

# 中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 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：2021 年 10 月 27 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 2021 年 10 月 26 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 07 月 01 日起至 2021 年 09 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 | 184,156,815.74 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%。<br>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 | 183,353,513.39 份  | 803,302.35 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 (2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 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      | 7,704,795.09                            | 1,790.91                |
| 2. 本期利润         | -8,118,525.50                           | -28,385.73              |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0428                                 | -0.0831                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 200,814,183.78                          | 879,478.64              |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0952                                  | 1.0948                  |

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

中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) A

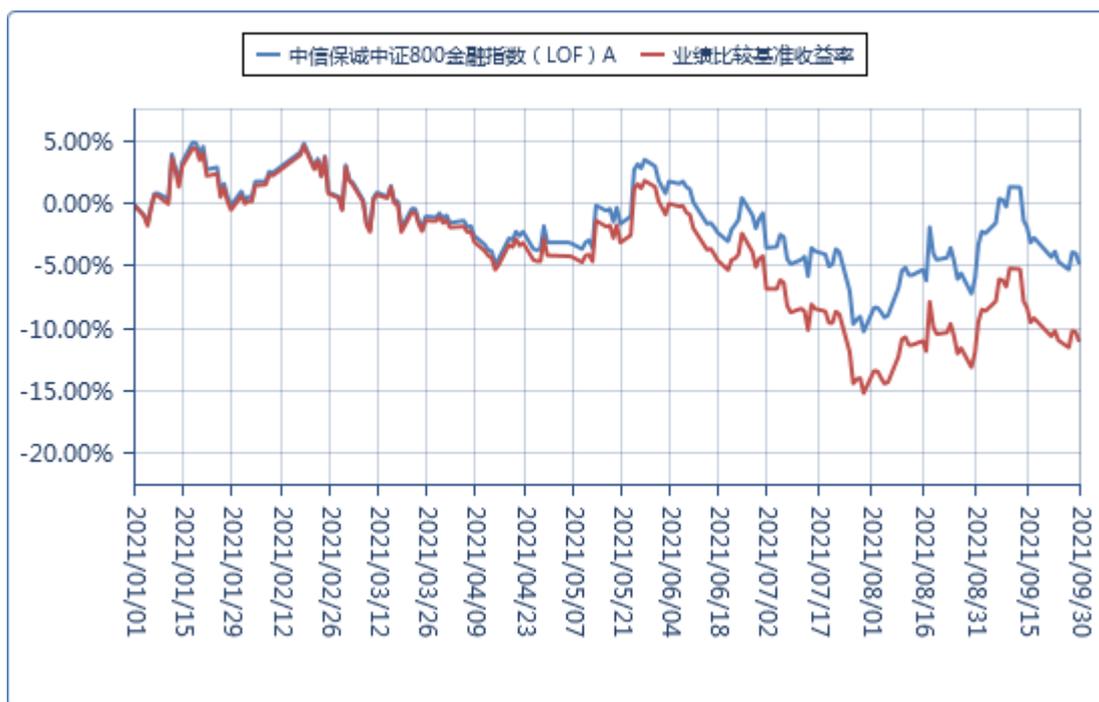
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -3.68%     | 1.41%         | -6.93%         | 1.41%                 | 3.25% | 0.00%  |
| 过去六个月          | -3.68%     | 1.24%         | -9.64%         | 1.24%                 | 5.96% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起<br>至今 | -4.77%     | 1.25%         | -10.98%        | 1.26%                 | 6.21% | -0.01% |

