

中信保诚红利精选混合型证券投资基金
2021 年第一季度报告

2021 年 03 月 31 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 04 月 21 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 2021 年 04 月 20 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 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 | 194,533,194.62 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> <p>（1）红利主题股票的界定</p> <p>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：</p> <p>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，</p> |

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。

6、股指期货投资策略

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

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | <p>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 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 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 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 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> | |
| 业绩比较基准 | 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% | |
| 风险收益特征 | 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 | 50,550,706.27 份 | 143,982,488.35 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | - | - |

§ 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（2021 年 01 月 01 日-2021 年 03 月 31 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 | 11,517,214.42 | 20,587,400.49 |
| 2. 本期利润 | 7,926,988.34 | 13,847,164.33 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1093 | 0.0987 |
| 4. 期末基金资产净值 | 74,560,170.42 | 211,301,734.05 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4750 | 1.4676 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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:

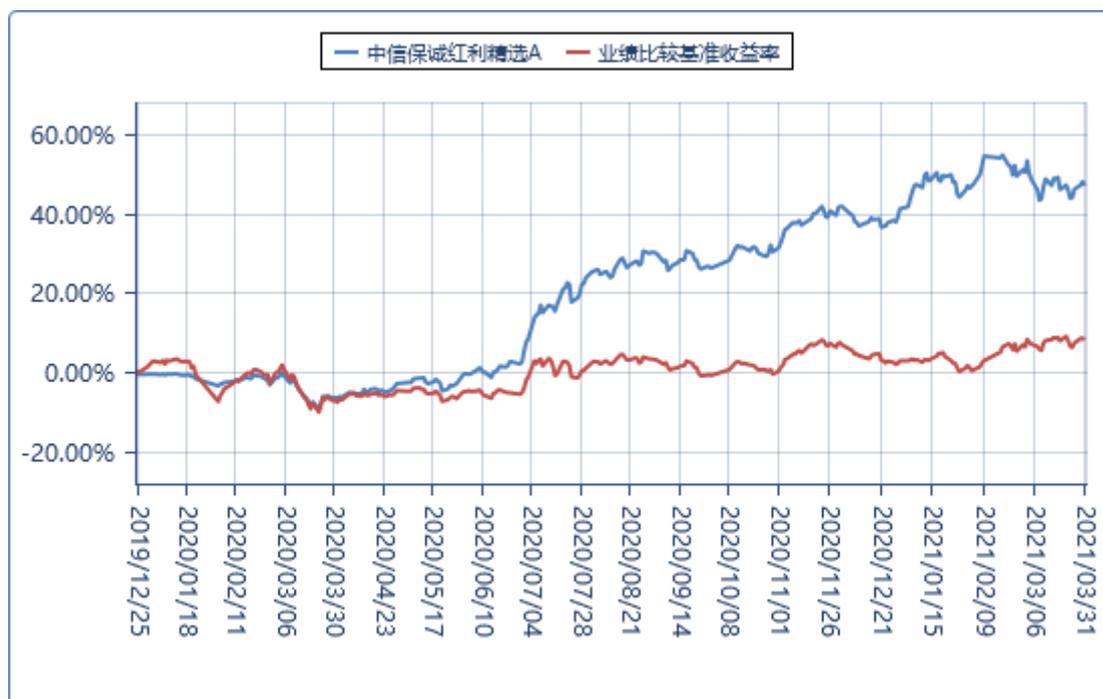
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 4.13% | 1.18% | 5.11% | 0.86% | -0.98% | 0.32% |
| 过去六个月 | 16.38% | 1.01% | 9.01% | 0.77% | 7.37% | 0.24% |
| 过去一年 | 56.55% | 1.03% | 16.27% | 0.84% | 40.28% | 0.19% |
| 自基金合同生效起 至今 | 47.50% | 0.99% | 8.71% | 1.00% | 38.79% | -0.01% |

中信保诚红利精选 C:

