

# 中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国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 03 月 30 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4	信息披露方式 .....	8
2.5	其他相关资料 .....	8
§ 3	主要财务指标和基金净值表现 .....	8
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2	基金净值表现 .....	9
§ 4	管理人报告 .....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§ 5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1	资产负债表 .....	16
6.2	利润表 .....	17
6.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4	报表附注 .....	19
§ 7	投资组合报告 .....	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 .....	43
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 .....	45
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12	投资组合报告附注 .....	48

§ 8	基金份额持有人信息 .....	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	50
§ 9	开放式基金份额变动 .....	50
§ 10	重大事件揭示 .....	50
10.1	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 .....	50
10.2	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.3	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.4	其他重大事件 .....	53
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
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 .....	53
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
§ 12	备查文件目录 .....	53
12.1	备查文件目录 .....	53
12.2	存放地点 .....	54
12.3	查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金
基金简称	中信保诚龙腾精选
基金主代码	011284
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 03 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
报告期末基金份额总额	260,616,236.74 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行或上市的股票、港股通标的股票、债券、现金、金融衍生品等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的回报。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合。</p> <p>（1）自上而下的行业选择</p> <p>本基金将自上而下对行业的生命周期、商业模式、竞争格局、风险因素等进行分析，选择具有良好的商业模式和成长空间、景气度向上、政策中长期支持的行业。</p> <p>（2）自下而上的个股选择</p> <p>本基金将通过定量和定性相结合的方法自下而上地精选具有良好的公司治理、可辨识的竞争壁垒、优秀的财务指标（ROE、现金流）、估值</p>

	<p>与内生成长性相匹配的优质个股。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法，严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>6、股指期货投资策略</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在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋</p>
--	---

	<p>势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>8、股票期权投资策略 本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>9、融资投资策略 本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的，本基金将从其最新规定。</p> <p>10、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率*20%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称	中信保诚基金管理有限公司		中国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		北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

	行大楼 9 层	
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	781,310.37
本期利润	5,697,238.10
加权平均基金份额本期利润	0.0209
本期加权平均净值利润率	2.08%
本期基金份额净值增长率	2.11%
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	748,387.27
期末可供分配基金份额利润	0.0029
期末基金资产净值	266,114,609.98
期末基金份额净值	1.0211
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	2.11%