中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C

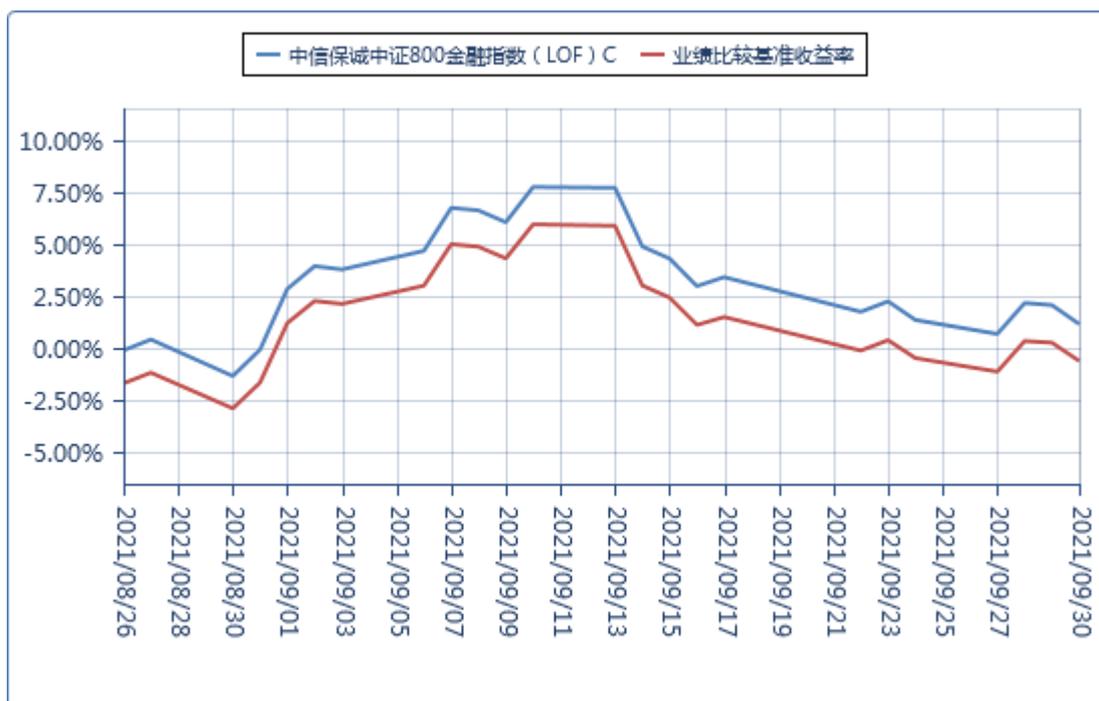
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 1.26%      | 1.28%         | -0.51%         | 1.33%                 | 1.77% | -0.05% |

#### 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

中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) A



中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C



注：1、本基金转型日期为 2021 年 01 月 01 日，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

2、本基金于 2021 年 8 月 26 日起新增 C 类份额。

## § 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明   |
|------------|---------------------|----------------------|------|------------|--|
|            |                     | 任职日期                 | 离任日期 |            |  |
| HAN YILING | 本基金基金经理、量化二<br>部副总监 | 2018 年 04<br>月 10 日  | -    | 7          | HAN YILING 先生, 计算<br>机学硕士、信息技术硕<br>士。曾任职于澳大利亚<br>国立信息通信技术研究<br>院, 担任研究员; 于中<br>信保诚基金管理有限公司, 担任量化投资部金<br>融工程师; 于华宝兴业<br>基金管理有限公司, 担<br>任量化部投资经理。<br>2016 年 6 月重新加入中<br>信保诚基金管理有限公司, 历任投资经理、基<br>金经理助理。现任量化<br>二部副总监, 中信保诚<br>沪深 300 指数型证券投<br>资基金 (LOF)、中信保<br>诚中证 800 金融指数型<br>证券投资基金 (LOF) 的<br>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 金融指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《中信保诚中证 800 金融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 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

三季度行业风格变化比较快。前期涨幅较大的周期板块在三季度末开始回调。高科技板块包括医药生物、电子、计算机等表现较弱。整体上中国经济景气度下滑。制造业 PMI 连续走低且在 9 月份跌破荣枯线。但目前出口仍受益于海外强需求与供给不足，处于较高水平。政策方面，三季度仍以解决“碳中和”、“人口问题”为主。教育政策与环保政策明显转向，需注意风险和投资机会。目前疫情在趋势上趋于缓和，需注意全球供应链复苏引起国内产能过剩。

