

中信保诚中证 800 有色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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益 (基金净值) 变动表	16
6.4	报表附注	16
§ 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	48
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	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9	开放式基金份额变动	56
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)
基金简称	中信保诚中证 800 有色
场内简称	信诚有色
基金主代码	165520
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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,174,119,706.77 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 2 月 3 日

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 800 有色金属指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	<p>本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股(含存托凭证)组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。当发生特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等),或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:</p> <p>(1) 基本面替代:按照与被替代股票基本面及规模</p>

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信保诚基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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	95566
传真	021-50120888	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪	北京市西城区复兴门内大街

	大道 8 号上海国金中心汇丰银行 大楼 9 层	1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	张翔燕	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中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	99,697,711.19
本期利润	71,807,654.29
加权平均基金份额本期利润	0.0738
本期加权平均净值利润率	5.00%
本期基金份额净值增长率	16.35%
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	-270,972,108.84
期末可供分配基金份额利润	-0.2308
期末基金资产净值	1,772,070,339.39
期末基金份额净值	1.509
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	16.35%

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	-5.63%	1.67%	-6.11%	1.69%	0.48%	-0.02%
过去三个月	11.61%	1.89%	10.78%	1.93%	0.83%	-0.04%
自基金合同生效起至今	16.35%	2.48%	13.55%	2.55%	2.80%	-0.07%

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



§ 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		
黄稚	本基金的基金经理	2019 年 09 月 04 日	-	9	黄稚女士，理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司，担任资产管理部产品经理；于平安证券有限责任公司，担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚中证建设工程指数型证券投资基金 (LOF)、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 TMT 产业主题指数型证券投资基金 (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) 的基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《中信保诚中证 800 有色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

回顾今年上半年,全球经济延续复苏趋势,大宗商品价格持续走高,主要经济体通胀数据攀升,但中美两国货币政策均未释放明显的收紧信号。我国宏观经济稳定复苏,上半年 GDP 同比增长 12.7%,通胀水平明显回升。

报告期内,A股市场总体呈现区间震荡格局,小盘股表现优于大盘股,成长风格相对占优。上证指数上涨 3.40%,沪深 300 上涨 0.24%,中证 500 上涨 6.93%,创业板指上涨 17.22%,其中电气设备、钢铁、化工、采掘、有色金属等行业涨幅居前,而家用电器、非银金融、国防军工、房地产、农林牧渔等行业表现较差。

本基金跟踪的标的指数为中证 800 有色金属指数。报告期内,本基金坚持既定的指数化投资策略,原则上按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合,实现对标的指数的有效跟踪。

本基金认真应对投资者日常申购、赎回, 根据市场情况、成分股停牌等合理安排权益仓位和头寸, 有效管理跟踪误差。本基金积极参与网下新股申购, 以提高基金收益。

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 16.35%, 同期业绩比较基准收益率为 13.55%。

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, 全球经济复苏态势预计将延续, 疫情防控形势将持续影响全球经济复苏情况。通胀与货币政策取向仍然是影响下半年宏观流动性的最主要因素, 美联储流动性的边际收紧渐行渐近, 各类资产价格的波动可能进一步加剧。国内经济有望率先重归疫情前的增长轨道, 复苏温和放缓, 主要动能由外需逐步切换为内需, 行业景气度走势的分化将会更加明显。

展望后市, 权益市场短期波动可能加大, A 股缺乏整体趋势性估值提升的推动力, 震荡局面或将持续, 我们对于部分高估值权益资产走势相对比较谨慎, 成长风格及高景气产业链仍存在结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

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

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时, 应评价现有估值政策和程序的适用性, 并在不适用的情况下, 及时召开估值决策委员会。

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

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

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗, 所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

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

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离, 基金经理不直接参与或决定估值。

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

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司 (以下称“本托管人”) 在对中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) (以下称“本基金”) 的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内, 本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回

