

中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）
2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	8
2.5	其他相关资料	8
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
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遵规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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	47
7.1	期末基金资产组合情况	47
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12	投资组合报告附注	61

§ 8	基金份额持有人信息	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2	期末上市基金前十名持有人	63
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 9	开放式基金份额变动	63
§ 10	重大事件揭示	64
10.1	基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4	基金投资策略的改变	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8	其他重大事件	68
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12	备查文件目录	71
12.1	备查文件目录	71
12.2	存放地点	71
12.3	查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）
基金简称	中信保诚沪深 300
场内简称	信诚 300
基金主代码	165515
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	213,234,261.38 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 02 月 03 日

注：自 2021 年 8 月 23 日起，本基金场内简称扩位为“信诚 300LOF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过对沪深 300 指数的跟踪复制，为投资人提供一个投资沪深 300 指数的有效工具。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法跟踪指数，即按照沪深 300 指数中成份股（含存托凭证）组成及在权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当发生特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等），或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：</p> <p>(1) 基本面替代：按照与被替代股票所属行业，</p>

	<p>基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；</p> <p>(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。本基金采用完全复制法跟踪指数，即按照沪深 300 指数中成份股（含存托凭证）组成及在权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当发生特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等），或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：</p>
--	---

	<p>(1) 基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；</p> <p>(2) 相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{沪深 } 300 \text{ 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	021-60637111
传真	021-50120888	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	张翔燕	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	51,204,940.01
本期利润	15,195,852.65
加权平均基金份额本期利润	0.0974
本期加权平均净值利润率	7.81%
本期基金份额净值增长率	4.85%
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	115,475,650.71
期末可供分配基金份额利润	0.5415
期末基金资产净值	272,092,321.20
期末基金份额净值	1.276
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	4.85%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.55%	0.75%	-1.91%	0.76%	1.36%	-0.01%
过去三个月	6.69%	0.90%	3.32%	0.93%	3.37%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.85%	1.24%	0.29%	1.25%	4.56%	-0.01%

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



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金

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

2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 76 只，分别为：信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金（LOF）、信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）、信诚全球商品主题证券投资基金（LOF）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证

券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及

《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》、《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年行业风格变化比较快。以春节作为断点,节前龙头效应较为明显。节后成长性板块估值大幅回调。二季度后以新能源、化工、有色为代表的能源周期性板块涨幅较大。以房地产、金融、家电等传统大行业为主的板块均在一定程度的跌幅。我们在前期较为关注的市场抱团行情略有松动。从目前的市场情况来看,前期抱团炒高的板块很大程度上并不能保持持续的涨幅。而市场信心集中的板块中,上涨也在逐步转到二三线公司。

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

费回暖但修复缓慢。央行主管媒体维持流动性预期稳定。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 4.85%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

我们坚持以“价值”作为投资，看好未来在各行业聚集效用，做价值股的长期投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

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

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策

略或投资新品种时, 应评价现有估值政策和程序的适用性, 并在不适用的情况下, 及时召开估值决策委员会。

在每个估值日, 本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法, 确定证券投资基金的份额净值。

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

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗, 所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

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

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离, 基金经理不直接参与或决定估值。

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

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金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：中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日
资产：		
银行存款	6. 4. 7. 1	12,537,384.46
结算备付金	—	659,960.91
存出保证金	—	64,037.07
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	257,516,395.22
其中：股票投资	—	257,347,252.46
基金投资	—	—
债券投资	—	169,142.76
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	4,042.32
应收股利	—	—
应收申购款	—	43,078,690.87

递延所得税资产	—	—
其他资产	6. 4. 7. 6	27, 483. 71
资产总计	—	313, 887, 994. 56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	40, 976, 591. 96
应付赎回款	—	169, 356. 35
应付管理人报酬	—	177, 881. 19
应付托管费	—	39, 133. 85
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	6. 4. 7. 7	177, 979. 56
应交税费	—	18. 08
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	6. 4. 7. 8	254, 712. 37
负债合计	—	41, 795, 673. 36
所有者权益：		
实收基金	6. 4. 7. 9	118, 223, 850. 67
未分配利润	6. 4. 7. 10	153, 868, 470. 53
所有者权益合计	—	272, 092, 321. 20
负债和所有者权益总计	—	313, 887, 994. 56

注：1、截止本报告期末，基金份额净值 1.276 元，基金份额总额 213,234,261.38 份。

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

6.2 利润表

会计主体：中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
一、收入	—	17, 158, 561. 34
1. 利息收入	—	34, 801. 99
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	28, 458. 38
债券利息收入	—	238. 54

资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	6,105.07
其他利息收入	—	—
2. 投资收益 (损失以“-”填列)	—	52,865,624.95
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	51,164,301.40
基金投资收益	—	—
债券投资收益	6.4.7.13	406,541.36
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	1,294,782.19
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-36,009,087.36
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	267,221.76
减: 二、费用	—	1,962,708.69
1. 管理人报酬	—	970,866.48
2. 托管费	—	213,590.59
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	543,710.06
5. 利息支出	—	—
其中: 卖出回购金融资产支出	—	—
6. 税金及附加	—	22.47
7. 其他费用	6.4.7.19	234,519.09
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	—	15,195,852.65
减: 所得税费用	—	—
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	—	15,195,852.65

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)

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

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	136,492,624.90	163,255,337.25	299,747,962.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	15,195,852.65	15,195,852.65
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)	-18,268,774.23	-24,582,719.37	-42,851,493.60
其中: 1. 基金申购款	71,040,920.13	90,011,404.07	161,052,324.20
2. 基金赎回款	-89,309,694.36	—	-203,903,817.80

		114,594,123.44	
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)	118,223,850.67	153,868,470.53	272,092,321.20