海外方面，大国博弈局面虽未见缓和，但中美间已展开对话。预期在四季度会在一些领域达成共识。美欧 PMI 均处于下降趋势，但仍高于荣枯水平。

策略角度来看，国内复工复产稳步进行，出口数据较好，短期不需要太担心经济的状况。长期来看银行有低估值机会，同时基本面没有太大扰动，具有配置价值。券商基本面最好，两市成交额接连破万亿，利好券商，估值角度来看券商也并未被高估。保险行业受制于保费数据一直不及预期，市场情绪较为悲观，当下估值已反应未来几年相对悲观的盈利预期，处于超跌状态，长期来看也具有配置价值。金融板块建议关注盈利能力高，估值低的龙头企业。

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，以提高基金净值。

展望未来,总体来说我们更加看好估值处于合理区间的行业龙头。从疫情中复工是中国相对世界其他国家更具确定性的情况,因此全球资本流入是大势所趋。风险在于中美的大国博弈或能产生对中国较为负面的影响。

从行业角度看,我们持续看好消费、医药以及电子科技对股市的带动作用,同时会关注低估值行业的中短期回暖,比如金融板块中的非银板块,以及周期性。对于科创板以及未来创业板的改革抱有正向预期,未来将长期持有在科创板及创业板上市的科技龙头企业。对于周期性板块的短期上涨行情持谨慎态度。

我们坚持以“价值”作为投资,看好未来在各行业聚集效用,做价值股的长期投资。

#### 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-3.68%,同期业绩比较基准收益率为-6.93%;中信保诚中证 800 金融指数 (LOF) C 份额净值增长率为 1.26%,同期业绩比较基准收益率为-0.51%。

#### 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              | 190,762,903.04 | 94.24         |
|    | 其中:股票             | 190,762,903.04 | 94.24         |
| 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      | 11,237,307.11  | 5.55          |
| 8  | 其他资产              | 422,486.33     | 0.21          |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 202,422,696.48 | 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 | -              | -             |
| 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              | 190,087,428.18 | 94.25         |
| 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               | 190,087,428.18 | 94.25         |

### 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              | 675,474.86 | 0.33          |
| 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              | -          | -    |
|   | 合计              | 675,474.86 | 0.33 |

### 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 报告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  | 600036 | 招商银行 | 472,880   | 23,856,796.00 | 11.83         |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 413,833   | 20,012,963.88 | 9.92          |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 316,244   | 10,869,306.28 | 5.39          |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 555,556   | 10,166,674.80 | 5.04          |
| 5  | 600030 | 中信证券 | 325,750   | 8,234,960.00  | 4.08          |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 371,350   | 6,658,305.50  | 3.30          |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 1,340,872 | 6,248,463.52  | 3.10          |
| 8  | 002142 | 宁波银行 | 137,727   | 4,841,104.05  | 2.40          |
| 9  | 601328 | 交通银行 | 1,049,692 | 4,723,614.00  | 2.34          |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 368,890   | 4,478,324.60  | 2.22          |

### 5.3.2 报告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  | 688778 | 厦钨新能 | 2,190  | 176,316.90 | 0.09          |
| 2  | 688660 | 电气风电 | 10,930 | 127,006.60 | 0.06          |
| 3  | 688305 | 科德数控 | 1,496  | 104,375.92 | 0.05          |

|   |        |      |       |           |      |
|---|--------|------|-------|-----------|------|
| 4 | 688766 | 普冉股份 | 336   | 81,086.88 | 0.04 |
| 5 | 688718 | 唯赛勃  | 3,145 | 58,088.15 | 0.03 |

