# 中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划
# 2018 年年度报告

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

送出日期：2019 年 3 月 29 日

# 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 **2019** 年 **3** 月 **29** 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 **1** 月 **1** 日起至 **12** 月 **31** 日止。

# 一、集合资产管理计划概况

**1、基本资料**

| | |
|---|---|
| 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： | 41,880,758.92 |
| 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 |

**2、管理人**

| | |
|---|---|
| 名称： | 中信证券股份有限公司 |
| 注册地址： | 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 |
| 办公地址： | 北京朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层 |
| 法定代表人： | 张佑君 |
| 联系地址： | www.cs.ecitic.com |
| 联系电话： | 95548 |
| 传真： | (010) 60836627 |

网址： www.cs.ecitic.com

**3、托管人**

名称： 中信银行股份有限公司

办公地址： 北京东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人： 李庆萍

托管部门联系人： 方韡

联系电话： 4006800000

传真： 010-85230024

**4、注册登记机构**

名称： 中信证券股份有限公司

办公地址： 北京朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层

网址： www.cs.ecitic.com

**5、会计师事务所和经办注册会计师**

名称： 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所

地址： 北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 26 层

主要负责人： 周星

项目合伙人： 姜昆

联系电话： 86 (10) 6533 2342

传真： 86 (10) 6533 8800

## 二、主要财务指标、集合资产管理计划净值表现及收益分配情况

**1、主要财务指标（单位：人民币元）**

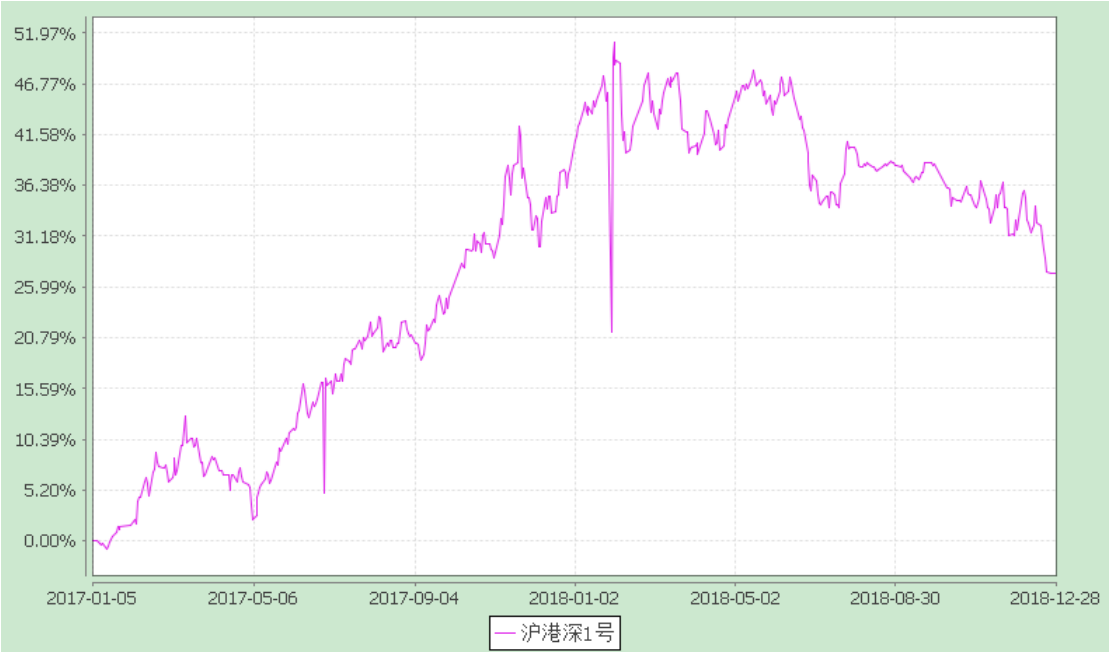
| | |
|---|---|
| 本期利润 | -4,970,210.02 |
| 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | -871,072.31 |
| 加权平均每份额本期已实现净收益 | -0.0189 |
| 期末资产净值 | 39,162,253.41 |

| | |
|---|---|
| 期末每份额净值 | 0.9350 |
| 期末每份额累计净值 | 1.2420 |

**2、本集合计划历史各时间段净值增长率与投资基准收益率的比较**

| 阶段 | 净值增长率① | 投资基准收益率② | ① -② |
|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -8.06% | 0.00% | -8.06% |
| 过去六个月 | -7.30% | 0.00% | -7.30% |
| 过去一年 | -11.53% | 0.00% | -11.53% |
| 合同生效日至今 | 22.44% | 0.00% | 22.44% |