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 陈逸辛 刘卓
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) (原“信诚沪深 300 指数分级证券投资基金”) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 《关于核准信诚沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可 [2011] 1472 号文) 和《关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函 [2012] 42 号文) 批准, 由中信保诚基金管理有限公司 (原“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》等相关法规和《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2012 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集资金总额人民币 390,308,688.61 元。上述募集资金已由会计师事务所验证, 并出具了验资报告。根据《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》和《关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金名称变更的公告》, 本基金于 2020 年 12 月 31 日终止分级运作, 《信诚沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》失效。基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日, 对在该日登记在册的信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额办理向场内信诚沪深 300 份额折算。于 2021 年 1 月 1 日, 《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效, 基金名称由“信诚沪深 300 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)”, 取消分级机制, 基金规模为 246,216,047.76 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》及其配套规则、《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括沪深 300 指数的成份股 (含存托凭证)、备选成份股 (含存托凭证)、新股 (含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、权证、股指

期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率 +5%×金融同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 01 月 01 日(基金合同生效日)至 2021 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日(基金合同生效日)至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

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

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出

售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资和债券投资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。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。

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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下列原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当

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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基

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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

转融通利息收入是按本基金通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券的期限和相应转融通费率计算确认。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和指数使用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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在证券登记结算系统的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在注册登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红。每一基金份额享有同等分配权。

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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、
财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政
策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得
税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股
权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印
花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做
好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企
业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营
业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关
政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]
140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文
《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关
问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试
点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税
改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的
增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值
税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不
再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- (g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	12,537,384.46
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	12,537,384.46

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	231,145,394.24	257,347,252.46	26,201,858.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	165,300.00	169,142.76
	银行间市场	-	-
	合计	165,300.00	169,142.76
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	231,310,694.24	257,516,395.22	26,205,700.98

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	1,228.95
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	207.02
应收债券利息	12.69
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	2,567.74
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	25.92
合计	4,042.32

注：其他包括应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

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

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	177,979.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	177,979.56

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	574.02
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,630.98
应付信息披露费	159,507.37
应付指数使用费	50,000.00
合计	254,712.37

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	246,216,047.76	136,492,624.90
本期申购	128,136,080.89	71,040,920.13
本期赎回（以“-”号填列）	-161,117,867.27	-89,309,694.36
本期末	213,234,261.38	118,223,850.67

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

2、本基金本报告期末场内外基金份额如下：

[IMG=0745_1]

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	57,513,293.74	105,742,043.51	163,255,337.25
本期利润	51,204,940.01	-36,009,087.36	15,195,852.65
本期基金份额交易产生的变动数	6,757,416.96	-31,340,136.33	-24,582,719.37
其中：基金申购款	64,733,394.24	25,278,009.83	90,011,404.07
基金赎回款	-57,975,977.28	-56,618,146.16	-114,594,123.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,475,650.71	38,392,819.82	153,868,470.53

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	23,724.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,623.82
其他	3,109.74
合计	28,458.38

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	206,224,583.95
减：卖出股票成本总额	155,060,282.55
买卖股票差价收入	51,164,301.40

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	406, 541. 36
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	406, 541. 36

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	1, 382, 107. 96
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	975, 000. 00
减：应收利息总额	566. 60
买卖债券差价收入	406, 541. 36

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1, 294, 782. 19
其中：证券出借权益补偿收入	23, 599. 91
基金投资产生的股利收益	-
合计	1, 294, 782. 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	-36, 009, 087. 36
--股票投资	-35, 768, 179. 02
--债券投资	-240, 908. 34

--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	-36,009,087.36

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	266,863.95
转换费收入	357.81
合计	267,221.76

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25%归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	543,710.06
银行间市场交易费用	-
合计	543,710.06

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	2,814.45
基金上市费	27,516.29
其他	50.00

合计	234,519.09
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	970,866.48
其中：支付销售机构的客户维护费	89,025.44

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	213,590.59

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

的情况

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方 名称	本期	
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	12,537,384.46	23,724.82

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
300614	百川畅银	2021年05月18日	2021年11月25日	锁定期股票	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	锁定期股票	24.60	163.00	399	9,815.40	65,037.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	锁定期股票	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年07月07日	锁定期股票	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年01月12日	2021年07月21日	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年01月13日	2021年07月21日	锁定期股票	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300932	三友联众	2021年01月15日	2021年07月22日	锁定期股票	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年01月15日	2021年07月22日	锁定期股票	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年01月20日	2021年07月27日	锁定期股票	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

30095 2	恒辉 安防	2021 年 03 月 03 日	2021 年 09 月 13 日	锁定期 股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
30095 3	震裕 科技	2021 年 03 月 11 日	2021 年 09 月 22 日	锁定期 股票	28.77	99.85	212	6,099.24	21,168.20	-
30095 5	嘉亨 家化	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 24 日	锁定期 股票	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
30095 6	英力 股份	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 27 日	锁定期 股票	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
30095 7	贝泰 妮	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 27 日	锁定期 股票	47.33	251.96	132	6,247.56	33,258.72	-
30095 8	建工 修复	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 29 日	锁定期 股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
30096 1	深水 海纳	2021 年 03 月 23 日	2021 年 09 月 30 日	锁定期 股票	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
30096 2	中金 辐照	2021 年 03 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期 股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
30096 3	中洲 特材	2021 年 03 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期 股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
30096 6	共同 药业	2021 年 03 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期 股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
30096 7	晓鸣 股份	2021 年 04 月 02 日	2021 年 10 月 13	锁定期 股票	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

			日								
30096 8	格林 精密	2021 年 04 月 06 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	6.87	12.07	747	5,131.89	9,016.29	-	-
30097 1	博亚 精工	2021 年 04 月 07 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-	-
30097 2	万辰 生物	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 19 日	锁定期 股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	-
30097 3	立高 食品	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	28.28	115.71	156	4,411.68	18,050.76	-	-
30097 5	商络 电子	2021 年 04 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	锁定期 股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	-
30097 8	东箭 科技	2021 年 04 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	-
30097 9	华利 集团	2021 年 04 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	33.22	87.50	222	7,374.84	19,425.00	-	-
30098 2	苏文 电能	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	-
30098 6	志特 新材	2021 年 04 月 21 日	2021 年 11 月 01 日	锁定期 股票	14.79	30.57	211	3,120.69	6,450.27	-	-
30098 7	川网 传媒	2021 年 04 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	锁定期 股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	-
30099 1	创益 通	2021 年 05 月 12	2021 年 11	锁定期 股票	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-	-

