中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划

季度报告

2018 年第 3 季度报告

第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中信银行股份有限公司于 **2018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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划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集合资产管理计划说明书。

本报告期自**2018年7月1日**起至**9月30日**止。

第二节 集合资产管理计划概况

名称：	中信证券沪港深1号集合资产管理计划
类型：	小集合
成立日：	2017 年 1 月 5 日
报告期末份额总额：	47,416,524.40
投资目标：	本集合计划同时投资A股和“港股通”股票，通过积极的资产配置在不同类型投资品种之间灵活重点配置，尤其是深入挖掘各种折价和套利机会，并可通过股指期货灵活对冲风险，力求在不同的市场环境下实现集合计划资产的长期稳定增值
投资理念：	本集合计划通过投资权益类金融产品、固定收益类金融产品和现金类资产等，同时通过港股通投资港股，深入挖掘各种折价和套利机会，追求集合计划资产的长期稳定增值
投资基准：	无

管理人：　　中信证券股份有限公司
托管人：　　中信银行股份有限公司
注册登记机构：　　中信证券股份有限公司

第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

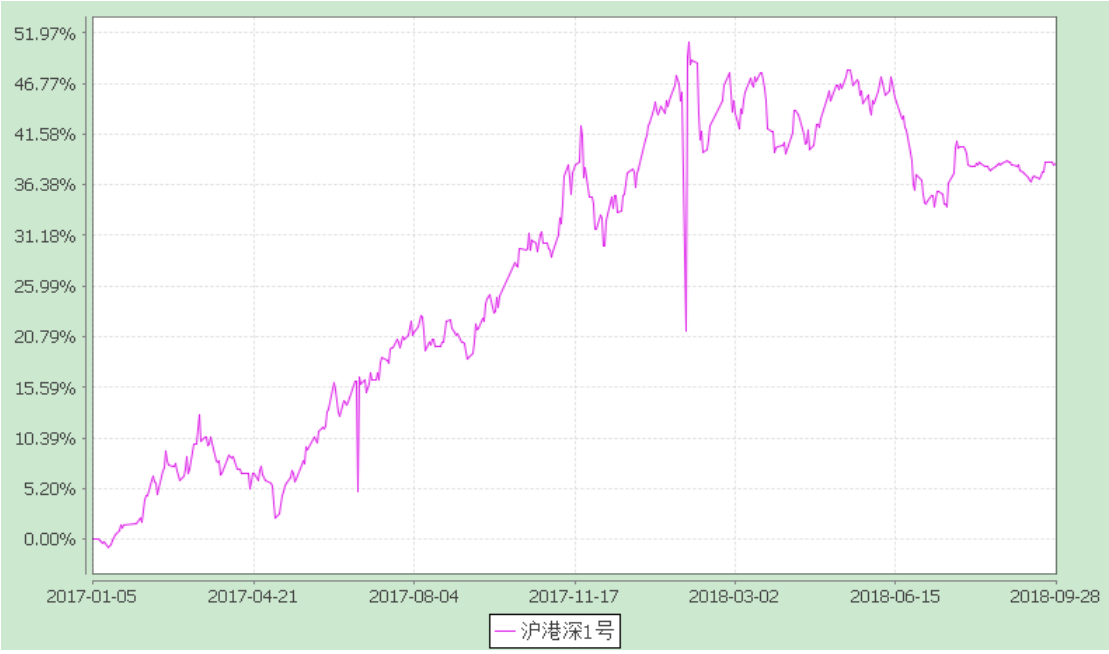
一、主要财务指标（单位：人民币元）

1. 本期利润	377,187.21
2. 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-344,580.58
3. 加权平均每份额本期已实现净收益	-0.0069
4. 期末资产净值	48,229,875.35
5. 期末每份额净值	1.0170
6. 期末每份额累计净值	1.3240

二、本期每份额净值增长率与投资基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	投资基准收益率②	①-②
这三个月	0.79%	0.00%	0.79%

三、集合计划累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



第四节 管理人报告

一、业绩表现

截至2018年09月30日，本集合计划单位净值1.0170元，累计单位净值1.3240元，本期集合计划收益率增长0.79%。

二、投资主办人简介

盛明，男，康奈尔大学金融工程硕士，CFA。2011年加入中信证券，历任产品经理、投资经理。曾参与设计中信证券资产管理业务首支分级产品、开发并管理汇率套利策略系列产品。现任跨境业务投资经理。

三、投资主办人工作报告

1、市场回顾和投资操作

三季度，市场基本呈现震荡走势。账户维持仓位水平稳定，结构略有调整，整体持仓更加分散。

2、市场展望和投资策略

大市难有系统性行情，因此策略上以防风险为主，压低仓位，分散持股。A股在2700点附件有资金入场迹象，但是港股没有观察到类似现象。在低迷的行情中，发生阶段性反弹的概率越来越大。

四、风险控制报告

中信证券针对本集合计划的运作特点，通过每日的风险监控工作以及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，并提醒投资主办人采取相应的风险规避措施，确保集合计划合法合规、正常运行。同时，本集合计划通过完善的风险指标体系和定期进行的风险状况分析，及时评估集合计划运作过程中面临的各种风险，为投资决策提供风险分析支持，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致，以实现本集合计划追求中长期内资本增值的投资目标。在本报告期内，本集合计划运作合法合规，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的行为。

第五节 投资组合报告

一、资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例

股　票	12,261,087.00	24.60%
债　券	3,162,124.35	6.34%
基　金	25,021,822.12	50.20%
银行存款及清算备付金合计	9,365,784.36	18.79%
其他资产	28,931.08	0.06%
其中：资产支持证券	0.00	0.00%
其中：信托计划	0.00	0.00%
其中：买入返售金融资产	0.00	0.00%
合　计	49,839,748.91	100.00%

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	代码	名称	数量	市　值（元）	占净值比例
1	01398	工商银行	666,000.00	3,349,980.00	6.95%
2	601211	国泰君安	96,900.00	1,452,531.00	3.01%
3	02208	金风科技	179,420.00	1,327,708.00	2.75%
4	00753	中国国航	144,000.00	957,600.00	1.99%
5	06837	海通证券	144,800.00	906,448.00	1.88%
6	300122	智飞生物	10,900.00	533,664.00	1.11%
7	600028	中国石化	69,800.00	496,976.00	1.03%
8	00175	吉利汽车	36,000.00	494,280.00	1.02%
9	002594	比亚迪	9,900.00	486,090.00	1.01%
10	01336	新华保险	14,600.00	482,384.00	1.00%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	代码	名称	数量	市　值（元）	占净值比例
1	123004	铁汉转债	34,650.00	3,162,124.35	6.56%

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

序号	代码	名称	数量	市　值（元）	占净值比例
1	519888	汇添富收	2,502,182,	25,021,822.1	51.88%

		益快线货币市场基金	212.00	2	

五、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本基金报告期末未持有权证

六、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	52,517,377.21
报告期间总参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	5,100,852.81
报告期末份额总额	47,416,524.40

第七节 重要事项提示

一、本集合计划管理人相关事项

1、 本集合计划管理人在本报告期内没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。

2、 本集合计划管理人办公地址未发生变更。

3、 本集合计划的管理人高级管理人员没有受到任何处罚。

二、本集合计划相关事项

2018-08-13 关于中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划增加临时赎回开放日的公告

2018-08-07 关于更换中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划投资主办人的公告

第八节 信息披露的查阅方式

网址：www.cs.ecitic.com

热线电话：95548

中信证券股份有限公司

2018 年 10 月 26 日