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。

4、本基金合同在当期生效，本报告期不足半年。

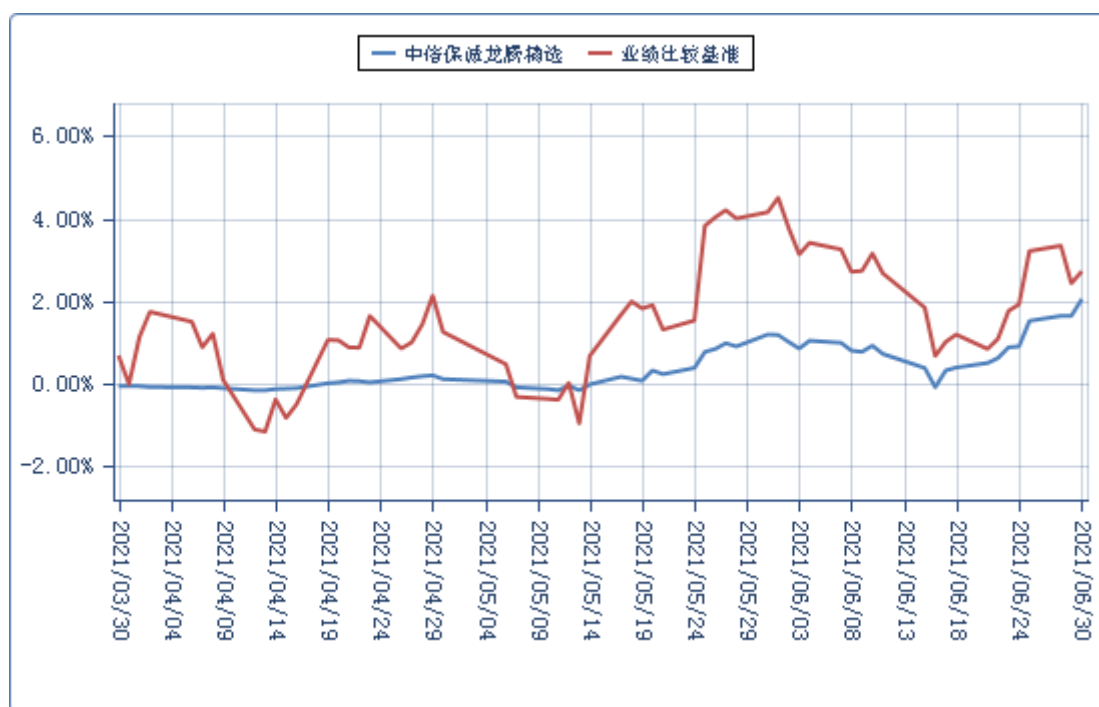


### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.85%	0.26%	-1.38%	0.58%	2.23%	-0.32%
过去三个月	2.11%	0.17%	2.72%	0.71%	-0.61%	-0.54%
自基金合同生效起至今	2.11%	0.17%	2.78%	0.71%	-0.67%	-0.54%

#### 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：1、本基金合同生效日为 2021 年 03 月 30 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

2、本基金建仓期自 2021 年 03 月 30 日至 2021 年 09 月 30 日，截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、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		
吴昊	本基金基金经理、研究部总监	2021 年 03 月 30 日	-	14	吴昊先生，经济学硕士，CFA。曾任职于上海申银万国证券研究有限公司，从事研究工作。2010 年 11 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总监。现任研究部总监，中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚新机遇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、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚龙腾精选混合

					型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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《中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金合同》、《中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规, 没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》, 公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职, 投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会, 建立公平交易的制度环境; 交易环节加强交易执行的内部控制, 利用恒生交易系统公平交易相关程序, 及其它的流程控制, 确保不同基金在一、二级市场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 年我国经济增长在疫情后出现了低基数下的高位回落, 一季度 GDP 同比增长 18.3%, 二季度 GDP 同比增长 7.9%, 预计下半年经济增长将进一步向潜在增长水平回落。A 股市场在经历了一季度的大幅调整后, 在二季度出现了比价持续的上涨, 上半年上证综指上涨 3.4%、沪深 300 指数上

涨 0.2%、中小板指上涨 3.7%、创业板指上涨 17%。分行业来看，电气设备、钢铁、化工、采掘和有色金属上半年分别上涨 24%、24%、21%、17%和 12%，涨幅领先；保险、家用电器、国防军工、房地产和券商上半年分别下跌 25%、16%、12%、9.0%和 8.6%，跌幅靠前。

本基金在一季度末成立，在二季度完成了 45%左右权益头寸的建立，在高景气高估值方向，主要布局了新能源汽车、智能驾驶、光伏、康复医疗等投资方向；在估值相对较低的方向，主要布局了城商行、新材料、中国优势制造、新型厨房电器、智能安防和互联网游戏等投资方向。我们会总结经验教训，进一步完善投资分析框架，自上而下寻找成功概率高的投资方向，争取在未来的投资中，给投资者带来相对稳定的长期收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 2.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.78%。

#### 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，无论是同比还是季调环比，中国经济增长都将边际放缓。从国内角度来看，紧信用的周期还没有走完，社融增速仍在向名义 GDP 增长收敛的过程中，使得投资端总体很难出现大的增长，而消费端的修复仍旧低于我们的预期，我们将对相关数据保持跟踪。从外需来看，美国商品消费出现了边际动能放缓，后续经济增长的动能将从商品转向服务，因此对中国经济的拉动可能边际弱化，欧洲和其他地区的需求能否拉动中国的出口增长，我们也将保持跟踪。

从已经披露的中报预告来看，增长比较突出的集中在上游原材料和一些与经济周期弱相关的高景气行业，例如医药、新能源汽车、半导体和国防军工；与经济周期强相关的行业，我们对景气度的延续持谨慎态度，与经济弱相关、获得产业政策支持的行业，我们对景气度的延续持乐观态度。

对于 2021 年下半年市场的流动性环境，我们保持谨慎乐观。尽管 2 季度通胀水平和预期达到历史高位，下半年回落的幅度也不会特别明显，但从货币当局的应对来看，通胀并没有成为强的政策约束。中国央行在 7 月意外降准，海外疫情的反弹也让美国就业市场的修复异常缓慢，中美长端利率同步下行，全球流动性环境仍旧维持较为宽松的状态，伴随中国经济增长的回落，以及美国经济增长动能的消退，预计中国国内货币环境最紧的时点已经过去，而美国货币政策正常化仍阻力重重。

