

# 中信保诚红利精选混合型证券投资基金

## 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行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       | 中信保诚红利精选   |
| 基金主代码      | 008091   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019 年 12 月 25 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 49,716,036.02 份  |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下，通过积极把握红利主题股票的投资机会，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、港股、债券、现金、金融衍生品等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的回报。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p> <p>2、股票投资策略</p> |

(1) 红利主题股票的界定

本基金所称红利主题股票指的是基本面良好、盈利能力较强、分红稳定或分红预期高、或进行股份回购的上市公司股票。本基金将深度挖掘这些红利主题股票的投资机会，并根据以下条件建立基础库。满足以下一项或多项条件的股票可以入选基础库：

- 1) 稳定的分红历史。最近 3 年至少 2 年都进行现金分红；或最近 5 年至少 3 年都进行现金分红；对上市不足 3 年的公司，上市后每个完整会计年度均有现金分红或现金分红预案。
- 2) 较高的分红预期：公司具有较好的资产负债和现金流情况，潜在分红预期高。
- 3) 股份回购：过去一段时间进行过股份回购，或发布股份回购预案未来即将进行股份回购的公司。

(2) 个股精选

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，选择其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，选择安全边际较高的个股。

由于本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，因而本基金将在前述股票投资策略的基础上选择安全边际较高的港股通标的股票进行投资。

3、债券投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。

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

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包

|               |   |
|---------------|---|
|               | <p>括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>8、股票期权投资策略</p> <p>本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。</p> <p>9、融资投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的，本基金将从其最新规定。</p> <p>10、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>中证红利指数收益率*70%+中证港股通高股息投资指数收益率*10%+中证综合债指数收益率*20%</p>   |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场</p>  |

|                 |                     |                 |
|-----------------|---------------------|-----------------|
|                 | 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           | 中国银行股份有限公司          |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 中信保诚红利精选 A          | 中信保诚红利精选 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 008091              | 008092          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 22,731,543.07 份     | 26,984,492.95 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） |               |
|-----------------|--|---------------|
|                 | 中信保诚红利精选 A                             | 中信保诚红利精选 C    |
| 1. 本期已实现收益      | -1,042,064.46                          | -1,073,887.56 |
| 2. 本期利润         | 603,268.65                             | 562,654.26    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0251                                 | 0.0226        |
| 4. 期末基金资产净值     | 33,118,381.26                          | 38,613,354.09 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4569                                 | 1.4309        |

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

中信保诚红利精选 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          | 1.53%      | 0.55%         | 1.69%          | 0.63%                 | -0.16% | -0.08% |
| 过去六个月          | 6.66%      | 0.66%         | 8.36%          | 0.74%                 | -1.70% | -0.08% |
| 过去一年           | 3.81%      | 0.62%         | 6.79%          | 0.63%                 | -2.98% | -0.01% |
| 过去三年           | -2.21%     | 0.85%         | 7.54%          | 0.83%                 | -9.75% | 0.02%  |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 45.69%     | 0.88%         | 21.91%         | 0.86%                 | 23.78% | 0.02%  |