价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信保诚中证 800 有色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	106,716,019.04
结算备付金	-	2,486,474.59
存出保证金	-	598,050.34
交易性金融资产	6.4.7.2	1,671,084,193.30
其中：股票投资	-	1,671,084,193.30
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	86,231.94
应收股利	-	410,734.00
应收申购款	-	31,848,399.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	6.4.7.6	27,483.71
资产总计	-	1,813,257,586.41
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	-	15,388,032.64
应付赎回款	-	23,010,341.82
应付管理人报酬	-	1,430,801.18
应付托管费	-	314,776.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6.4.7.7	708,900.23
应交税费	-	8,130.12
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	6.4.7.8	326,264.77
负债合计	-	41,187,247.02
所有者权益：	-	-
实收基金	6.4.7.9	1,076,425,676.94
未分配利润	6.4.7.10	695,644,662.45
所有者权益合计	-	1,772,070,339.39
负债和所有者权益总计	-	1,813,257,586.41

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.509 元，基金份额总额 1,174,119,706.77 份。

6.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 800 有色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	-	84,211,424.19
1. 利息收入	-	861,043.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	191,197.26
债券利息收入	-	-
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	-	669,845.92
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	103,286,392.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	96,369,797.56
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	6,916,594.59
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-27,890,056.90
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	7,954,045.76
减: 二、费用	-	12,403,769.90
1. 管理人报酬	-	7,027,577.57
2. 托管费	-	1,546,067.02
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,524,225.45
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	2,411.40
7. 其他费用	6.4.7.19	303,488.46
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-	71,807,654.29
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-	71,807,654.29

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 中信保诚中证 800 有色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)	528,852,403.08	219,553,923.28	748,406,326.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	71,807,654.29	71,807,654.29
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)	547,573,273.86	404,283,084.88	951,856,358.74
其中: 1. 基金申购款	2,792,908,896.53	1,798,323,719.39	4,591,232,615.92
2. 基金赎回款	-2,245,335,622.67	-1,394,040,634.51	-3,639,376,257.18
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)	1,076,425,676.94	695,644,662.45	1,772,070,339.39

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

中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) (原“信诚中证 800 有色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”) 《关于核准信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]831 号文) 和《关于信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2013]761 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《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同》发售, 基金合同于 2013 年 8 月 30 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 301, 781, 767.94 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《信诚中证 800 有色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《关于信诚中证 800 有色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, 《信诚中证 800 有色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有色 A 份额和信诚有色 B 份额办理向场内信诚有色份额折算。于 2021 年 1 月 1 日, 《中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效, 基金名称由“信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)”, 取消分级机制, 基金规模为 576, 816, 871.49 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、《中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括中证 800 有色金属指数的成份股 (含存托凭证)、备选成份股 (含存托凭证)、新股 (含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具 (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%, 投资于中证 800 有色金属指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为:

95% × 中证 800 有色金属指数收益率 + 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，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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。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。登记在证券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、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税; 同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得, 由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超

过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司 (“挂牌公司”) 取得的股息、红利所得, 由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	106,716,019.04
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	106,716,019.04

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	1,620,061,818.12	1,671,084,193.30	51,022,375.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,620,061,818.12	1,671,084,193.30	51,022,375.18

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	8,459.35
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	1,006.47
应收债券利息	-
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	76,523.84
其他	242.28
合计	86,231.94

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	708,900.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	708,900.23

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	84,336.28
应付证券出借违约金	-
应付审计费	49,588.57
应付信息披露费	109,507.37
应付指数使用费	82,832.55
合计	326,264.77

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	576,816,871.49	528,852,403.08
本期申购	3,046,309,125.81	2,792,908,896.53
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,449,006,290.53	-2,245,335,622.67
本期末	1,174,119,706.77	1,076,425,676.94

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	-215,313,755.14	434,867,678.42	219,553,923.28
本期利润	99,697,711.19	-27,890,056.90	71,807,654.29
本期基金份额交易产生的变动数	-155,356,064.89	559,639,149.77	404,283,084.88