		日	月 22 日							
300992	泰福泵业	2021 年 05 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	锁定期股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021 年 05 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	锁定期股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
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	-
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	-
30102	英诺	2021 年	2021	新发未	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

1	激光	06 月 28 日	年 07 月 06 日	上市						
30102 1	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	-
60516 2	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	-
60528 7	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	-
68807 6	诺泰生物	2021 年 05 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	锁定期股票	15.57	48.55	3,053	47,535.21	148,223.15	-
68808 7	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	2,320	50,947.20	50,947.20	-
68809 2	爱科科技	2021 年 03 月 12 日	2021 年 09 月 22 日	锁定期股票	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
68820 1	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	1,794	48,043.32	81,465.54	-
68822 6	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	-
68823 9	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	-
68849 9	利元亨	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 01 日	新发未上市	38.85	38.85	1,786	69,386.10	69,386.10	-

68860 1	力芯 微	2021 年 06 月 18 日	2021 年 12 月 28 日	锁定期 股票	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.0 6	
68863 3	星球 石墨	2021 年 03 月 17 日	2021 年 09 月 24 日	锁定期 股票	33.62	53.14	1,246	41,890.52	66,212.44	
68868 0	海优 新材	2021 年 01 月 15 日	2021 年 07 月 22 日	锁定期 股票	69.94	243.61	1,702	119,037.8 8	414,624.2 2	
68868 2	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	
68868 5	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	
68870 0	东威 科技	2021 年 06 月 07 日	2021 年 12 月 15 日	锁定期 股票	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.5 4	

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
11304 9	长汽 转债	2021 年 06 月 10 日	2021 年 07 月 08 日	新发未 上市	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.00	
11305 0	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	1,290	129,000.0 0	129,000.0 0	
12311 7	健帆 转债	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 12 日	新发未 上市	100.00	100.00	48	4,800.00	4,800.00	
12703	国微	2021 年	2021	新发未	100.00	100.00	111	11,100.00	11,100.00	

8	转债	06 月 10 日	年 07 月 14 日	上市						
---	----	-----------	-------------	----	--	--	--	--	--	--

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021 年 06 月 16 日	拟筹划重大事项	5.59	2021 年 07 月 06 日	6.15	39,844	411,335.85	222,727.96	-

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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与监督职责。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；识别公司各项业务所涉及的各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末
	2021 年 06 月 30 日
AAA	137,000.00
AAA 以下	32,142.76
未评级	-
合计	169,142.76

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约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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	12,537,384.4 6	-	-	-	-	-	12,537,384.46
结算备付金	659,960.91	-	-	-	-	-	659,960.91
存出保证金	64,037.07	-	-	-	-	-	64,037.07
交易性金融资 产				169,142.7 6	257,347,252.4 6	257,516,395.2 2	
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	-	-	-	-	-	4,042.32	4,042.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	43,078,690.87	43,078,690.87
递延所得税资 产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产		-	-	-	-	27,483.71	27,483.71
资产总计	13,261,382.44	-	-	169,142.76	300,457,469.36	313,887,994.56	
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	-	-	-	-	40,976,591.96	40,976,591.96	
应付赎回款	-	-	-	-	169,356.35	169,356.35	
应付管理人报酬	-	-	-	-	177,881.19	177,881.19	
应付托管费	-	-	-	-	39,133.85	39,133.85	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	177,979.56	177,979.56	
应交税费	-	-	-	-	18.08	18.08	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	254,712.37	254,712.37	
负债总计	-	-	-	-	41,795,673.36	41,795,673.36	
利率敏感度缺口	13,261,382.44	-	-	169,142.76	258,661,796.00	272,092,321.20	

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。

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

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票,因此存在相应的其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	257,347,252.46	94.58
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	257,347,252.46	94.58

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%	12,788,339.10
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-12,788,339.10

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

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

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

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

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

于本报告期末,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 255,257,248.63 元,属于第二层次的余额为 2,259,146.59 元,无属于第三层次的余额

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

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

(3) 除以上事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	257,347,252.46	81.99
	其中：股票	257,347,252.46	81.99
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	169,142.76	0.05
	其中：债券	169,142.76	0.05
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	13,197,345.37	4.20
8	其他各项资产	43,174,253.97	13.75
9	合计	313,887,994.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,701,962.20	0.99

B	采矿业	5, 396, 363. 57	1. 98
C	制造业	141, 870, 140. 61	52. 14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4, 487, 385. 73	1. 65
E	建筑业	3, 122, 216. 29	1. 15
F	批发和零售业	1, 672, 617. 36	0. 61
G	交通运输、仓储和邮政业	7, 367, 763. 90	2. 71
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8, 352, 455. 15	3. 07
J	金融业	59, 811, 761. 36	21. 98
K	房地产业	5, 168, 094. 62	1. 90
L	租赁和商务服务业	4, 694, 439. 20	1. 73
M	科学研究和技术服务业	3, 681, 349. 44	1. 35
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	465, 847. 00	0. 17
Q	卫生和社会工作	5, 469, 824. 86	2. 01
R	文化、体育和娱乐业	1, 048, 722. 60	0. 39
S	综合	—	—
	合计	255, 310, 943. 89	93. 83

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11, 290. 28	0. 00
B	采矿业	—	—
C	制造业	1, 629, 714. 87	0. 60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13, 020. 39	0. 00
E	建筑业	25, 371. 37	0. 01
F	批发和零售业	86, 628. 46	0. 03
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	200, 007. 85	0. 07
J	金融业	34, 721. 10	0. 01
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	35, 554. 25	0. 01
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	2,036,308.57	0.75