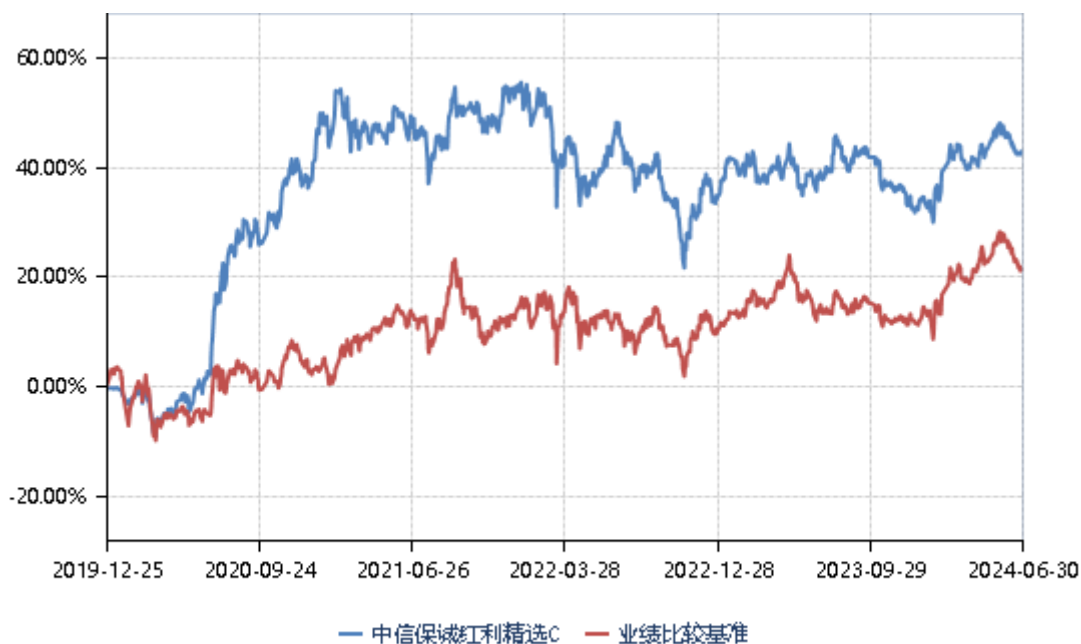
中信保诚红利精选 C

| 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          | 1.43%      | 0.55%         | 1.69%          | 0.63%                 | -0.26%  | -0.08% |
| 过去六个月          | 6.45%      | 0.66%         | 8.36%          | 0.74%                 | -1.91%  | -0.08% |
| 过去一年           | 3.40%      | 0.62%         | 6.79%          | 0.63%                 | -3.39%  | -0.01% |
| 过去三年           | -3.37%     | 0.85%         | 7.54%          | 0.83%                 | -10.91% | 0.02%  |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 43.09%     | 0.89%         | 21.91%         | 0.86%                 | 21.18%  | 0.03%  |

### 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



中信保诚红利精选 C



## § 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 |        |  |
| 提云涛 | 量化投资部总监、基金经理 | 2019年12月25日 | -    | 24     | 提云涛先生，经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于东方证券有限责任公司，担任研究所所长助理；于上海申银万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015年6月加入中信保诚基金管理有限公司，担任量化投资 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 部总监。现兼任中信保诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚至选灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业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合规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《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

从海外经济看，二季度美国经济虽然有放缓迹象，劳动力紧张和通胀情况有所缓解，但总体仍然保持较强的态势，周边市场也保持相对比较强的预期。国内经济延续之前趋势。在海外较好背景下，4-5 月出口增速上行，韧性较强；消费整体符合预期；投资方面，基建和地产投资仍有待改善。制造业采购经理指数（PMI）在 3、4 月份站到 50% 上方后，在 5、6 月份又回到 50% 以下。

股票市场，本季度 A 股市场震荡下跌。沪深 300、中证 500 分别下跌 2.14%、6.50%。分行业看，银行、电力、交通运输逆势上涨；消费服务、传媒、计算机板块跌幅居前。债券市场，利率债曲线整体陡峭化下行，二季度资金面偏宽松，4 月下旬央行提及长债利率与经济增长预期匹配，长端和超长端明显调整，之后震荡下行，10Y/30Y 国债收益率季度低点分别在 2.21%/2.42% 附近。政策方面，4 月政治局会议定调积极，强调政策保持必要力度，对地产表述发生明显转变，提及“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”，5 月 17 日央行下调首付比例、房贷利率等，宽松力度较大，各地逐步因城施策积极推动地产销售。

二季度，本基金在投资中仍然是沿用“定量+定性”方法，采用“与好公司共成长”的策略。既考察盈利、估值和现金股利等量化指标，也考虑公司治理、企业文化、经营稳健性等定性因素，同时判断盈利和红利的持续性与长期可增长性。在传统行业、新兴行业等寻找预期未来盈利和分红都稳定增长且估值相

对合理的股票。同时，根据个股的估值与盈利增长匹配情况适当调整组合。

展望三季度，预期美国经济虽然有望继续维持韧性，但将有所降温，市场可能预期降息幅度和频次会减弱。欧洲经济仍然可能相对偏弱，以上因素或支撑美元走强。国内经济，预期出口表现可能依然较好，消费继续保持平稳修复，基建或有所改善。但在收入预期疲弱的背景下地产销售仍是等待好转。