#### 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

招商银行股份有限公司分别于 2020 年 11 月 27 日、2021 年 5 月 17 日分别受到国家外汇管理局深圳市分局、中国银行保险监督管理委员会处罚（深外管检（2020）92 号、银保监罚决字（2021）16 号）。

兴业银行股份有限公司于 2021 年 7 月 21 日、2021 年 8 月 13 日分别受到国家外汇管理局福建省分局、中国人民银行处罚（闽汇罚（2021）5 号、银罚字（2021）26 号）。

平安银行股份有限公司分别于 2020 年 10 月 16 日、2021 年 5 月 28 日、2021 年 9 月 29 日收到宁波银保监局、中国银保监会云南监管局、国家外汇管理局深圳市分局处罚（甬银保监罚决字（2020）66 号、云银保监罚决字（2021）34 号、深外管检[2021]40 号）。

中国工商银行股份有限公司于 2020 年 11 月 6 日、2020 年 11 月 10 日、2020 年 12 月 25 日分别受到中国人民银行衡水市中心支行、国家外汇管理局北京外汇管理部、中国银行保险监督管理委员会处罚（衡银罚字[2020]第 1 号、京汇罚（2020）31 号、银保监罚决字（2020）71 号）。

宁波银行股份有限公司于 2020 年 10 月 16 日、2021 年 6 月 10 日、2021 年 7 月 13 日、2021 年 7 月 30 日分别受到宁波银保监局、中国人民银行宁波市中心支行、国家外汇管理局宁波市分局处罚（甬银保监罚决字（2020）48 号、甬银保监罚决字（2021）36 号、甬外管罚（2021）7 号、甬银处罚字（2021）2 号、甬银保监罚决字（2021）57 号）。

交通银行股份有限公司于 2021 年 8 月 13 日受到中国人民银行处罚（银罚字（2021）23 号）。

中信证券股份有限公司于 2020 年 10 月 27 日、2021 年 1 月 23 日分别收到中国证监会、深圳证监局《关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》、《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》。

对“招商银行”，“兴业银行”、“中信证券”、“平安银行”、“工商银行”、“宁波银行”和“交通银行”

的投资决策程序的说明:招商银行、中信证券、兴业银行、平安银行、工商银行、宁波银行和交通银行均为中证 800 金融指数的成分股。这些公司分别于 2020 至 2021 年间发生的违规事件受到监管部门处罚。基金经理对事件的影响做了分析后认为, 此类类型的处罚事件不会对公司的企业经营和投资价值产生太大的影响; 另外, 根据量化模型, 基金经理也控制了其在投资组合中的占比, 防止意外风险发生。因此我们认为投资策略没有决策性问题。

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 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   | 11,707.36  |
| 2  | 应收证券清算款 | 145,471.64 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 1,052.94   |
| 5  | 应收申购款   | 250,512.72 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | 13,741.67  |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 422,486.33 |

### 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

#### 5.11.5.1 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

| 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  | 688778 | 厦钨新能 | 176,316.90  | 0.09          | 锁定期股票    |
| 2  | 688660 | 电气风电 | 127,006.60  | 0.06          | 锁定期股票    |
| 3  | 688305 | 科德数控 | 104,375.92  | 0.05          | 锁定期股票    |
| 4  | 688766 | 普冉股份 | 81,086.88   | 0.04          | 锁定期股票    |
| 5  | 688718 | 唯赛勃  | 58,088.15   | 0.03          | 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                | 197,332,125.58          | -                       |
| 报告期期间基金总申购份额               | 12,769,921.84           | 1,262,273.64            |
| 减：报告期期间基金总赎回份额             | 26,748,534.03           | 458,971.29              |
| 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                | 183,353,513.39          | 803,302.35              |

## § 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

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的公告》，自 2021 年 8 月 26 日起，中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF) 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、托管协议、招募说明书等相关法律文件进行修订。

## § 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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2021 年 10 月 27 日