

中信保诚中证 800 有色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 有色指数 (LOF)
场内简称	有色 LOF
基金主代码	165520
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	1,242,945,344.61 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 有色金属指数的有效跟踪,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 有色金属指数收益率+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 有色指数 (LOF) A	中信保诚中证 800 有色指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	有色 LOF	-
下属分级基金的交易代码	165520	013081
报告期末下属分级基金的份额总额	1,212,667,495.00 份	30,277,849.61 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 有色指数 (LOF) A	中信保诚中证 800 有色指数 (LOF) C
1. 本期已实现收益	189,935,189.76	274,053.92
2. 本期利润	289,732,331.10	-7,811,201.44
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2858	-0.6903
4. 期末基金资产净值	2,277,611,696.92	56,856,008.43
5. 期末基金份额净值	1.8782	1.8778

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 有色指数 (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	24.47%	2.72%	21.96%	2.77%	2.51%	-0.05%
过去六个月	38.92%	2.35%	35.11%	2.39%	3.81%	-0.04%
自基金合同生效起 至今	44.81%	2.56%	38.49%	2.62%	6.32%	-0.06%

中信保诚中证 800 有色指数 (LOF) C

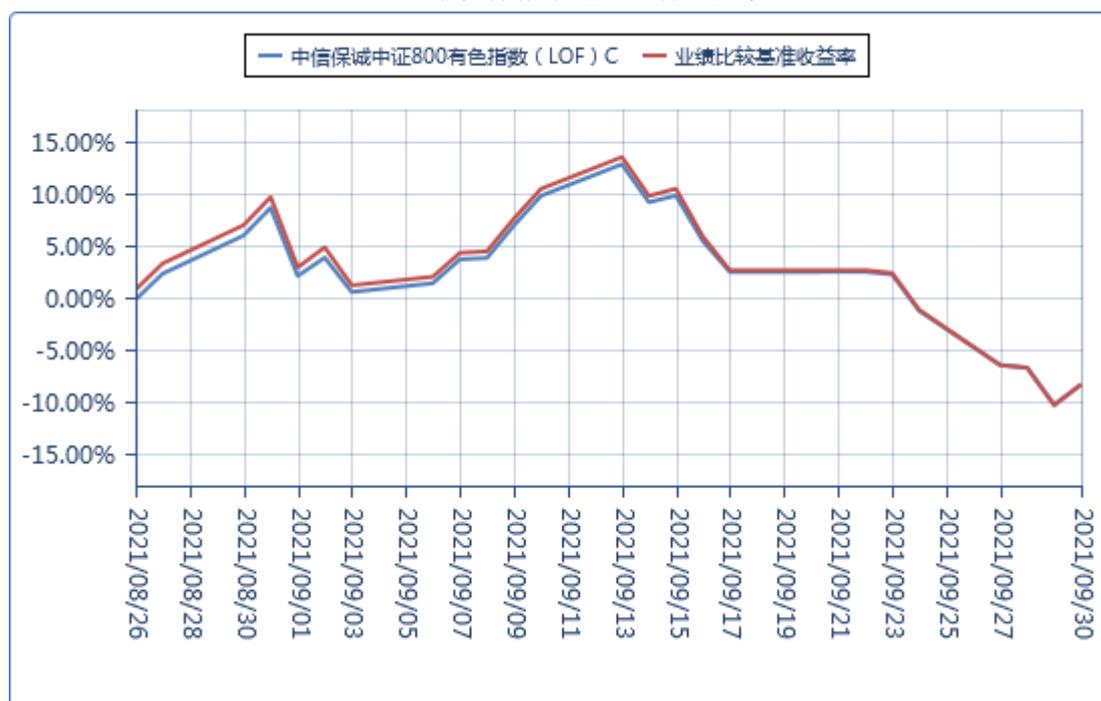
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起 至今	-8.11%	2.91%	-8.11%	2.98%	0.00%	-0.07%

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 有色指数 (LOF) A



中信保诚中证 800 有色指数 (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 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄稚	基金经理	2019 年 09 月 04 日	-	10	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)、信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)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金 (LOF) 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《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 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《中信保诚中证 800 有色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

回顾 2021 年三季度，全球经济延续复苏，但部分国家和地区的疫情仍然较为严峻。国内经济数据超预期回落，极端天气、疫情反复、大宗价格高位等因素拖累工业生产，国内经济下行压力较大。从中报上看，企业盈利复苏较为强劲，中小市值公司业绩加速复苏。在资金存量博弈环境下，A 股市场维持震荡格局。

报告期内，A 股总体维持震荡，成交量较前期有所上升，小盘股表现优于大盘股。上证指数下跌-0.64%，沪深 300 下跌-6.85%，中证 500 上涨 4.34%，创业板指下跌-6.69%，其中采掘、公用事业、有色金属、钢铁、化工等行业涨幅居前，而医药生物、休闲服务、食品饮料、传媒、家用电器等行业表现较差。