其中：基金申购款	-820,413,025.49	2,618,736,744.88	1,798,323,719.39
基金赎回款	665,056,960.60	-2,059,097,595.11	-1,394,040,634.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-270,972,108.84	966,616,771.29	695,644,662.45

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	162,808.18	
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	24,856.92	
其他	3,532.16	
合计	191,197.26	

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	911,285,660.39	
减：卖出股票成本总额	814,915,862.83	
买卖股票差价收入	96,369,797.56	

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益—买卖债券差价收入。

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	6,916,594.59
其中：证券出借权益补偿收入	687,884.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,916,594.59

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	-27,890,056.90
--股票投资	-27,890,056.90
--债券投资	-
--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	-27,890,056.90

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	7,888,947.70
转换费收入	65,098.06
合计	7,954,045.76

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

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其

总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	3,524,225.45
银行间市场交易费用	-
合计	3,524,225.45

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	140,551.62
银行费用	26,324.61
基金上市费	27,516.29
合计	303,488.46

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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	7,027,577.57
其中：支付销售机构的客户维护费	2,872,928.11

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	1,546,067.02
----------------	--------------

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	106,716,019.04	162,808.18

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

息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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	610	15,006.00	99,430.00	-
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	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

		日	月 21 日							
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	-
300952	恒辉安防	2021 年 03 月 03 日	2021 年 09 月 13 日	锁定期股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 03 月 11 日	2021 年 09 月 22 日	锁定期股票	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 24 日	锁定期股票	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 27 日	锁定期股票	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 27 日	锁定期股票	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 29 日	锁定期股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
30096	深水	2021 年	2021	锁定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-

1	海纳	03 月 23 日	年 09 月 30 日	股票						
300962	中金辐照	2021 年 03 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 03 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021 年 03 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 04 月 02 日	2021 年 10 月 13 日	锁定期股票	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021 年 04 月 06 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期股票	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 04 月 07 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 19 日	锁定期股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期股票	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 04 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	锁定期股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 04 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

300979	华利集团	2021年04月15日	2021年10月26日	锁定期股票	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021年04月19日	2021年10月27日	锁定期股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年04月21日	2021年11月01日	锁定期股票	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年04月28日	2021年11月11日	锁定期股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年05月12日	2021年11月22日	锁定期股票	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年05月17日	2021年11月25日	锁定期股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021年05月17日	2021年11月26日	锁定期股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年05月26日	2021年12月03日	锁定期股票	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年05月26日	2021年12月02日	锁定期股票	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年05月25日	2021年12月02日	锁定期股票	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年05月27日	2021年12月07日	锁定期股票	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-

			日							
301004	嘉益股份	2021年06月18日	2021年12月27日	锁定期股票	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年06月04日	2021年12月16日	锁定期股票	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	锁定期股票	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年06月09日	2021年12月17日	锁定期股票	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年06月15日	2021年12月22日	锁定期股票	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年06月21日	2021年12月29日	锁定期股票	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	锁定期股票	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	锁定期股票	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新发未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	锁定期股票	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2021年07月	新发未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-

		日	月 06 日							
301020	密封科技	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	锁定期股票	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新发未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	锁定期股票	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021 年 06 月 29 日	2021 年 07 月 07 日	新发未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新发未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 06 月 30 日	2021 年 07 月 09 日	新发未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 07 日	锁定期股票	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 06 月 25 日	2021 年 07 月 05 日	新发未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688329	艾隆科技	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 29 日	锁定期股票	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
688350	富淼科技	2021 年 01 月 21 日	2021 年 07 月 28 日	锁定期股票	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
68849	利元	2021 年	2022	锁定期	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