从微观结构来看，流动性结构性充裕的现象进一步加剧，一方面更多的资产在 2 季度末集中在管理规模 100 亿以上的基金经理，另一方面，各行业均出现了比较明显的减持，集中加仓与新能源汽车产业链相关的电气设备、化工、有色金属、以及钢铁行业。对于投资者一致看好的高景气资产，其定价是否已经充分，是一个非常有挑战的问题，但目前的资金聚集结构，更利于被集中交易的资

产估值扩张。

进入 5 月以来，随着商品价格的见顶回落，市场的风险偏好出现了明显的结构分化，与经济周期强相关的资产面临估值压缩，而进入 7 月后，随着对境外上市企业的被调查，互联网反垄断处罚的落地，以及学科教育政策的出台，面临政策调控风险的中国资产，在全球各证券市场出现了比较剧烈的调整；而另一方面，符合产业升级、绿色低碳方向，获得产业政策中长期支持的行业，以新能源车和半导体为代表，风险偏好出现了明显的扩张，而风险偏好压缩资产流出的资金增配这些行业，又加速了这些行业估值的扩张。

目前 A 股的整体估值水平，随着企业盈利的增长，以及长端利率的回落，较年初有所改善，但是结构性的分化却进一步加强，2021 年 6 月末公募基金重仓的 50 只股票按持有市值加权的 PB 偏离度又回到了 100%以上。

在当前的市场环境下，我们认为可以适当增加景气度的权重，淡化绝对估值的权重，淡化总量的矛盾，强调结构的机会，在符合国家产业政策、具备长期发展空间、发挥中国比较优势的细分方向里，寻找具备长期竞争力、具备相对定价优势的资产；对于景气度下行，但具备长期竞争力的公司，我们会跟踪景气度变化，努力把握景气拐点前后的布局机会。另一方面，我们也将对流动性环境和产业政策方向保持跟踪，时刻警惕估值波动的风险，并做好预案。

#### 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的真实、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：中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金  
报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	159,879,164.48
结算备付金	-	2,584,066.25
存出保证金	-	16,589.08
交易性金融资产	6.4.7.2	141,974,058.35
其中：股票投资	-	120,882,058.35
基金投资	-	-
债券投资	-	21,092,000.00
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	414,725.62
应收股利	-	-
应收申购款	-	44,393.46
递延所得税资产	-	-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计	-	304,912,997.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 06 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		



短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	26,308,385.03
应付赎回款	-	11,881,488.14
应付管理人报酬	-	338,863.27
应付托管费	-	56,477.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	121,631.97
应交税费	-	4,970.26
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	6.4.7.8	86,571.36
负债合计	-	38,798,387.26
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	6.4.7.9	260,616,236.74
未分配利润	6.4.7.10	5,498,373.24
所有者权益合计	-	266,114,609.98
负债和所有者权益总计	-	304,912,997.24

注：1、截止本报告期末，基金份额净值 1.0211 元，基金份额总额 260,616,236.74 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 03 月 30 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：中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>	-	7,122,896.37
1. 利息收入	-	1,445,110.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	226,432.20
债券利息收入	-	770,837.76
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	447,840.74
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	732,004.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	131,863.15

基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-200,158.31
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	800,299.82
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	4,915,927.73
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	29,853.28
<b>减：二、费用</b>	-	1,425,658.27
1. 管理人报酬	-	1,033,767.66
2. 托管费	-	172,294.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	157,663.80
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	1,606.45
7. 其他费用	6.4.7.19	60,325.73
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	-	5,697,238.10
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	-	5,697,238.10

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 03 月 30 日(基金合同生效日)至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 03 月 30 日(基金合同生效日)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)	272,314,172.54	-	272,314,172.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,697,238.10	5,697,238.10
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)	-11,697,935.80	-198,864.86	-11,896,800.66
其中：1. 基金申购款	43,651.34	742.12	44,393.46
2. 基金赎回款	-11,741,587.14	-199,606.98	-11,941,194.12
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)	260,616,236.74	5,498,373.24	266,114,609.98