基金投资，本基金仍然坚持“与好公司共成长”的策略。综合考虑公司治理、经营稳健性、盈利、估值、历史分红、分红的可持续性和可增长性、企业文化等因素，寻找预期未来盈利和分红都稳定增长且估值相对合理的股票。同时，根据个股的估值与盈利分红及其增长匹配情况调整组合。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚红利精选 A 份额净值增长率为 1.53%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%；中信保诚红利精选 C 份额净值增长率为 1.43%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%。

#### 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              | 62,177,822.45 | 85.70        |
|    | 其中：股票             | 62,177,822.45 | 85.70        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 3,440,716.99  | 4.74         |
|    | 其中：债券             | 3,440,716.99  | 4.74         |
|    | 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      | 6,682,878.39  | 9.21         |
| 8  | 其他资产              | 255,230.64    | 0.35         |
| 9  | 合计                | 72,556,648.47 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 338,786.82 元，占资产净值比例为 0.47%。

## 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              | 6,642,800.00  | 9.26         |
| C  | 制造业              | 25,817,896.11 | 35.99        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,209,650.00  | 5.87         |
| E  | 建筑业              | 918,252.00    | 1.28         |
| F  | 批发和零售业           | 173,967.00    | 0.24         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 7,301,077.32  | 10.18        |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,204,043.20  | 1.68         |
| J  | 金融业              | 13,979,922.00 | 19.49        |
| K  | 房地产业             | 1,591,428.00  | 2.22         |
| 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               | -             | -            |
|    | 合计               | 61,839,035.63 | 86.21        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币）  | 占基金资产净值比例（%） |
|------|------------|--------------|
| 金融   | 338,786.82 | 0.47         |
| 合计   | 338,786.82 | 0.47         |

注：以上分类采用全球行业分类系统(GICS)提供的国际通用分类标准。

## 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  | 600900 | 长江电力 | 123,100 | 3,560,052.00 | 4.96 |
| 2  | 600012 | 皖通高速 | 201,400 | 2,813,558.00 | 3.92 |
| 3  | 600377 | 宁沪高速 | 194,400 | 2,449,440.00 | 3.41 |
| 4  | 600309 | 万华化学 | 29,400  | 2,377,284.00 | 3.31 |
| 5  | 600188 | 兖矿能源 | 101,200 | 2,300,276.00 | 3.21 |
| 6  | 601398 | 工商银行 | 333,200 | 1,899,240.00 | 2.65 |
| 6  | 01398  | 工商银行 | 80,000  | 338,786.82   | 0.47 |
| 7  | 601328 | 交通银行 | 290,200 | 2,167,794.00 | 3.02 |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 1,400   | 2,054,346.00 | 2.86 |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 29,200  | 1,883,400.00 | 2.63 |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 41,200  | 1,828,044.00 | 2.55 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 3,440,716.99 | 4.80         |
| 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） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 3,440,716.99 | 4.80         |

#### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019631 | 20 国债 05 | 20,000 | 2,015,250.41 | 2.81         |
| 2  | 019727 | 23 国债 24 | 14,000 | 1,425,466.58 | 1.99         |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

#### 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

| 代码                | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元)      | 公允价值变动(元) | 风险说明     |
|-------------------|--------|----------|--------------|-----------|----------|
| IH2408            | IH2408 | 2        | 1,416,360.00 | 9,360.00  | -        |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |          |              |           | 9,360.00 |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |          |              |           | -33.44   |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |          |              |           | 9,087.38 |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

## 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

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

### 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，交通银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局处罚（金罚决字[2024]29号）。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的经营状况，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体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   | 179,163.89 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 76,066.75  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 255,230.64 |

### 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                        | 中信保诚红利精选 A    | 中信保诚红利精选 C    |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 26,587,739.68 | 25,716,602.16 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,148,345.89  | 5,899,592.88  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 5,004,542.50  | 4,631,702.09  |
| 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               | 22,731,543.07 | 26,984,492.95 |

## § 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|----|----------------|------------|
|    |                |            |

| 者类别    | 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、中信保诚红利精选混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚红利精选混合型证券投资基金基金合同
- 4、中信保诚红利精选混合型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 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