金合同等法律文件，增加存托凭证的投资策略。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	121,808,289.80	27.13%	89,079.23	27.13%	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	62,301,670.77	13.87%	45,561.72	13.87%	-
中信建投	1	264,944,329.04	59.00%	193,752.52	59.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,005,960.00	1.28%	-	-	-	-	-
中信建投	77,854,722.31	98.72%	3,957,900,000.00	100.00%	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-

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

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚至利灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、定期定额投资的公告	《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20日
2	信诚至利灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	同上	2021年01月22日
3	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金2020年第四季度报告提示性公告	同上	2021年01月22日
4	信诚至利灵活配置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
5	信诚至利灵活配置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
6	信诚至利灵活配置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
7	信诚至利灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	同上	2021年03月26日
8	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
9	信诚至利灵活配置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
10	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	信诚至利灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021年05月13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 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、信诚至利灵活配置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、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 4、信诚至利灵活配置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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2021 年 08 月 27 日