9	亨	06 月 23 日	年 01 月 01 日	股票						
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 07 月 07 日	锁定期股票	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	
688625	呈和科技	2021 年 05 月 31 日	2021 年 12 月 07 日	锁定期股票	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	
688639	华恒生物	2021 年 04 月 14 日	2021 年 10 月 22 日	锁定期股票	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	
688659	元琛科技	2021 年 03 月 24 日	2021 年 10 月 08 日	锁定期股票	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	
688819	天能股份	2021 年 01 月 07 日	2021 年 07 月 19 日	锁定期股票	41.79	43.69	10,146	424,001.34	443,278.74	

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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000629	攀钢钒钛	2021年07月08日-2021年07月13日	2.29	1,331,700	3,049,593.00
2	000630	铜陵有色	2021年07月01日	2.72	869,600	2,365,312.00
3	000758	中色股份	2021年07月05日-2021年07月08日	4.75	679,500	3,227,625.00
4	000807	云铝股份	2021年07月01日-2021年07月08日	11.90	549,000	6,533,100.00
5	000878	云南铜业	2021年07月01日-2021年07月13日	12.83	559,700	7,180,951.00
6	000960	锡业股份	2021年07月01日-2021年07月13日	16.03	574,000	9,201,220.00
7	000975	银泰黄金	2021年07月01日-2021年07月13日	9.51	913,000	8,682,630.00
8	002155	湖南黄金	2021年07月06日-2021年07月13日	7.75	267,600	2,073,900.00
9	002203	海亮股份	2021年07月07日-2021年07月13日	10.64	159,200	1,693,888.00
10	002460	赣锋锂业	2021年07月01日-2021年07月13日	121.09	74,000	8,960,660.00
11	600111	北方稀土	2021年07月01日-2021年07月13日	20.70	411,000	8,507,700.00
12	600219	南山铝业	2021年07月01日-2021年07月08日	3.60	3,085,100	11,106,360.00
13	600259	广晟有色	2021年07月01日-2021年07月08日	33.81	79,500	2,687,895.00
14	600362	江西铜业	2021年07月02日	22.38	146,800	3,285,384.00

			日-2021 年 07 月 08 日			
15	600392	盛和资源	2021年07月01日-2021年07月13日	17.36	744,200	12,919,312.00
16	600489	中金黄金	2021年07月05日-2021年07月06日	8.62	69,600	599,952.00
17	600497	驰宏锌锗	2021年07月01日-2021年07月13日	4.31	1,850,500	7,975,655.00
18	600516	方大炭素	2021年07月01日-2021年07月13日	7.44	519,400	3,864,336.00
19	600547	山东黄金	2021年07月05日-2021年07月13日	19.22	432,200	8,306,884.00
20	600549	厦门钨业	2021年07月01日-2021年07月08日	20.83	320,000	6,665,600.00
21	600673	东阳光	2021年07月05日	4.49	10,000	44,900.00
22	600988	赤峰黄金	2021年07月05日-2021年07月13日	14.99	231,100	3,464,189.00
23	601168	西部矿业	2021年07月05日-2021年07月13日	11.93	513,000	6,120,090.00
24	601600	中国铝业	2021年07月01日-2021年07月02日	5.30	889,700	4,715,410.00
25	601899	紫金矿业	2021年07月01日-2021年07月13日	9.69	4,075,700	39,493,533.00
26	601958	金钼股份	2021年07月05日-2021年07月13日	6.48	585,700	3,795,336.00
27	603260	合盛硅业	2021年07月01日-2021年07月08日	76.91	92,000	7,075,720.00
28	603799	华友钴业	2021年07月01日-2021年07月13日	114.20	150,000	17,130,000.00
29	603993	洛阳钼业	2021年07月01日	5.16	251,900	1,299,804.00

			日			
合计					20,434,700	202,026,939.00

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

公司风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计与风控委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等等。董事会下设审计与风控委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部与监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市

场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有长期债券投资。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受前述比例限制。)

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末, 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末, 本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及