**3、集合计划累计每份额净值增长率与投资基准收益率的历史走势对比图**




**4、集合计划收益分配情况**

| 分红登记日 | 收益分配方案 |
|---|---|
| 2018-01-30 | 0.207 |

## 三、管理人报告

**1、投资结果**

截至 2018 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 0.935 元，累计单位净值 1.242 元，本期集合计划收益率增长-7.67%。

**2、投资主办人简介**

胡淼，男，加拿大英属哥伦比亚大学理学学士，2011 年研究生毕业于芝加哥大学金融数学专业，2011-2012 年在美国 CAI Research 担任数理分析师，负责外汇交易策略的开发和执行，2013-2014 年就职于华泰资产负责公司产品绩效归因方面工作，2014 年至今就职于中信证券资产管理部。

**3、投资主办人工作报告**

**1）市场回顾和投资操作**

2018 年市场先扬后抑，账户较好的管理了风险敞口，控制了回撤。

**2）市场展望和投资策略**

2019 年，伴随政策呵护，市场情绪有望修复。账户将积极参与市场行情，兼顾周期、消费、科技行业机会。

**4、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。

## 四、投资组合报告

**1、报告期末资产组合情况**

| 项目名称 | 项目市值（元） | 占总资产比例 |
|---|---|---|
| 股　票 | 2,461,318.40 | 6.01% |
| 债　券 | 0.00 | 0.00% |
| 基　金 | 4,215,058.23 | 10.29% |

| | | |
|---|---|---|
| 银行存款及清算备付金合计 | 3,573,029.56 | 8.73% |
| 其他资产 | 30,701,719.75 | 74.97% |
| 其中：资产支持证券 | 0.00 | 0.00% |
| 合　计 | 40,951,125.94 | 100.00% |

**2、报告期末按券种分类的债券投资组合**

| 项目名称 | 市 值（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|
| 国　债 | - | - |
| 金融债 | - | - |
| 企业债 | - | - |
| 可转债 | - | - |
| 中期票据 | - | - |
| 合　计 | - | - |

**3、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名债券明细**

本基金报告期末未持有债券

**4、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名股票明细**

| 序号 | 代码 | 名称 | 数量 | 市 值（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 00753 | 中国国航 | 144,000.00 | 843,840.00 | 2.15% |
| 2 | 03380 | 龙光地产 | 74,000.00 | 617,160.00 | 1.58% |
| 3 | 00817 | 中国金茂 | 188,000.00 | 569,640.00 | 1.45% |
| 4 | 00175 | 吉利汽车 | 36,000.00 | 430,560.00 | 1.10% |
| 5 | 02208 | 金风科技 | 20.00 | 118.40 | 0.00% |

**5、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细**

本基金报告期末未持有资产支持证券

**6、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名基金明细**

| 序号 | 代码 | 名称 | 数量 | 市 值（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 519888 | 汇添富收益快线货币市场基金 | 421,505,823.00 | 4,215,058.23 | 10.76% |

**7、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名权证明细**

本基金报告期末未持有权证

**8、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。

期末持有的处于转股期的可转换债券明细：

无

## 五、集合计划份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 期初份额总额 | 34,327,004.24 |
| 报告期间总参与份额 | 28,295,841.13 |
| 红利再投资份额 | 819,452.49 |
| 报告期间总退出份额 | 21,561,538.94 |
| 报告期末份额总额 | 41,880,758.92 |

## 六、重要事项提示

**一、本集合计划管理人及托管人相关事项**

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**

2018-02-01 关于中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划增加临时开放日的公告

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

2018-03-27 关于中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划开放期安排公告

2018-01-26 中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划第二次分红公告

2018-06-29 关于中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划暂停申购的公告

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

## 七、备查文件目录

1、中国证监会批准设立中信证券“沪港深 1 号”集合资产管理计划的文件

2、《中信证券“沪港深 1 号”集合资产管理计划说明书》

3、《中信证券“沪港深 1 号”集合资产管理计划资产管理合同》

4、《中信证券“沪港深 1 号”集合资产管理计划托管协议》

5、管理人业务资格批件、营业执照

6、中信证券“沪港深 1 号”集合资产管理计划《验资报告》

7、中信证券“沪港深 1 号”集合资产管理计划审计报告

8、报告期内披露的各项公告

查阅网址：www.cs.ecitic.com

热线电话：95548

中信证券股份有限公司

2019 年 3 月 29 日