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,615	15,661,770.50	5.76
2	601318	中国平安	130,675	8,399,789.00	3.09
3	600036	招商银行	149,315	8,091,379.85	2.97
4	000858	五粮液	23,457	6,987,605.73	2.57
5	601012	隆基股份	52,209	4,638,247.56	1.70
6	000333	美的集团	59,468	4,244,231.16	1.56
7	600276	恒瑞医药	54,032	3,672,555.04	1.35
8	002415	海康威视	56,398	3,637,671.00	1.34
9	601166	兴业银行	175,427	3,605,024.85	1.32
10	601888	中国中免	11,756	3,527,975.60	1.30
11	603259	药明康德	21,616	3,384,849.44	1.24
12	300059	东方财富	99,743	3,270,572.97	1.20
13	000651	格力电器	58,050	3,024,405.00	1.11
14	600900	长江电力	137,213	2,832,076.32	1.04
15	002594	比亚迪	10,923	2,741,673.00	1.01
16	002475	立讯精密	58,973	2,712,758.00	1.00
17	600887	伊利股份	73,359	2,701,811.97	0.99
18	000001	平安银行	117,100	2,648,802.00	0.97
19	600030	中信证券	102,800	2,563,832.00	0.94
20	000725	京东方A	408,506	2,549,077.44	0.94
21	300015	爱尔眼科	32,597	2,313,735.06	0.85
22	601398	工商银行	422,869	2,186,232.73	0.80
23	000568	泸州老窖	8,833	2,084,058.02	0.77
24	600031	三一重工	71,621	2,082,022.47	0.77
25	600309	万华化学	18,898	2,056,480.36	0.76
26	603501	韦尔股份	6,300	2,028,600.00	0.75
27	603288	海天味业	15,287	1,971,258.65	0.72
28	000002	万科A	82,078	1,954,277.18	0.72
29	002714	牧原股份	31,700	1,927,994.00	0.71

30	600809	山西汾酒	4,200	1,881,600.00	0.69
31	300122	智飞生物	9,700	1,811,281.00	0.67
32	601919	中远海控	58,363	1,782,406.02	0.66
33	002142	宁波银行	43,517	1,695,857.49	0.62
34	601328	交通银行	331,500	1,624,350.00	0.60
35	601899	紫金矿业	166,700	1,615,323.00	0.59
36	600436	片仔癀	3,600	1,613,880.00	0.59
37	002304	洋河股份	7,285	1,509,452.00	0.55
38	002812	恩捷股份	6,400	1,498,240.00	0.55
39	002352	顺丰控股	22,000	1,489,400.00	0.55
40	002230	科大讯飞	21,495	1,452,632.10	0.53
41	300014	亿纬锂能	13,700	1,423,841.00	0.52
42	600000	浦发银行	141,633	1,416,330.00	0.52
43	300274	阳光电源	12,300	1,415,238.00	0.52
44	600438	通威股份	32,600	1,410,602.00	0.52
45	300124	汇川技术	18,632	1,383,612.32	0.51
46	600837	海通证券	116,447	1,339,140.50	0.49
47	000661	长春高新	3,400	1,315,800.00	0.48
48	000100	TCL 科技	169,310	1,295,221.50	0.48
49	601816	京沪高铁	237,000	1,253,730.00	0.46
50	000063	中兴通讯	37,191	1,235,856.93	0.45
51	002241	歌尔股份	28,880	1,234,331.20	0.45
52	300347	泰格医药	6,300	1,217,790.00	0.45
53	603986	兆易创新	6,392	1,201,056.80	0.44
54	601601	中国太保	41,297	1,196,374.09	0.44
55	600585	海螺水泥	28,977	1,189,505.85	0.44
56	600690	海尔智家	45,674	1,183,413.34	0.43
57	002271	东方雨虹	21,300	1,178,316.00	0.43
58	601668	中国建筑	253,054	1,176,701.10	0.43
59	002460	赣锋锂业	9,700	1,174,573.00	0.43
60	603799	华友钴业	10,242	1,169,636.40	0.43
61	002027	分众传媒	123,960	1,166,463.60	0.43
62	300142	沃森生物	18,900	1,166,130.00	0.43
63	600016	民生银行	256,716	1,132,117.56	0.42
64	600763	通策医疗	2,700	1,109,700.00	0.41
65	600196	复星医药	14,587	1,052,160.31	0.39
66	601288	农业银行	346,674	1,050,422.22	0.39
67	600048	保利地产	86,610	1,042,784.40	0.38
68	600703	三安光电	32,469	1,040,631.45	0.38
69	000338	潍柴动力	57,244	1,022,950.28	0.38
70	600919	江苏银行	142,530	1,011,963.00	0.37