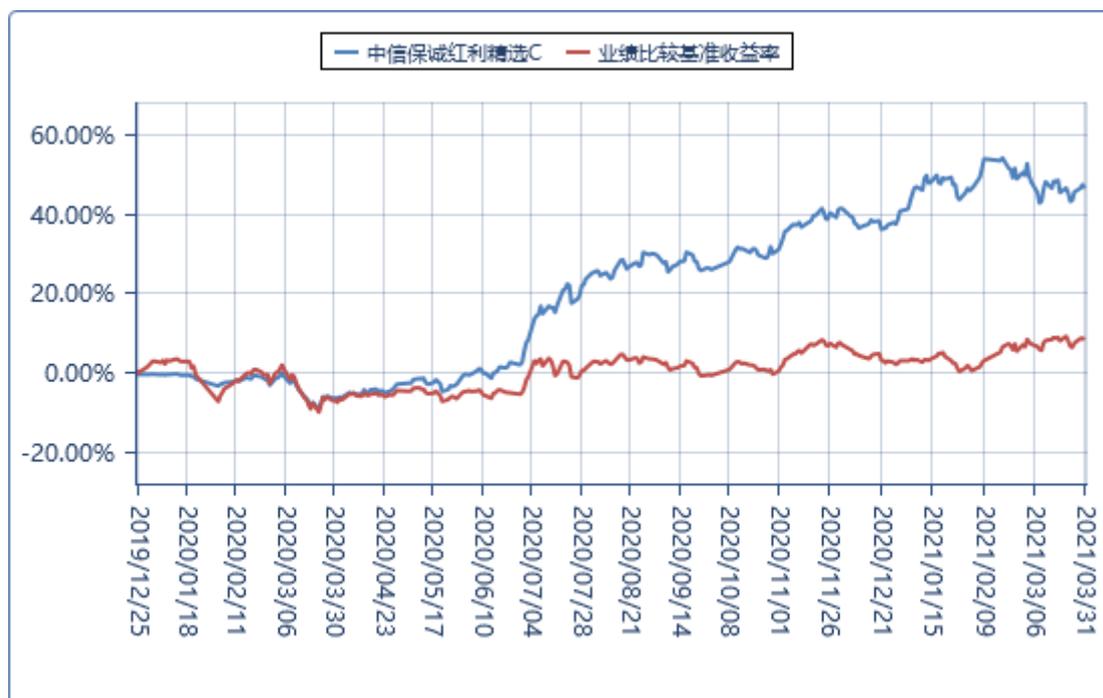
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 4.03% | 1.18% | 5.11% | 0.86% | -1.08% | 0.32% |
| 过去六个月 | 16.15% | 1.01% | 9.01% | 0.77% | 7.14% | 0.24% |
| 过去一年 | 55.93% | 1.03% | 16.27% | 0.84% | 39.66% | 0.19% |
| 自基金合同生效起 至今 | 46.76% | 0.99% | 8.71% | 1.00% | 38.05% | -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

中信保诚红利精选 A:



中信保诚红利精选 C:



注：本基金建仓期自 2019 年 12 月 25 日至 2020 年 06 月 25 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 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 | 量化投资总监、本基金的基金经理 | 2019 年 12 月 25 日 | - | 20 | 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，担任量化投资总监。现兼任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、信诚新选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)、信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《中信保诚红利精选混合型证券投资基金基金合同》、《中信保诚红利精选混合型证券投资基金招募说明书》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》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度,海外,疫苗接种加速为社会经济生活向常态恢复提供了条件,各国开始重启经济,进入“抗疫”下半场和经济恢复上半场。国内,尽管局部疫情在小范围干扰社会生活,但经济活动继续恢复,制造业 PMI 指数连续 13 个月保持在 50 以上,非制造业商务活动指数也继续呈回升趋势。随着经济恢复,国内货币政策进一步回归常态。对外经济仍保持原有态势。

股票市场, A 股市场先涨后跌,行业呈估值恢复特征。市场在 1 月初快速上涨,春节后又快速回落。一季度,沪深 300、中证 500、中证 1000 分别下跌 3.13%、1.78%、5.31%。分行业看,钢铁、公用事业、银行、休闲服务、建筑装饰涨幅居前,国防军工、非银金融、通讯、计算机等跌幅居前。债券市场,延续震荡走势,10 年国债收益率基本维持在 3.1%至 3.3%之间波动。在流动性中性背景下,信用利差有所修复,但投资者的风险偏好并未改变。

一季度,本基金从基本面出发采用“量化+主动”的方法选择个股。一方面,配置低估值高股息的银行、地产、交通运输、公用事业等行业的龙头公司作为防御组合,这些公司虽然预期增长不高,但安全边际高,长期盈利增长稳定;另外,配置食品饮料、医药相关等虽然估值较高但长期预期增长较高的行业的公司,配置家电、化工、建材行业的龙头公司。同时,在可能的情况下积极参与网下新股申购等投资以增强收益。

展望 2021 年二季度,海外,随着疫苗推广,预计疫情将进一步缓解,社会经济生活继续恢复。同时,拜登的新基建计划也有助改善美国经济预期,疫情受到控制后,美国经济也将逐步恢复。国内,在推进疫苗接种背景下,经济和生活将继续回归常态。股票市场,部分前期估值过高行业的估值有所下降,前期低估值行业的估值也有所回升,行业相对估值趋于合理。在过度交易热情消退后,虽然短期会有各种概念的炒作,但中长期看,市场将更理性平衡公司盈利、盈利增长、盈利稳健性与估值的匹配来选择投资标的;预期市场将在一定区间内波动一段时间。从结构上看,一方面,前期涨幅较低的低估值优质蓝筹股仍有可能赚取长期盈利的收益;另一方面,前期估值过高回调较大的股票在估值趋于合理后可能有所反弹。债券市场,预期仍保持一季度状况。