对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	106,716,019.04	-	-	-	-	-	106,716,019.04
结算备付金	2,486,474.59	-	-	-	-	-	2,486,474.59
存出保证金	598,050.34	-	-	-	-	-	598,050.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,671,084,193.30	1,671,084,193.30
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	-	-	-	-	86,231.94	86,231.94
应收股利	-	-	-	-	410,734.00	410,734.00
应收申购款	-	-	-	-	31,848,399.49	31,848,399.49
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	27,483.71	27,483.71
资产总计	109,800,543.97	-	-	-	1,703,457,042.44	1,813,257,586.41
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	-	-	-	-	15,388,032.64	15,388,032.64
应付赎回款	-	-	-	-	23,010,341.82	23,010,341.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,430,801.18	1,430,801.18
应付托管费	-	-	-	-	314,776.26	314,776.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	708,900.23	708,900.23
应交税费	-	-	-	-	8,130.12	8,130.12
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	326,264.77	326,264.77
负债总计	-	-	-	-	41,187,247.02	41,187,247.02
利率敏感度缺口	109,800,543.97	-	-	-	1,662,269,795.42	1,772,070,339.39

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金持有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	1,671,084,193.30	94.30
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	1,671,084,193.30	94.30

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%	81,515,235.61
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-81,515,235.61

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 1,668,555,372.51 元，属于第二层次的余额为 2,528,820.79 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	1,671,084,193.30	92.16
	其中：股票	1,671,084,193.30	92.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	109,202,493.63	6.02
8	其他各项资产	32,970,899.48	1.82
9	合计	1,813,257,586.41	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 202,026,939.00 元，占基金

资产净值比例为 11.4%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	600,902,359.74	33.91
C	制造业	1,053,670,044.41	59.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	13,795,785.42	0.78
	合计	1,668,368,189.57	94.15

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	2,478,940.24	0.14
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	0.00
F	批发和零售业	86,628.46	0.00
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	30,477.64	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
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	0.00
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	2,716,003.73	0.15

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	601899	紫金矿业	23,593,750	228,623,437.50	12.90
2	002460	赣锋锂业	1,640,195	198,611,212.55	11.21
3	603799	华友钴业	1,731,119	197,693,789.80	11.16
4	600111	北方稀土	4,446,658	92,045,820.60	5.19
5	603993	洛阳钼业	14,407,615	74,343,293.40	4.20
6	600547	山东黄金	3,684,752	70,820,933.44	4.00
7	601600	中国铝业	13,308,065	70,532,744.50	3.98
8	600219	南山铝业	14,619,594	52,630,538.40	2.97
9	600362	江西铜业	2,115,652	47,348,291.76	2.67
10	601168	西部矿业	3,886,949	46,371,301.57	2.62
11	000807	云铝股份	3,826,900	45,540,110.00	2.57
12	600392	盛和资源	2,505,028	43,487,286.08	2.45
13	000630	铜陵有色	15,023,895	40,864,994.40	2.31
14	600549	厦门钨业	1,734,486	36,129,343.38	2.04
15	600988	赤峰黄金	2,374,800	35,598,252.00	2.01
16	300618	寒锐钴业	441,911	34,840,263.24	1.97
17	600516	方大炭素	4,656,032	34,640,878.08	1.95
18	600489	中金黄金	3,953,340	34,077,790.80	1.92
19	000960	锡业股份	2,041,450	32,724,443.50	1.85
20	000975	银泰黄金	3,396,844	32,303,986.44	1.82
21	600497	驰宏锌锗	6,228,400	26,844,404.00	1.51
22	000878	云南铜业	2,079,300	26,677,419.00	1.51
23	603260	合盛硅业	306,580	23,579,067.80	1.33