71	002129	中环股份	25, 600	988, 160. 00	0. 36
72	601229	上海银行	119, 930	983, 426. 00	0. 36
73	601688	华泰证券	62, 133	981, 701. 40	0. 36
74	600050	中国联通	224, 473	969, 723. 36	0. 36
75	600660	福耀玻璃	16, 897	943, 697. 45	0. 35
76	600570	恒生电子	10, 051	937, 255. 75	0. 34
77	601211	国泰君安	54, 400	932, 416. 00	0. 34
78	600104	上汽集团	42, 246	928, 144. 62	0. 34
79	601766	中国中车	146, 707	891, 978. 56	0. 33
80	688111	金山办公	2, 224	878, 035. 20	0. 32
81	601169	北京银行	178, 533	869, 455. 71	0. 32
82	600999	招商证券	44, 765	851, 430. 30	0. 31
83	002371	北方华创	3, 000	832, 140. 00	0. 31
84	600019	宝钢股份	107, 415	820, 650. 60	0. 30
85	002311	海大集团	10, 000	816, 000. 00	0. 30
86	002049	紫光国微	5, 100	786, 369. 00	0. 29
87	002410	广联达	11, 500	784, 300. 00	0. 29
88	601988	中国银行	254, 271	783, 154. 68	0. 29
89	600406	国电南瑞	33, 494	778, 400. 56	0. 29
90	601088	中国神华	39, 797	776, 837. 44	0. 29
91	300498	温氏股份	53, 860	773, 968. 20	0. 28
92	601818	光大银行	199, 519	754, 181. 82	0. 28
93	300601	康泰生物	5, 004	745, 596. 00	0. 27
94	600745	闻泰科技	7, 500	726, 750. 00	0. 27
95	000625	长安汽车	27, 408	720, 282. 24	0. 26
96	000538	云南白药	6, 151	711, 793. 72	0. 26
97	600028	中国石化	161, 381	703, 621. 16	0. 26
98	600893	航发动力	12, 900	686, 151. 00	0. 25
99	601628	中国人寿	20, 083	680, 612. 87	0. 25
100	300450	先导智能	11, 300	679, 582. 00	0. 25
101	002821	凯莱英	1, 800	670, 680. 00	0. 25
102	600346	恒力石化	25, 468	668, 280. 32	0. 25
103	601658	邮储银行	131, 300	659, 126. 00	0. 24
104	600588	用友网络	19, 776	657, 749. 76	0. 24
105	601390	中国中铁	122, 807	643, 508. 68	0. 24
106	300595	欧普康视	6, 200	642, 010. 00	0. 24
107	601009	南京银行	60, 366	635, 050. 32	0. 23
108	002493	荣盛石化	36, 600	632, 082. 00	0. 23
109	601377	兴业证券	64, 617	624, 200. 22	0. 23
110	601857	中国石油	117, 240	620, 199. 60	0. 23
111	688036	传音控股	2, 894	606, 293. 00	0. 22

112	601633	长城汽车	13,900	605,901.00	0.22
113	300413	芒果超媒	8,640	592,704.00	0.22
114	688169	石头科技	460	580,060.00	0.21
115	600132	重庆啤酒	2,900	574,055.00	0.21
116	601225	陕西煤业	48,297	572,319.45	0.21
117	600584	长电科技	15,000	565,200.00	0.21
118	002601	龙佰集团	16,200	560,196.00	0.21
119	600009	上海机场	11,581	557,393.53	0.20
120	300408	三环集团	13,100	555,702.00	0.20
121	600426	华鲁恒升	17,900	554,005.00	0.20
122	600111	北方稀土	26,297	544,347.90	0.20
123	000776	广发证券	35,676	540,134.64	0.20
124	601100	恒立液压	6,268	538,546.56	0.20
125	002001	新和成	18,680	535,742.40	0.20
126	688012	中微公司	3,225	535,092.00	0.20
127	000895	双汇发展	16,714	531,505.20	0.20
128	600926	杭州银行	35,820	528,345.00	0.19
129	300433	蓝思科技	17,949	527,880.09	0.19
130	603882	金域医学	3,300	527,241.00	0.19
131	002179	中航光电	6,620	523,112.40	0.19
132	002050	三花智控	21,632	518,735.36	0.19
133	000166	申万宏源	108,784	509,109.12	0.19
134	600958	东方证券	50,367	503,166.33	0.18
135	600741	华域汽车	18,977	498,525.79	0.18
136	600600	青岛啤酒	4,300	497,295.00	0.18
137	002841	视源股份	4,000	497,160.00	0.18
138	300003	乐普医疗	15,242	489,573.04	0.18
139	002007	华兰生物	13,230	485,276.40	0.18
140	000963	华东医药	10,513	483,703.13	0.18
141	000786	北新建材	12,200	478,850.00	0.18
142	000157	中联重科	51,210	473,180.40	0.17
143	603806	福斯特	4,500	473,085.00	0.17
144	601006	大秦铁路	71,709	471,845.22	0.17
145	002607	中公教育	22,300	465,847.00	0.17
146	601336	新华保险	10,080	462,772.80	0.17
147	600029	南方航空	76,487	460,451.74	0.17
148	600015	XD 华夏银	74,265	459,700.35	0.17
149	002236	大华股份	21,648	456,772.80	0.17
150	601989	中国重工	110,032	453,331.84	0.17
151	600143	金发科技	21,700	452,662.00	0.17
152	601155	新城控股	10,870	452,192.00	0.17

153	601901	方正证券	48,292	452,013.12	0.17
154	600176	中国巨石	29,002	449,821.02	0.17
155	601138	工业富联	36,000	446,760.00	0.16
156	603993	洛阳钼业	85,200	439,632.00	0.16
157	000768	中航西飞	16,700	438,876.00	0.16
158	601877	正泰电器	13,000	433,940.00	0.16
159	600352	浙江龙盛	31,364	430,941.36	0.16
160	600760	中航沈飞	7,140	430,542.00	0.16
161	600010	包钢股份	275,000	426,250.00	0.16
162	300529	健帆生物	4,900	423,164.00	0.16
163	601788	光大证券	23,594	422,096.66	0.16
164	600547	山东黄金	21,780	418,611.60	0.15
165	001979	招商蛇口	38,200	418,290.00	0.15
166	601600	中国铝业	78,848	417,894.40	0.15
167	002008	大族激光	10,335	417,430.65	0.15
168	601186	中国铁建	55,525	412,550.75	0.15
169	603369	今世缘	7,600	411,616.00	0.15
170	002202	金风科技	33,268	404,538.88	0.15
171	601916	浙商银行	100,800	400,176.00	0.15
172	000876	新希望	27,182	398,759.94	0.15
173	002555	三七互娱	16,099	386,697.98	0.14
174	003816	中国广核	142,400	380,208.00	0.14
175	000938	紫光股份	17,289	378,283.32	0.14
176	002736	国信证券	34,825	374,368.75	0.14
177	603899	晨光文具	4,400	372,064.00	0.14
178	600109	国金证券	29,231	370,941.39	0.14
179	601066	中信建投	11,800	370,874.00	0.14
180	000069	华侨城 A	49,504	368,309.76	0.14
181	603160	汇顶科技	2,800	362,964.00	0.13
182	600989	宝丰能源	26,500	362,520.00	0.13
183	300136	信维通信	11,700	361,296.00	0.13
184	000425	徐工机械	56,717	361,287.29	0.13
185	601669	中国电建	92,300	357,201.00	0.13
186	600150	中国船舶	21,600	356,616.00	0.13
187	000977	浪潮信息	12,300	345,999.00	0.13
188	600795	国电电力	142,215	345,582.45	0.13
189	002384	东山精密	16,500	343,860.00	0.13
190	000783	长江证券	46,735	342,100.20	0.13
191	603659	璞泰来	2,500	341,500.00	0.13
192	601238	广汽集团	26,300	340,585.00	0.13
193	688008	澜起科技	5,457	340,407.66	0.13

