

中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF)
场内简称	金融 LOF
基金主代码	165521
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
报告期末基金份额总额	120,581,143.30 份
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 金融指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	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

	<p>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 金融价格指数收益率+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。	
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	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) A	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	金融 LOF	-
下属分级基金的交易代码	165521	013121
报告期末下属分级基金的份额总额	117,035,056.72 份	3,546,086.58 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)	
	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) A	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C
1. 本期已实现收益	-160,694.27	-13,328.00
2. 本期利润	1,766,952.35	93,113.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0149	0.0236
4. 期末基金资产净值	115,829,296.84	3,469,934.18
5. 期末基金份额净值	0.9897	0.9785

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

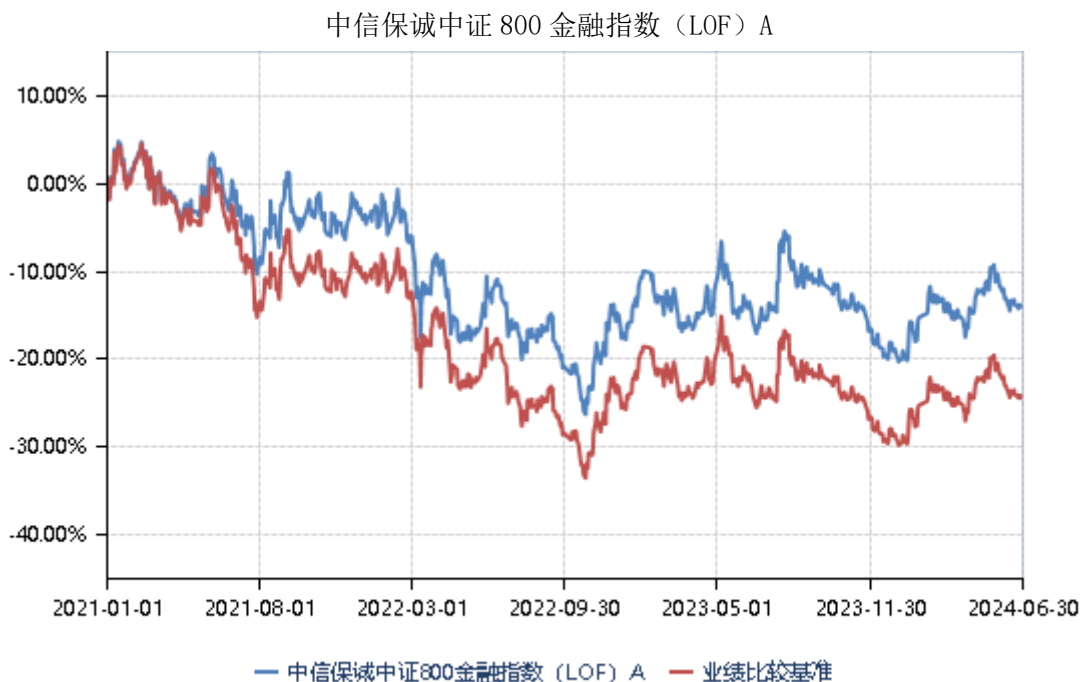
中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) A

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	1.46%	0.75%	0.97%	0.75%	0.49%	0.00%
过去六个月	4.93%	0.83%	4.84%	0.83%	0.09%	0.00%
过去一年	2.07%	0.91%	0.19%	0.91%	1.88%	0.00%
过去三年	-12.96%	1.11%	-20.83%	1.12%	7.87%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	-13.94%	1.12%	-24.28%	1.12%	10.34%	0.00%

中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	1.35%	0.75%	0.97%	0.75%	0.38%	0.00%
过去六个月	4.72%	0.83%	4.84%	0.83%	-0.12%	0.00%
过去一年	1.66%	0.91%	0.19%	0.91%	1.47%	0.00%
自基金合同生效起 至今	-9.50%	1.08%	-15.38%	1.09%	5.88%	-0.01%

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



§ 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	2018 年 04 月 10 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。

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

2024 年二季度,海外方面美国通胀缓和,市场对美联储降息预期的博弈持续,但美联储表态偏鹰。国

内方面，国内社零数据有所改善，但出口方面仍没有看到复苏信号，需求端继续逼迫供给端调整。基建增速放缓，地产板块虽有政策但数据仍不及预期。

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。

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，力争提高基金收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中信保诚中证 800 金融指数（LOF）A 份额净值增长率为 1.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.97%；中信保诚中证 800 金融指数（LOF）C 份额净值增长率为 1.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

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	111,602,761.85	93.31
	其中：股票	111,602,761.85	93.31
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	7,949,375.60	6.65
8	其他资产	55,788.65	0.05
9	合计	119,607,926.10	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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	149,328.00	0.13
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	111,381,974.49	93.36
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	-	-
	合计	111,531,302.49	93.49

5.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,061.66	0.05
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	15,215.63	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,182.07	0.00
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	71,459.36	0.06

5.2.3 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。

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 报告期末指数投资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	601318	中国平安	273,833	11,325,732.88	9.49
2	600036	招商银行	314,080	10,738,395.20	9.00
3	601166	兴业银行	367,356	6,472,812.72	5.43
4	601328	交通银行	690,192	5,155,734.24	4.32
5	601398	工商银行	880,372	5,018,120.40	4.21
6	600030	中信证券	245,197	4,469,941.31	3.75
7	601288	农业银行	801,884	3,496,214.24	2.93
8	300059	东方财富	317,231	3,349,959.36	2.81
9	600919	江苏银行	368,740	2,739,738.20	2.30
10	000001	平安银行	243,750	2,474,062.50	2.07

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603381	永臻股份	433	11,997.72	0.01

2	603350	安乃达	556	11,431.36	0.01
3	603285	键邦股份	515	9,604.75	0.01
4	688692	达梦数据	39	6,822.27	0.01
5	688691	灿芯股份	121	5,143.71	0.00

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

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。

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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

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); 平安银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、中国人民银行、中国证券监督管理委员会深圳监管局处罚(金罚决字[2024]6号、深金罚决字[2023]69号、银罚决字[2023]55号、行政监管措施决定书[2023]264号); 招商银行股份有限公司受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局处罚(金罚决字[2024]30号、深金罚决字[2023]81号、深外管检[2023]42号); 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); 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); 中信证券股份有限公司受到中国证券监督管理委员会、中国证券监督管理委员会广东监管局处罚(证监立案字 03720240049号、证监立案字 0032024018号、中国证监会[2024]45号、中国证监会处罚字[2024]56号、广东证监局[2024]41号、行政监管措施决定书[2023]102号), 收到中国证券监督管理委员会深圳监管局《关于对中信证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。

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	1,887.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,901.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	55,788.65

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

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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	603350	安乃达	11,431.36	0.01	新股未上市
2	603285	键邦股份	9,604.75	0.01	新股未上市
3	688692	达梦数据	6,822.27	0.01	锁定期股票
4	688691	灿芯股份	5,143.71	0.00	锁定期股票
5	603381	永臻股份	1,105.72	0.00	锁定期股票

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	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) A	中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	121,285,713.38	4,305,921.53
报告期期间基金总申购份额	1,941,821.85	2,381,088.58
减：报告期期间基金总赎回份额	6,192,478.51	3,140,923.53
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	117,035,056.72	3,546,086.58

§ 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、（原）信诚中证 800 金融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、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）基金合同
- 4、中信保诚中证 800 金融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

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。

中信保诚基金管理有限公司
2024 年 07 月 18 日