24	000060	中金岭南	5,095,141	23,030,037.32	1.30
25	002203	海亮股份	1,993,900	21,215,096.00	1.20
26	000629	攀钢钒钛	8,756,900	20,053,301.00	1.13
27	600673	东阳光	3,072,558	13,795,785.42	0.78
28	000758	中色股份	2,810,793	13,351,266.75	0.75
29	002155	湖南黄金	1,715,600	13,295,900.00	0.75
30	601958	金钼股份	1,973,633	12,789,141.84	0.72
31	600259	广晟有色	369,200	12,482,652.00	0.70
32	002532	天山铝业	1,043,300	8,753,287.00	0.49
33	603256	宏和科技	358,000	3,272,120.00	0.18

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	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.04
2	688819	天能股份	10,146	443,278.74	0.03
3	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
4	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01
5	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
6	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
7	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.01
8	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
9	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
10	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
11	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
12	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
13	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
14	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
15	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
16	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
17	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
18	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
19	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
20	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
21	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
22	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
23	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
24	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
25	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
26	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
27	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00

28	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
29	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
30	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
31	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
32	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
33	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
34	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
35	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
36	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
37	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
38	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
39	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
40	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
41	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
42	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
43	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
44	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
45	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
46	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
47	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
48	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
49	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
50	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
51	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
52	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
53	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
54	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
55	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
56	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
57	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
58	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
59	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
60	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
61	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
62	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
63	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
64	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
65	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
66	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	601899	紫金矿业	276,805,664.10	15.62
2	002460	赣锋锂业	198,098,265.63	11.18
3	603799	华友钴业	156,184,464.10	8.81
4	603993	洛阳钼业	98,804,807.55	5.58
5	600111	北方稀土	93,939,272.65	5.30
6	600547	山东黄金	87,736,772.52	4.95
7	600219	南山铝业	63,013,085.96	3.56
8	601168	西部矿业	62,584,390.29	3.53
9	601600	中国铝业	61,874,019.86	3.49
10	600362	江西铜业	58,229,184.64	3.29
11	600392	盛和资源	55,748,304.45	3.15
12	000630	铜陵有色	45,783,356.58	2.58
13	000807	云铝股份	40,410,175.06	2.28
14	600516	方大炭素	40,083,788.99	2.26
15	600988	赤峰黄金	38,352,283.07	2.16
16	600489	中金黄金	38,027,291.96	2.15
17	300618	寒锐钴业	36,820,457.79	2.08
18	600549	厦门钨业	35,344,825.01	1.99
19	000878	云南铜业	33,465,755.00	1.89
20	000975	银泰黄金	33,292,336.82	1.88

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	601899	紫金矿业	126,753,020.79	7.15
2	002460	赣锋锂业	106,445,208.57	6.01
3	603799	华友钴业	64,608,757.36	3.65
4	603993	洛阳钼业	50,417,362.65	2.85
5	600111	北方稀土	49,879,697.68	2.81
6	600547	山东黄金	46,987,104.42	2.65
7	601600	中国铝业	33,248,524.56	1.88
8	600219	南山铝业	32,912,622.58	1.86
9	600392	盛和资源	32,894,253.65	1.86
10	601168	西部矿业	32,179,463.00	1.82
11	600362	江西铜业	29,628,472.73	1.67
12	000630	铜陵有色	23,949,415.00	1.35

13	600516	方大炭素	21,282,088.52	1.20
14	600489	中金黄金	19,879,606.66	1.12
15	600549	厦门钨业	18,675,615.30	1.05
16	000975	银泰黄金	18,482,369.57	1.04
17	600338	西藏珠峰	18,014,378.60	1.02
18	000878	云南铜业	17,579,449.85	0.99
19	000807	云铝股份	16,313,557.08	0.92
20	000960	锡业股份	15,818,385.00	0.89

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	1,809,016,053.08
卖出股票收入(成交)总额	911,285,660.39

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与

股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

浙江华友钴业股份有限公司于 2020 年 12 月 30 日受到中国证券监督管理委员会浙江监管局下发的《关于对浙江华友钴业股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2020]110 号），因违反信息披露义务等违法违规行为被采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。