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

中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2424号《关于准予中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚龙腾精选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 272,254,719.36 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(2021)第 0309 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 272,314,172.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 59,453.18 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 60%—95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*60%+恒生指数收益率\*20%+中债综合财富(总值)指数收益率\*20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布

的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 03 月 30 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 03 月 30 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 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）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中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。

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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	159,879,164.48
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	159,879,164.48

### 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	115,972,130.62	120,882,058.35	4,909,927.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,086,000.00	21,092,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	21,086,000.00	21,092,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	137,058,130.62	141,974,058.35	4,915,927.73

### 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	1,267.13
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	1,046.52
应收债券利息	412,405.22
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	6.75
合计	414,725.62

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	119,706.97
银行间市场应付交易费用	1,925.00
合计	121,631.97

#### 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	29,852.70
应付证券出借违约金	-
应付审计费	20,144.73
应付信息披露费	33,573.93
应付账户维护费	3,000.00
合计	86,571.36

#### 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 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	272,314,172.54	272,314,172.54
本期申购	43,651.34	43,651.34
本期赎回（以“-”号填列）	-11,741,587.14	-11,741,587.14
本期末	260,616,236.74	260,616,236.74

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	781,310.37	4,915,927.73	5,697,238.10
本期基金份额交易产生的变动数	-32,923.10	-165,941.76	-198,864.86
其中：基金申购款	122.90	619.22	742.12
基金赎回款	-33,046.00	-166,560.98	-199,606.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	748,387.27	4,749,985.97	5,498,373.24

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	194,861.11
结算备付金利息收入	8,629.85
其他	33.63
合计	226,432.20

注：1、其他存款利息收入为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款的利息收入。

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 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 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	13,850,228.91
减：卖出股票成本总额	13,718,365.76
买卖股票差价收入	131,863.15

#### 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03月30日（基金合同生效日） 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	-200,158.31
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	-200,158.31

##### 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03月30日（基金合同生效日）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	258,214,304.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	257,028,528.31
减：应收利息总额	1,385,934.87
买卖债券差价收入	-200,158.31

##### 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 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	800,299.82
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	800,299.82

#### 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 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,915,927.73
-- 股票投资	4,909,927.73
-- 债券投资	6,000.00
-- 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	4,915,927.73

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	29,853.28
合计	29,853.28

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
----	--

交易所市场交易费用	155,738.80
银行间市场交易费用	1,925.00
合计	157,663.80

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月30日（基金合同生效日）至 2021年06月30日
审计费用	20,144.73
信息披露费	33,573.93
证券出借违约金	-
银行费用	3,207.07
账户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	60,325.73

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国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03月30日（基金合同生效日）至2021年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,033,767.66
其中：支付销售机构的客户维护费	507,687.20

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月30日（基金合同生效日）至2021年06月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,294.63



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 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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

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

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 03 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	159,879,164.48	22,907.61

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
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	-

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	10,900	1,090,000.00	1,090,000.00	-

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和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	20,002,000.00
合计	20,002,000.00

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

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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	1,090,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	1,090,000.00

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	159,879,164.48	-	-	-	-	-	159,879,164.48
结算备付金	2,584,066.25	-	-	-	-	-	2,584,066.25
存出保证金	16,589.08	-	-	-	-	-	16,589.08
交易性金融资产	20,002,000.00	-	-	-	1,090,000.00	120,882,058.35	141,974,058.35
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	-	-	-	-	-	414,725.62	414,725.62
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	44,393.46	44,393.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	182,481,819.81	-	-	-	1,090,000.00	121,341,177.43	304,912,997.24
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	-	-	-	-	-	26,308,385.03	26,308,385.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,881,488.14	11,881,488.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	338,863.27	338,863.27
应付托管费	-	-	-	-	-	56,477.23	56,477.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	121,631.97	121,631.97
应交税费	-	-	-	-	-	4,970.26	4,970.26
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	86,571.36	86,571.36
负债总计	-	-	-	-	-	38,798,387.26	38,798,387.26
利率敏感度缺口	182,481,819.81	-	-	-	1,090,000.00	82,542,790.17	266,114,609.98

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 03 月 30 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	9,474,379.07	-	9,474,379.07
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-



应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	9,474,379.07	-	9,474,379.07
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,474,379.07	-	9,474,379.07

