

# 中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：2024 年 07 月 18 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 中信保诚国企红利量化股票  |
| 基金主代码      | 020768  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2024 年 03 月 22 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 131,494,327.23 份  |
| 投资目标       | 本基金重点关注国企红利主题相关上市公司的投资机会，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济运行状况、政策环境、利率走势、证券市场走势的分析进行战略判断，确定投资组合中股票、债券、现金、金融衍生品等大类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）国企红利主题的界定</p> <p>本基金重点关注国企红利主题相关上市公司的投资机会，本基金所定义的国企红利主题相关股票（含存托凭证）是指经营状况良好，具有稳定分红能力，且满足以下第 1）项和第 2）项中任一条件的上市公司发行的股票（含存托凭证）：</p> |

- 1) 中证国有企业红利指数成份股和备选成份股;
- 2) 在过去两年中,至少有一年实施现金分红且现金分红率(现金分红/净利润)或股息率(现金分红/市值)处于市场前 50% 的国有上市公司。

本基金对国有上市公司的界定如下:

- 1) 国有控股上市公司:指政府部门、机构、事业单位、国有独资企业(公司)、国有全资企业、国有控股企业单独或共同出资,直接或间接合计拥有股权比例超过 50%的上市公司;
- 2) 国有实际控制上市公司:指政府部门、机构、事业单位、国有独资企业(公司)、国有全资企业、国有控股企业直接或间接合计持股比例未超过 50%,但其中之一构成控制,或通过股东协议、公司章程、董事会决议或者其他协议安排能够对其实际支配的上市公司;
- 3) 国有参股上市公司:指国有出资并对企业有重大影响上市公司,“重大影响”的界定参照《企业会计准则》相关规定。当国家政策、法律法规、相关准则发生变化,或基金管理人认为有更适当的国企红利主题界定标准,基金管理人在履行适当程序后,可以对界定方法进行变更并在更新的招募说明书中公告。

#### (2) 股票投资策略

本基金采用的量化选股模型,以对中国股票市场的长期研究为基础,结合前瞻性市场判断,构建量化选股模型。

模型综合考虑股票的基本面(如分红能力、盈利能力、运营质量、成长性、估值等)、价量特征、事件性因素等因子,对股票进行综合评价后,挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。本基金管理人会持续研究市场状态、市场变化以及模型运作状况,并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。对于港股通标的股票,本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场。本基金主要采用“自下而上”的量化选股方式,精选出具有投资价值的优质标的。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必然投资港股通标的股票。

对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析和定量分析相结合的方式,筛选相应的存托凭证投资标的。

#### 3、债券投资策略

本基金出于对流动性、有效利用基金资产的考量,适时对债券进行投资。本基金的债券投资以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,进行相应的

久期配置和个券选择，构建债券投资组合，以期获得与风险相匹配的投资收益。

#### 4、证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，研究资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，评估其内在价值。

#### 6、可转换债券、可交换债券投资策略

本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，研究上市公司对转股价的修正和转股意愿。

#### 7、衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标，基金还可投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。

本基金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，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。

本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，结合期权定价模型投资股票期权，提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

#### 8、融资业务投资策略

本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资业务。

利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
|                 | 使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。<br>未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标和风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。                    |                  |
| 业绩比较基准          | 中证国有企业红利指数收益率×85%+恒生指数收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%   |                  |
| 风险收益特征          | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。<br>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的的股票，如投资，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |                  |
| 基金管理人           | 中信保诚基金管理有限公司   |                  |
| 基金托管人           | 华泰证券股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 中信保诚国企红利量化股票 A   | 中信保诚国企红利量化股票 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 020768   | 020769           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 20,153,711.05 份  | 111,340,616.18 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2024 年 04 月 01 日-2024 年 06 月 30 日） |                |
|-----------------|--|----------------|
|                 | 中信保诚国企红利量化股票 A                         | 中信保诚国企红利量化股票 C |
| 1. 本期已实现收益      | 75,037.21                              | 682,324.24     |
| 2. 本期利润         | -434,220.23                            | -1,903,825.96  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0166                                | -0.0083        |
| 4. 期末基金资产净值     | 19,705,175.42                          | 108,671,489.82 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9777                                 | 0.9760         |

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 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

中信保诚国企红利量化股票 A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -2.24%     | 0.58%         | 0.23%          | 0.75%                 | -2.47% | -0.17% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | -2.23%     | 0.54%         | -0.30%         | 0.72%                 | -1.93% | -0.18% |

中信保诚国企红利量化股票 C

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -2.39%     | 0.58%         | 0.23%          | 0.75%                 | -2.62% | -0.17% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | -2.40%     | 0.54%         | -0.30%         | 0.72%                 | -2.10% | -0.18% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中信保诚国企红利量化股票 A



中信保诚国企红利量化股票 C



注：1、本基金建仓期自 2024 年 03 月 22 日至 2024 年 09 月 22 日，截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

2、本基金合同生效日为 2024 年 03 月 22 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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 | 量化投资部副总监、基金经理 | 2024 年 03 月 22 日 | -    | 10     | 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 |

|    |      |                  |   |    |   |
|----|------|------------------|---|----|---|
|    |      |                  |   |    | <p>司，历任投资经理、基金经理助理、量化二部副总监。现任量化投资部副总监，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）、中信保诚中证 500 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）、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金的基金经理。</p>   |
| 黄稚 | 基金经理 | 2024 年 03 月 22 日 | - | 12 | <p>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）、中信保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</p> |



|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 智能家居指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同、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 公平交易专项说明