对“华友钴业”投资决策程序的说明：本基金跟踪的标的指数为中证 800 有色金属指数，华友钴业属于该指数成分股，本基金对于该证券是按照标的指数成分股进行相应投资的，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	598,050.34
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	410,734.00
4	应收利息	86,231.94
5	应收申购款	31,848,399.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	27,483.71
8	其他	-
9	合计	32,970,899.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601899	紫金矿业	39,493,533.00	2.23	转融通流通受限
2	603799	华友钴业	17,130,000.00	0.97	转融通流通受限
3	600219	南山铝业	11,106,360.00	0.63	转融通流通受限
4	002460	赣锋锂业	8,960,660.00	0.51	转融通流通受限
5	600111	北方稀土	8,507,700.00	0.48	转融通流通受限
6	600547	山东黄金	8,306,884.00	0.47	转融通流通受限
7	601168	西部矿业	6,120,090.00	0.35	转融通流通受限
8	601600	中国铝业	4,715,410.00	0.27	转融通流通受限
9	600362	江西铜业	3,285,384.00	0.19	转融通流通受限
10	603993	洛阳钼业	1,299,804.00	0.07	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688617	惠泰医疗	624,430.52	0.04	锁定期股票
2	688819	天能股份	443,278.74	0.03	锁定期股票
3	300957	贝泰妮	214,921.88	0.01	锁定期股票
4	688625	呈和科技	113,907.36	0.01	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
410,735	2,858.58	9,552,971.29	0.81%	1,164,566,735.48	99.19%

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	付玲兰	887,263.00	3.99%
2	陈志豪	831,471.00	3.74%
3	黄政	446,877.00	2.01%
4	蒋春朝	431,573.00	1.94%
5	中国中信集团公司企业年金计划-中信银行	308,276.00	1.39%
6	颜泽良	266,408.00	1.20%
7	李鸿深	259,574.00	1.17%
8	王筠	235,700.00	1.06%
9	季丽萍	218,000.00	0.98%
10	张春莉	207,868.00	0.93%

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	18,421.15	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 01 月 01 日) 基金份额总额	576,816,871.49
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,046,309,125.81
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,449,006,290.53
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	1,174,119,706.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2. 本报告期内, 无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内, 无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内, 本基金增加了存托凭证相关的投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

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

安信证券	1	245,510,875.81	9.06%	228,644.35	9.75%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	579,447,427.69	21.37%	539,636.69	23.02%	-
广发证券	2	336,207,897.85	12.40%	239,146.54	10.20%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	476,541,154.75	17.58%	338,965.09	14.46%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	61,382,636.07	2.26%	55,937.89	2.39%	-
浙商证券	1	33,453,270.09	1.23%	30,486.28	1.30%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	978,714,771.79	36.10%	911,479.47	38.88%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书	《上海证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021年01月01日
2	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要	同上	2021年01月01日
3	关于信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金之信诚有色 A 份额和信诚有色 B 份额基金份额折算结果的公告	同上	2021年01月05日
4	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金 2020 年第四季度报告	同上	2021年01月22日
5	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	同上	2021年01月22日
6	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书	同上	2021年01月29日
7	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2021年02月03日
8	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易提示性公告	同上	2021年02月03日
9	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金场内单笔最低申购金额的公告》	同上	2021年02月26日
10	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021年03月26日
11	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	同上	2021年03月26日

12	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2021年03月31日
13	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2021年03月31日
14	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
15	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2021年04月02日
16	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2021年04月02日
17	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第一季度报告	同上	2021年04月21日
18	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	同上	2021年04月21日
19	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	同上	2021年05月14日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金赎回费率优惠活动的公告	同上	2021年05月14日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金管理人于 2021 年 8 月 25 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，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，同时对托管协议其他条款进行修订。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、信诚中证 800 有色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、(原)信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同
- 4、(原)信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书
- 5、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 6、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书
- 7、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