本基金跟踪的标的指数为中证 800 有色金属指数。报告期内，本基金坚持既定的指数化投资策略，原则上按照标的指数中成分股组成及其权重构建股票投资组合，实现对标的指数的有效跟踪。本基金认真应对投资者日常申购、赎回，根据市场情况、成分股停牌等合理安排权益仓位和头寸，有效管理跟踪误差。

本基金积极参与网下新股申购, 以提高基金收益。

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 有色指数 (LOF) A 份额净值增长率为 24.47%, 同期业绩比较基准收益率为 21.96%; 中信保诚中证 800 有色指数 (LOF) C 份额净值增长率为-8.11%, 同期业绩比较基准收益率为-8.11%。

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	2,174,518,838.05	89.96
	其中: 股票	2,174,518,838.05	89.96
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	133,886,750.65	5.54
8	其他资产	108,885,327.64	4.50
9	合计	2,417,290,916.34	100.00

注: 本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 320,113,207.00 元, 占基金资产净值比例为 13.71%。

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	687,544,612.86	29.45
C	制造业	1,454,475,803.30	62.30
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	27,756,709.58	1.19
	合计	2,169,777,125.74	92.95

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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,540,361.68	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	70,022.52	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,992.83	0.00
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	19,443.64	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.00

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,707.31	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,741,712.31	0.20

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	002460	赣锋锂业	1,731,995	282,211,265.30	12.09
2	601899	紫金矿业	24,913,500	251,377,215.00	10.77
3	600111	北方稀土	4,693,058	207,761,677.66	8.90
4	603799	华友钴业	1,827,919	189,006,824.60	8.10
5	601600	中国铝业	14,098,765	109,265,428.75	4.68
6	603993	洛阳钼业	15,213,515	91,889,630.60	3.94
7	600547	山东黄金	3,890,848	76,299,529.28	3.27
8	600219	南山铝业	15,437,394	67,461,411.78	2.89
9	000630	铜陵有色	15,864,195	62,029,002.45	2.66
10	000807	云铝股份	4,043,800	59,969,554.00	2.57

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	688303	大全能源	44,168	2,402,297.52	0.10
2	688499	利元亨	2,149	376,526.29	0.02
3	688789	宏华数科	1,400	237,650.00	0.01
4	688670	金迪克	2,310	199,029.60	0.01
5	688772	珠海冠宇	12,960	187,012.80	0.01

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

浙江华友钴业股份有限公司于 2020 年 12 月 30 日受到中国证券监督管理委员会浙江监管局下发的《关于对浙江华友钴业股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2020]110 号)。

对“华友钴业”投资决策程序的说明：本基金跟踪的标的指数为中证 800 有色金属指数，华友钴业属于该指数成分股，本基金对于该证券是按照标的指数成分股进行相应投资的，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 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	197,080.73
2	应收证券清算款	35,224,296.63
3	应收股利	-
4	应收利息	115,843.97
5	应收申购款	73,334,364.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	13,741.67
8	其他	-
9	合计	108,885,327.64

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

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600111	北方稀土	44,827,802.00	1.92	转融通流通受限
2	002460	赣锋锂业	36,123,798.00	1.55	转融通流通受限
3	603799	华友钴业	26,511,760.00	1.14	转融通流通受限
4	601600	中国铝业	17,978,450.00	0.77	转融通流通受限
5	000630	铜陵有色	14,626,528.00	0.63	转融通流通受限
6	000807	云铝股份	12,887,270.00	0.55	转融通流通受限
7	603993	洛阳钼业	11,473,584.00	0.49	转融通流通受限
8	600219	南山铝业	8,178,018.00	0.35	转融通流通受限
9	600547	山东黄金	1,806,081.00	0.08	转融通流通受限
10	601899	紫金矿业	168,503.00	0.01	转融通流通受限

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	688303	大全能源	2,402,297.52	0.10	锁定期股票
2	688499	利元亨	376,526.29	0.02	锁定期股票
3	688789	宏华数科	237,650.00	0.01	锁定期股票
4	688670	金迪克	199,029.60	0.01	锁定期股票
5	688772	珠海冠宇	187,012.80	0.01	新发未上市

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 有色指数 (LOF) A	中信保诚中证 800 有色指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	1,174,119,706.77	-
报告期期间基金总申购份额	2,063,840,361.71	41,354,717.42
减：报告期期间基金总赎回份额	2,025,292,573.48	11,076,867.81
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	1,212,667,495.00	30,277,849.61
-------------	------------------	---------------

§ 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部分条款的公告》，本基金自 2021 年 8 月 26 日起增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并对基金合同和托管协议的相关条款进行修订，同时对托管协议其他条款进行修订。招募说明书及基金产品资料概要相应更新。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、信诚中证 800 有色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、(原)信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同
- 4、(原)信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书
- 5、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 6、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书
- 7、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 10 月 27 日