##### 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》，以及公司公平交易及异常交易管理相关规定，公司采取了一系列的行动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，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本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

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，事后根据公司公平交易及异常交易管理相关规定定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资组合经理出具情况说明后签字确认。报告期内，本基金与公司旗下管理的其它产品之间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。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每月对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内，未发现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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2024 年二季度，海外方面，美国通胀有所缓和，但美联储表态偏鹰，降息预期反复波动，美债利率仍在高位运行。国内方面，国内经济继续修复，社零边际改善，外需拉动下制造业韧性较强，基建增速略有放缓，房地产投资继续承压。5 月份地产政策落地，基本面恢复有待进一步观察。

报告期内，A 股市场整体震荡调整，风险偏好仍处于低位。上证指数下跌 2.43%，沪深 300 指数下跌 2.14%，中证 500 指数下跌 6.50%。分行业来看，银行、公用事业、电子、煤炭、交通运输等行业表现较好，而传媒、商贸零售、社会服务、计算机等行业跌幅较大。从风格上看，经济总量弹性较为缺乏的背景下，大盘和红利风格仍相对占优。

国有企业是国民经济的重要支柱。在国内经济转型升级的过程中，国有企业经营韧性较强，承担着保障安全、稳定经济、产业引领等重要功能。近年来随着内外部不确定性提高，投资者从追求“高成长”逐渐转向追求“确定性”。在此过程中，综合实力较强、经营稳定性和分红持续性较好的央国企上市公司比较符合投资者偏好。因此，我们重点关注经营稳定、有持续分红能力的国有企业的中长期投资价值。

在基金投资上，本基金前期逐步建仓，之后维持较高股票仓位。本基金重点关注高分红国有企业上市公司的投资机会，坚持采取量化策略进行股票投资，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚国企红利量化股票 A 份额净值增长率为-2.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%；中信保诚国企红利量化股票 C 份额净值增长率为-2.39%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或者基金份额持有人数量不满

二百人的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 115,185,562.41 | 89.28        |
|    | 其中：股票             | 115,185,562.41 | 89.28        |
| 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      | 13,794,759.92  | 10.69        |
| 8  | 其他资产              | 31,997.33      | 0.02         |
| 9  | 合计                | 129,012,319.66 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 3,055,062.00  | 2.38         |
| C  | 制造业              | 34,652,346.06 | 26.99        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,970,122.00  | 2.31         |
| E  | 建筑业              | 9,251,343.80  | 7.21         |
| F  | 批发和零售业           | 740,015.00    | 0.58         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,327,945.00  | 6.49         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 459,764.67    | 0.36         |
| J  | 金融业              | 44,493,112.88 | 34.66        |
| K  | 房地产业             | 3,837,132.00  | 2.99         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 6,803,844.00  | 5.30         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 227,810.00    | 0.18         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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       | 367,065.00     | 0.29  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 115,185,562.41 | 89.72 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 601009 | 南京银行 | 373,900 | 3,884,821.00 | 3.03         |
| 2  | 601288 | 农业银行 | 852,500 | 3,716,900.00 | 2.90         |
| 3  | 600901 | 江苏金租 | 719,700 | 3,634,485.00 | 2.83         |
| 4  | 600919 | 江苏银行 | 480,400 | 3,569,372.00 | 2.78         |
| 5  | 000932 | 华菱钢铁 | 786,900 | 3,485,967.00 | 2.72         |
| 6  | 600153 | 建发股份 | 390,000 | 3,482,700.00 | 2.71         |
| 7  | 000090 | 天健集团 | 829,840 | 3,335,956.80 | 2.60         |
| 8  | 600755 | 厦门国贸 | 463,200 | 3,321,144.00 | 2.59         |
| 9  | 000830 | 鲁西化工 | 284,700 | 3,299,673.00 | 2.57         |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 181,900 | 3,205,078.00 | 2.50         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，报告编制日前一年内，江苏银行股份有限公司受到国家金融

监督管理总局江苏监管局处罚（苏金罚决字[2023]2号）；南京银行股份有限公司受到国家外汇管理局江苏省分局处罚（苏汇检罚[2023]4号）；厦门建发股份有限公司受到中国证券监督管理委员会厦门监管局处罚（厦门证监局[2024]7号）；中国农业银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局处罚（金罚决字[2023]21号、金罚决字[2023]8号、京汇罚[2023]32号）。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金采取量化选股策略。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序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没有被中国人民银行及其分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、国家金融监督管理总局及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 31,997.33 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 31,997.33 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 中信保诚国企红利量化股票 A | 中信保诚国企红利量化股票 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 28,580,573.97  | 277,819,224.62 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 315,427.72     | 1,016,688.06   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 8,742,290.64   | 167,495,296.50 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 20,153,711.05  | 111,340,616.18 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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     | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -    |
| 个人     | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -    |
| 产品特有风险 |                |                         |      |      |      |            |      |
| 无      |                |                         |      |      |      |            |      |

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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

中信保诚基金管理有限公司  
2024 年 07 月 18 日