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	
	所有外币相对人民币升值 5%		473,718.95
	所有外币相对人民币贬值 5%		-473,718.95

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金持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	120,882,058.35	45.42
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	120,882,058.35	45.42

#### 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%	1,463,630.35
业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-1,463,630.35	

#### 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 120,862,685.52 元，属于第二层次的余额为 21,111,372.83 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	120,882,058.35	39.64
	其中：股票	120,882,058.35	39.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,092,000.00	6.92
	其中：债券	21,092,000.00	6.92
	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	162,463,230.73	53.28
8	其他各项资产	475,708.16	0.16
9	合计	304,912,997.24	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 9,474,379.07 元，占净值比例为 3.56%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	91,589,394.25	34.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
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	4,035,225.20	1.52

J	金融业	12,854,780.00	4.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,904,245.00	1.09
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	111,407,679.28	41.86

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息科技	9,474,379.07	3.56
合计	9,474,379.07	3.56

注：以上分类采用全球行业分类系统(GICS)提供的国际通用分类标准。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600919	江苏银行	1,059,760	7,524,296.00	2.83
2	002508	老板电器	156,500	7,277,250.00	2.73
3	002415	海康威视	100,800	6,501,600.00	2.44
4	300316	晶盛机电	126,700	6,398,350.00	2.40
5	00700	腾讯控股	12,900	6,268,557.89	2.36
6	300630	普利制药	112,500	5,895,000.00	2.22
7	601009	南京银行	506,700	5,330,484.00	2.00
8	002920	德赛西威	43,700	4,810,496.00	1.81
9	601567	三星医疗	224,500	4,781,850.00	1.80
10	002475	立讯精密	103,900	4,779,400.00	1.80
11	300639	凯普生物	121,249	4,002,429.49	1.50
12	600600	青岛啤酒	31,700	3,666,105.00	1.38
13	300750	宁德时代	6,100	3,262,280.00	1.23
14	300083	创世纪	295,300	3,233,535.00	1.22
15	603583	捷昌驱动	63,420	3,210,320.40	1.21
16	02382	舜宇光学科技	15,700	3,205,821.18	1.20

17	002460	赣锋锂业	26,100	3,160,449.00	1.19
18	002430	杭氧股份	91,272	3,157,098.48	1.19
19	688329	艾隆科技	56,264	3,075,390.24	1.16
20	002001	新和成	102,620	2,943,141.60	1.11
21	601058	赛轮轮胎	287,600	2,873,124.00	1.08
22	601208	东材科技	167,500	2,733,600.00	1.03
23	300451	创业慧康	273,370	2,416,590.80	0.91
24	600882	妙可蓝多	33,900	2,366,220.00	0.89
25	000786	北新建材	51,500	2,021,375.00	0.76
26	600219	南山铝业	548,300	1,973,880.00	0.74
27	601012	隆基股份	20,440	1,815,889.60	0.68
28	000636	风华高科	57,700	1,743,694.00	0.66
29	002271	东方雨虹	29,200	1,615,344.00	0.61
30	002027	分众传媒	171,500	1,613,815.00	0.61
31	600845	宝信软件	31,560	1,606,404.00	0.60
32	603501	韦尔股份	4,900	1,577,800.00	0.59
33	600887	伊利股份	41,100	1,513,713.00	0.57
34	601888	中国中免	4,300	1,290,430.00	0.48
35	600519	贵州茅台	300	617,010.00	0.23
36	002318	久立特材	45,500	546,910.00	0.21
37	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
38	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
39	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
40	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
41	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
42	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	300083	创世纪	10,792,928.00	4.06
2	600919	江苏银行	7,737,696.60	2.91
3	002508	老板电器	6,831,311.00	2.57
4	00700	腾讯控股	6,395,272.11	2.40
5	002415	海康威视	6,200,936.00	2.33
6	300630	普利制药	5,604,232.00	2.11
7	300316	晶盛机电	5,539,896.00	2.08
8	601009	南京银行	5,276,408.00	1.98
9	601567	三星医疗	4,706,702.00	1.77