194	601799	星宇股份	1, 500	338, 580. 00	0. 12
195	600085	同仁堂	8, 276	338, 074. 60	0. 12
196	603019	中科曙光	12, 240	337, 946. 40	0. 12
197	002624	完美世界	14, 050	335, 935. 50	0. 12
198	000596	古井贡酒	1, 400	335, 300. 00	0. 12
199	600079	人福医药	11, 800	333, 586. 00	0. 12
200	601838	成都银行	26, 100	329, 904. 00	0. 12
201	300558	贝达药业	3, 000	324, 720. 00	0. 12
202	300677	英科医疗	2, 600	324, 480. 00	0. 12
203	600183	生益科技	13, 800	323, 058. 00	0. 12
204	600886	国投电力	33, 588	322, 780. 68	0. 12
205	601985	中国核电	63, 138	319, 478. 28	0. 12
206	300144	宋城演艺	18, 967	318, 645. 60	0. 12
207	000703	恒逸石化	26, 650	318, 467. 50	0. 12
208	601108	财通证券	30, 300	317, 847. 00	0. 12
209	601360	三六零	25, 900	316, 239. 00	0. 12
210	002600	领益智造	34, 100	313, 379. 00	0. 12
211	002414	高德红外	11, 340	312, 757. 20	0. 11
212	601555	东吴证券	37, 480	312, 583. 20	0. 11
213	000066	中国长城	21, 200	309, 520. 00	0. 11
214	002252	上海莱士	40, 700	304, 843. 00	0. 11
215	603833	欧派家居	2, 140	303, 794. 40	0. 11
216	002938	鹏鼎控股	8, 400	301, 392. 00	0. 11
217	002044	美年健康	33, 080	301, 358. 80	0. 11
218	601077	渝农商行	74, 700	298, 053. 00	0. 11
219	300676	华大基因	2, 500	296, 500. 00	0. 11
220	600522	中天科技	29, 600	296, 000. 00	0. 11
221	601607	上海医药	13, 925	294, 235. 25	0. 11
222	300033	同花顺	2, 600	293, 228. 00	0. 11
223	688396	华润微	3, 185	289, 898. 70	0. 11
224	002602	世纪华通	44, 964	288, 668. 88	0. 11
225	600332	白云山	8, 526	288, 605. 10	0. 11
226	600161	天坛生物	8, 300	284, 275. 00	0. 10
227	600872	中炬高新	6, 700	281, 534. 00	0. 10
228	601111	中国国航	36, 058	280, 531. 24	0. 10
229	600362	江西铜业	12, 505	279, 861. 90	0. 10
230	600383	金地集团	27, 184	278, 364. 16	0. 10
231	300628	亿联网络	3, 300	276, 540. 00	0. 10
232	601800	中国交建	42, 505	275, 432. 40	0. 10
233	600115	中国东航	54, 083	274, 741. 64	0. 10
234	002508	老板电器	5, 755	267, 607. 50	0. 10

235	000860	顺鑫农业	6,300	265,734.00	0.10
236	600061	国投资本	31,011	263,283.39	0.10
237	603517	绝味食品	3,100	261,299.00	0.10
238	002916	深南电路	2,320	257,821.60	0.09
239	601618	中国中冶	86,182	256,822.36	0.09
240	000728	国元证券	30,863	245,978.11	0.09
241	600845	宝信软件	4,540	231,086.00	0.08
242	002024	苏宁易购	39,844	222,727.96	0.08
243	601727	上海电气	51,704	219,224.96	0.08
244	601162	天风证券	43,800	212,868.00	0.08
245	601696	中银证券	10,100	207,959.00	0.08
246	601021	春秋航空	3,600	204,840.00	0.08
247	600705	中航产融	52,456	203,004.72	0.07
248	603939	益丰药房	3,600	201,924.00	0.07
249	601878	浙商证券	15,200	198,816.00	0.07
250	688363	华熙生物	705	195,891.30	0.07
251	601990	南京证券	18,600	195,672.00	0.07
252	600606	绿地控股	35,800	195,110.00	0.07
253	002456	欧菲光	21,177	188,051.76	0.07
254	002157	正邦科技	15,400	184,030.00	0.07
255	002463	沪电股份	11,800	182,546.00	0.07
256	600011	华能国际	43,100	181,882.00	0.07
257	000656	金科股份	31,400	181,806.00	0.07
258	600521	华海药业	8,600	179,568.00	0.07
259	601933	永辉超市	37,274	176,306.02	0.06
260	600655	豫园股份	15,200	176,168.00	0.06
261	600848	上海临港	9,680	173,272.00	0.06
262	603392	万泰生物	660	171,058.80	0.06
263	600118	中国卫星	5,800	169,708.00	0.06
264	601216	君正集团	33,038	168,163.42	0.06
265	600489	中金黄金	18,986	163,659.32	0.06
266	600018	上港集团	34,068	162,504.36	0.06
267	603195	公牛集团	800	161,600.00	0.06
268	601995	中金公司	2,600	159,900.00	0.06
269	002558	巨人网络	11,800	156,940.00	0.06
270	002120	韵达股份	11,415	154,444.95	0.06
271	601872	招商轮船	32,760	151,351.20	0.06
272	002673	西部证券	17,500	144,375.00	0.05
273	688009	中国通号	25,350	144,241.50	0.05
274	688126	沪硅产业	4,861	141,843.98	0.05
275	603338	浙江鼎力	2,400	140,856.00	0.05