后续投资,我们认为公司长期盈利稳健增长是股价上涨的源动力,用量化与主动结合方法在行业龙头公司中挑选标的,并保持行业分布相对分散和均衡。一方面,在兼顾当前估值的同时,综合考虑当前红利与未来红利增长,继续坚持“与好公司共成长”的策略。以长期维度,从公司治理、公司企业文化、公司执行力和创新能力、公司经营的稳健性等视角选择好公司。在选择低估值高股息股票构建稳健组合同时,也适当选择预期未来盈利和分红都稳定增长且估值相对合适股票构建积极组合获取预期增长

的收益。另一方面，在坚持基础策略同时，综合考虑个股的估值与盈利增长匹配情况在预期可控范围内适当积极调整组合。同时，综合考虑“经济、流动性、政策、估值、市场情绪”等因素适当小幅调整股票仓位，但不频繁择时。另外，在可能的情况下积极参与网下新股申购等投资以增强收益。

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 4.13%，同期业绩比较基准收益率为 5.11%；中信保诚红利精选 C 份额净值增长率为 4.03%，同期业绩比较基准收益率为 5.11%。

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(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 | 253,812,385.36 | 87.96 |
| | 其中：股票 | 253,812,385.36 | 87.96 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 12,136,000.00 | 4.21 |
| | 其中：债券 | 12,136,000.00 | 4.21 |
| | 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 | 22,112,137.41 | 7.66 |
| 8 | 其他资产 | 492,813.69 | 0.17 |
| 9 | 合计 | 288,553,336.46 | 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 | 1,637,856.00 | 0.57 |
| B | 采矿业 | 6,077,266.00 | 2.13 |
| C | 制造业 | 123,402,523.67 | 43.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,696,486.68 | 4.09 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 6,350,837.82 | 2.22 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 19,808,415.00 | 6.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,996,415.87 | 0.70 |
| J | 金融业 | 53,963,231.00 | 18.88 |
| K | 房地产业 | 25,457,601.30 | 8.91 |
| 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 | 3,421,752.02 | 1.20 |
| 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 | 253,812,385.36 | 88.79 |

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 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 | 000002 | 万科A | 414,600 | 12,438,000.00 | 4.35 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 6,100 | 12,254,900.00 | 4.29 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 148,000 | 12,170,040.00 | 4.26 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 544,424 | 11,672,450.56 | 4.08 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 788,300 | 11,217,509.00 | 3.92 |
| 6 | 600377 | 宁沪高速 | 1,056,300 | 10,510,185.00 | 3.68 |
| 7 | 600585 | 海螺水泥 | 192,900 | 9,880,338.00 | 3.46 |
| 8 | 600612 | 老凤祥 | 170,600 | 9,466,594.00 | 3.31 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 168,600 | 8,615,460.00 | 3.01 |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 79,500 | 8,395,200.00 | 2.94 |

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 | 11,996,400.00 | 4.20 |
| 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） | 139,600.00 | 0.05 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 12,136,000.00 | 4.25 |

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 | 019640 | 20 国债 10 | 120,000 | 11,996,400.00 | 4.20 |
| 2 | 123107 | 温氏转债 | 1,396 | 139,600.00 | 0.05 |

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 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| | | | | | |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 230,604.72 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -231,886.27 |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《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被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

招商银行股份有限公司于 2020 年 9 月 29 日、2020 年 11 月 27 日分别收到国家外汇管理局深圳市分局的 2 份处罚（深外管检[2020]76 号、深外管检（2020）92 号），因违反外汇市场交易管理被责令改正、处以罚款人民币 120 万元，对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分；因违反规定办理结汇、售汇被责令改正、处以罚款人民币 55 万元，没收违法所得 129 万元人民币。

对“招商银行”投资决策程序的说明：本基金管理人对招商银行是依据该等公司的行业地位、竞争优势、业绩增长和估值综合分析而得出的决策，本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该等投资标的，我们认为，该处罚事项未对招商银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响，我们对该等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。

5.11.2 声明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 | 76,343.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | 173,459.92 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 186,018.67 |
| 5 | 应收申购款 | 56,991.31 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 9 | 合计 | 492,813.69 |
|---|----|------------|

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 | 132,104,619.44 | 229,599,061.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 7,404,253.34 | 76,349,005.26 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 88,958,166.51 | 161,965,578.07 |
| 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 | 50,550,706.27 | 143,982,488.35 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 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

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。

中信保诚基金管理有限公司
2021 年 04 月 21 日