10	002920	德赛西威	4,632,935.00	1.74
11	002475	立讯精密	4,223,101.00	1.59
12	300639	凯普生物	3,771,571.13	1.42
13	000636	风华高科	3,386,664.00	1.27
14	002001	新和成	3,276,570.00	1.23
15	600600	青岛啤酒	3,223,086.00	1.21
16	002460	赣锋锂业	3,191,126.00	1.20
17	601208	东材科技	3,094,657.00	1.16
18	603583	捷昌驱动	3,028,516.80	1.14
19	002430	杭氧股份	2,956,203.52	1.11
20	601058	赛轮轮胎	2,884,144.00	1.08

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	300083	创世纪	7,464,382.00	2.80
2	000636	风华高科	1,864,723.00	0.70
3	000650	仁和药业	841,431.00	0.32
4	601208	东材科技	618,897.00	0.23
5	600690	海尔智家	460,574.00	0.17
6	601009	南京银行	407,283.00	0.15
7	601166	兴业银行	388,920.00	0.15
8	002299	圣农发展	386,071.66	0.15
9	000550	江铃汽车	377,733.00	0.14
10	000596	古井贡酒	292,345.00	0.11
11	601799	星宇股份	285,497.00	0.11
12	603113	金能科技	199,723.00	0.08
13	601601	中国太保	183,353.00	0.07
14	603529	爱玛科技	66,336.90	0.02
15	605259	绿田机械	12,959.35	0.00

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	129,690,496.38
卖出股票收入(成交)总额	13,850,228.91

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	20,002,000.00	7.52
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）	1,090,000.00	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,092,000.00	7.93

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019640	20 国债 10	200,000	20,002,000.00	7.52
2	113050	南银转债	10,900	1,090,000.00	0.41

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在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风

险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

南京银行股份有限公司于 2020 年 12 月 28 日收到人民银行南京分行的处罚（（南银）罚字（2020）第 30 号），因未按规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录等违法违规事项，被警告，并处罚款 736 万元，没收违法所得人民币 208778.02 元。

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

腾讯控股有限公司于 2021 年 3 月 12 日、2021 年 4 月 28 日分别收到国家市场监督管理总局处罚（国市监处（2021）13 号、国市监处（2021）30 号、国市监处（2021）31 号），因构成未依法申报违法实施的经营者集中被处以罚款总计 150 万元。

对“南京银行”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经营情况，我们认为，该处罚事项未对南京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。

对“江苏银行”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经营情况，我们认为，该处罚事项未对江苏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。

对“腾讯控股”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经营情况，我们认为，该处罚事项未对腾讯控股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	16,589.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	414,725.62
5	应收申购款	44,393.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	475,708.16

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,497	74,525.66	69,169.96	0.03%	260,547,066.78	99.97%

## 8.2 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	204,084.49	0.08%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
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。

## 8.4 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

基金合同生效日（2021年03月30日）基金份额总额	272,314,172.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	43,651.34
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	11,741,587.14
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	260,616,236.74

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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。

### 10.3 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.3.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	8,006,617.50	5.58%	4,003.29	3.34%	-
东吴证券	2	20,146,679.00	14.04%	18,762.47	15.67%	-
方正证券	1	43,333,577.02	30.21%	39,490.25	32.99%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	15,810,965.69	11.02%	11,246.25	9.39%	-
民生证券	1	17,445,155.96	12.16%	16,247.42	13.57%	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	12,121,444.00	8.45%	11,287.90	9.43%	-
中泰证券	1	25,428,519.96	17.73%	18,087.34	15.11%	-
中信建投	1	1,164,109.71	0.81%	582.05	0.49%	-

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。

### 10.3.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	498,600,000.00	24.21%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	1,090,000.00	2.26%	769,200,000.00	37.35%	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	47,055,380.77	97.74%	682,900,000.00	33.16%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	108,900,000.00	5.29%	-	-	-	-
------	---	---	----------------	-------	---	---	---	---

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。

#### 10.4 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	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金基金合同	《证券时报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年03月02日
2	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金托管协议	同上	2021年03月02日
3	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金招募说明书	同上	2021年03月02日
4	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金产品资料概要	同上	2021年03月02日
5	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金份额发售公告	同上	2021年03月02日
6	中信保诚基金管理有限公司关于中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金延长募集期的公告	同上	2021年03月24日
7	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2021年03月31日
8	中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	同上	2021年06月28日

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 1、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照

- 3、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

中信保诚基金管理有限公司  
2021 年 08 月 27 日