276	002739	万达电影	8,700	137,373.00	0.05
277	601881	中国银河	12,600	135,828.00	0.05
278	601319	中国人保	22,800	135,204.00	0.05
279	603658	安图生物	1,700	128,809.00	0.05
280	600233	圆通速递	12,400	124,124.00	0.05
281	603233	大参林	2,300	117,553.00	0.04
282	600482	中国动力	6,600	114,972.00	0.04
283	601998	中信银行	22,500	114,750.00	0.04
284	601231	环旭电子	6,700	112,627.00	0.04
285	002032	苏泊尔	1,700	108,443.00	0.04
286	002153	石基信息	4,506	105,936.06	0.04
287	600025	华能水电	18,200	105,378.00	0.04
288	002939	长城证券	9,400	104,622.00	0.04
289	600340	华夏幸福	19,788	103,689.12	0.04
290	601236	红塔证券	7,400	100,344.00	0.04
291	000800	一汽解放	9,100	98,462.00	0.04
292	002773	康弘药业	3,750	86,737.50	0.03
293	601808	中海油服	6,000	86,160.00	0.03
294	600918	中泰证券	7,800	84,396.00	0.03
295	601698	中国卫通	4,500	72,855.00	0.03
296	603087	甘李药业	500	53,290.00	0.02
297	600299	安迪苏	4,100	49,036.00	0.02
298	002945	华林证券	2,200	30,404.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688680	海优新材	1,702	414,624.22	0.15
2	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.06
3	688076	诺泰生物	3,053	148,223.15	0.05
4	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.04
5	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.04
6	688201	信安世纪	1,794	81,465.54	0.03
7	688499	利元亨	1,786	69,386.10	0.03
8	688633	星球石墨	1,246	66,212.44	0.02
9	300919	中伟股份	399	65,037.00	0.02
10	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
11	688087	英科再生	2,320	50,947.20	0.02
12	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.02
13	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02

14	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
15	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
16	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
17	300957	贝泰妮	132	33,258.72	0.01
18	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
19	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
20	300953	震裕科技	212	21,168.20	0.01
21	300979	华利集团	222	19,425.00	0.01
22	300973	立高食品	156	18,050.76	0.01
23	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
24	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
25	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
26	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
27	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
28	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
29	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
30	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
31	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
32	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
33	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
34	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
35	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
36	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
37	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
38	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
39	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
40	300968	格林精密	747	9,016.29	0.00
41	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
42	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
43	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
44	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
45	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
46	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
47	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
48	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
49	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
50	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
51	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
52	300986	志特新材	211	6,450.27	0.00
53	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
54	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00

55	300967	晓鸣股份	507	5, 850. 78	0. 00
56	300972	万辰生物	430	5, 439. 50	0. 00
57	300929	华骐环保	183	5, 407. 65	0. 00
58	605011	杭州热电	525	4, 662. 00	0. 00
59	300995	奇德新材	191	4, 454. 12	0. 00
60	300992	泰福泵业	200	4, 064. 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	600519	贵州茅台	10, 285, 531. 00	3. 78
2	601318	中国平安	5, 254, 549. 00	1. 93
3	600036	招商银行	4, 786, 963. 00	1. 76
4	000858	五 粮 液	4, 151, 814. 68	1. 53
5	601398	工商银行	3, 945, 965. 00	1. 45
6	000333	美的集团	2, 651, 634. 00	0. 97
7	601288	农业银行	2, 576, 529. 00	0. 95
8	601012	隆基股份	2, 222, 480. 19	0. 82
9	600276	恒瑞医药	2, 176, 181. 40	0. 80
10	601166	兴业银行	2, 149, 271. 98	0. 79
11	601888	中国中免	2, 140, 266. 00	0. 79
12	002415	海康威视	2, 109, 042. 00	0. 78
13	000651	格力电器	1, 858, 238. 00	0. 68
14	603259	药明康德	1, 815, 630. 00	0. 67
15	300059	东方财富	1, 787, 607. 40	0. 66
16	600900	长江电力	1, 670, 647. 00	0. 61
17	600887	伊利股份	1, 639, 059. 00	0. 60
18	000001	平安银行	1, 598, 907. 00	0. 59
19	000725	京东方A	1, 556, 901. 00	0. 57
20	601857	中国石油	1, 504, 744. 00	0. 55

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交量)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	600519	贵州茅台	9, 517, 835. 00	3. 50
2	601318	中国平安	8, 241, 193. 00	3. 03
3	600036	招商银行	5, 945, 108. 00	2. 18
4	000858	五 粮 液	5, 578, 152. 80	2. 05

5	601398	工商银行	4,346,962.00	1.60
6	000333	美的集团	4,346,049.28	1.60
7	600276	恒瑞医药	3,624,518.60	1.33
8	601166	兴业银行	2,921,789.00	1.07
9	601888	中国中免	2,867,190.00	1.05
10	000651	格力电器	2,788,313.00	1.02
11	601288	农业银行	2,776,684.00	1.02
12	600887	伊利股份	2,579,730.94	0.95
13	601012	隆基股份	2,338,236.00	0.86
14	300059	东方财富	2,301,814.60	0.85
15	600031	三一重工	2,057,429.00	0.76
16	000001	平安银行	2,008,777.00	0.74
17	600030	中信证券	1,974,468.00	0.73
18	002415	海康威视	1,940,057.00	0.71
19	002594	比亚迪	1,896,590.00	0.70
20	002475	立讯精密	1,852,957.00	0.68

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交量)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	160,124,214.05
卖出股票收入（成交）总额	206,224,583.95

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	169,142.76	0.06
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	169,142.76	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	1,290	129,000.00	0.05
2	127036	三花转债	124	16,242.76	0.01
3	127038	国微转债	111	11,100.00	0.00
4	113049	长汽转债	80	8,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	48	4,800.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

兴业银行股份有限公司于 2020 年 8 月 31 日、2020 年 9 月 4 日分别受到中国银保监会福建监管局、中国人民银行福州中心支行处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24 号、福银罚字〔2020〕35 号），兴业银行因向同业投资用途不合规等违法违规行为被没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元；因向无证机构提供转接清算服务等违法违规行为被给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

招商银行股份有限公司于 2020 年 9 月 29 日、2020 年 11 月 27 日、2021 年 5 月 17 日分别收到国家外汇管理局深圳市分局和中国银行保险监督管理委员会的 3 份处罚（深外管检〔2020〕76 号、深外管检〔2020〕92 号、银保监罚决字〔2021〕16 号），因违反外汇市场交易管理被责令改正、处以罚款人民币 120 万元，对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分；因违反规定办理结汇、售汇被责令改正、处以罚款人民币 55 万元，没收违法所得 129 万元人民币；因理财产品之间风险隔离不到位、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品等违法违规事实被罚款 7170 万元。

江苏恒瑞医药股份有限公司于 2021 年 4 月 12 日受到中华人民共和国财政部处罚，因 2018 年以非本公司发生的机票等报销专家讲课费、点评费、主持费等多项问题被处 5 万元罚款。

对“招商银行”、“恒瑞医药”和“兴业银行”的投资决策程序的说明：招商银行、恒瑞医药和兴业银行均为沪深 300 指数的成分股。这些公司分别于 2020 年下半年和 2021 年上半年发生的违规事件受到监管部门处罚。基金经理对事件的影响做了分析后认为，这些类型的处罚事件不会对公司的企业经营和投资价值产生太大的影响；另外，根据量化模型，基金经理也控制了其在投资组合中的占比，防止意外风险发生。因此我们认为投资策略没有决策性问题。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,037.07
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	4,042.32
5	应收申购款	43,078,690.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	27,483.71
8	其他	—
9	合计	43,174,253.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688680	海优新材	414,624.22	0.15	锁定期股票
2	688601	力芯微	156,952.06	0.06	锁定期股票
3	688076	诺泰生物	148,223.15	0.05	锁定期股票
4	688700	东威科技	117,264.54	0.04	锁定期股票
5	688682	霍莱沃	98,242.10	0.04	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

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
7,458	28,591.35	144,051,434.12	67.56%	69,182,827.26	32.44%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	薛宏飞	4,080,439.00	7.85%
2	徐亚英	1,703,461.00	3.28%
3	金兆玮	1,492,956.00	2.87%
4	深圳快快宝利资产管理有限公司	1,216,248.00	2.34%
5	王晓刚	916,500.00	1.76%
6	黄江东	716,182.00	1.38%
7	罗章琴	592,046.00	1.14%
8	陈锋	588,485.00	1.13%
9	刘树波	547,862.00	1.05%
10	刘雯	520,809.00	1.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	559.89	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 01 月 01 日）基金份额总额	246,216,047.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	128,136,080.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	161,117,867.27
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	213,234,261.38

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

安信证券	3	—	—	—	—	—
渤海证券	1	—	—	—	—	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—
大通证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	169,415,994.84	46.94%	120,504.43	41.61%	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	2	7,890,781.34	2.19%	7,348.78	2.54%	—
东兴证券	1	79,900,008.85	22.14%	72,813.25	25.14%	—
方正证券	1	44,319,605.06	12.28%	40,388.42	13.95%	—
高盛高华	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	30,530,402.88	8.46%	22,326.79	7.71%	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
红塔证券	1	—	—	—	—	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	3	—	—	—	—	—
华金证券	1	—	—	—	—	—
华融证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	3	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
金通证券	1	—	—	—	—	—
开源证券	1	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—

山西证券	1	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-
申万宏源	5	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-
西南证券	2	19,768,013.86	5.48%	18,410.09	6.36%
信达证券	2	-	-	-	-
兴业证券	2	6,840,173.63	1.90%	6,233.55	2.15%
野村东方国际证券有限公司	1	2,218,853.38	0.61%	1,578.30	0.54%
银河证券	2	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易	基金

	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	137,000.00	7.18%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	132,000.00	6.92%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	188,241.76	9.87%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	184,300.00	9.66%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	1,265,866.20	66.37%	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金	《证券日报》及/或基	2021年01月01日

	(LOF) 招募说明书	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
2	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要	同上	2021年01月01日
3	关于信诚沪深 300 指数分级证券投资基金之信诚沪深 300A 份额和信诚沪深 300B 份额基金份额折算结果的公告	同上	2021年01月05日
4	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年第四季度报告	同上	2021年01月22日
5	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	同上	2021年01月22日
6	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）上市交易公告书	同上	2021年01月29日
7	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	同上	2021年02月03日
8	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	同上	2021年02月03日
9	信诚沪深 300 指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021年03月26日
10	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
11	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）托管协议	同上	2021年03月31日
12	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金合同	同上	2021年03月31日
13	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改法律文件的公告	同上	2021年03月31日
14	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	同上	2021年04月02日
15	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）更新招募说明书	同上	2021年04月02日
16	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）2021 年第一季度报告	同上	2021年04月21日
17	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
18	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	同上	2021年05月14日
19	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金赎回费率优惠	同上	2021年05月14日

	活动的公告		
--	-------	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-01-01 至 2021-05-18	60,634,737.02	-	38,200,000.00	22,434,737.02	10.52%
个人							
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 3 月 31 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据<公开募集证券投资基金管理指引第 3 号—指数基金指引>修改法律文件的公告》，本基金就投资范围增加存托凭证、增加侧袋机制、标的指数事项修订事项调整了基金合同、托管协议、招募说明书（更新）及基金产品资料概要。

本基金管理人于 2021 年 8 月 25 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2021 年 8 月 26 日起增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并对基金合同和托管协议的相关条款进行修订。招募说明书及基金产品资料概要相应更新。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、（原）信诚沪深 300 指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）基金合同
- 4、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2021 年 08 月 27 日