

中信证券新智能 1 号集合资产管理计划

2019 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：2020 年 4 月 30 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 2020 年 4 月 24 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。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

目 录

一、集合资产管理计划概况.....	4
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.....	6
三、管理人报告.....	7
四、投资组合报告.....	9
五、集合计划份额变动.....	12
六、重要事项提示.....	13
七、备查文件目录.....	14

一、集合资产管理计划概况

1、基本资料

名称:	中信证券新智能 1 号集合资产管理计划
类型:	小集合
成立日:	2018 年 1 月 30 日
报告期末份额总额:	42,500,800.00
投资目标:	在控制风险的前提下, 尽量通过选股获取阿尔法收益, 秉承绝对收益理念追求本集合计划资产的稳定增值。
投资理念:	本集合计划通过有效率的买入股票, 积极主动地去争取实现自己的股东利益或投资收益, 在适当的时候, 积极行动买入相当份额的股票, 充分履行股东权利, 从而影响公司决策, 改善公司运营情况来提升其市场价值, 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	8,260,257.45
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	4,629,871.09
加权平均每份额本期已实现净收益	0.0605
期末资产净值	43,323,871.21
期末每份额净值	1.0190
期末每份额累计净值	1.0190

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	4.62%	0.00%	4.62%
过去六个月	5.93%	0.00%	5.93%
过去一年	11.49%	0.00%	11.49%
合同生效日至今	1.90%	0.00%	1.90%

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

本集合计划报告期内无分红

三、管理人报告

1、投资结果

截至 2019 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.019 元，累计单位净值 1.019 元，本期集合计划收益率增长 11.49%。

2、投资主办人简介

李品科，女，清华大学，工学硕士。2008 年加入国泰君安证券，任房地产分析师，曾获得 6 次新财富房地产最佳分析师第一名；2016 年加入中信证券，现任总监职级及资产管理业务权益投资经理。

3、投资主办人工作报告

1) 市场回顾和投资操作

在经过 2018 年市场的全面下行后，2019 市场迎来了修复。国内降准，资金面较为宽松，房地产市场呈现出较强韧性，同时 MSCI 扩容，中美贸易谈判稳步推进提升了市场的风险偏好。所有重要指数都出现较大涨幅，各指数表现相差无明显差异，显示出市场的整体复苏。领涨行业为电子和食品饮料，体现出成长和消费成为市场重心的特点。

全年来看，上证综指涨幅 22.30%；行业方面，涨幅居前的行业分别为食品饮料、电子和家电。

在账户操作上，由于年初账户安全垫不足，仓位偏低。积极选择中长期有成长性的优质成长个股，进行配置。

2) 市场展望和投资策略

展望 2020 年 1 季度，我们对市场仍保持谨慎乐观。在国内突发疫情影响经济底部盘整时间变长，中美贸易谈判继续，外部环境也在疫情影响下充满一定变数,但全球有望迎来流动性宽松。1 季度预计股指总体仍呈现震荡，市场以结构性机会为主。关注新冠疫情扩散对经济的冲击。

投资策略：由于账户安全垫增加，维持中性偏高仓位，继续优化和调仓结构，从一年维度寻找空间大、估值相对低、质地良好的投资标的。但仍需要关注以下风险：国内外疫情的进展、复工的进度。

本组合计划维持中性偏高仓位，积极选择科技相关优质中长期有成长性的个股，进行配置，配置以电子、计算机、互联网、医药、新能源等科技相关优质个股为主。

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	22,605,727.40	52.00%
债 券	4,020,000.00	9.25%
基 金	8,504,645.10	19.57%
银行存款及清算备付金合计	8,252,825.48	18.99%
其他资产	85,440.59	0.20%
其中：资产支持证券	0.00	0.00%
合 计	43,468,638.57	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	-	-

公司债	4,020,000.00	9.28%
其他债券	-	-
中期票据	-	-
合 计	4,020,000.00	9.28%

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

序号	代码	名称	数量	市 值（元）	占净值比例
1	136448	16 万达 03	20,000.00	2,009,000.00	4.64%
2	136090	15 绿地 02	10,000.00	1,009,500.00	2.33%
3	136535	16 万达 05	10,000.00	1,001,500.00	2.31%

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	600276	恒瑞医药	33,300.00	2,914,416.00	6.73%
2	002384	东山精密	73,200.00	1,694,580.00	3.91%
3	300122	智飞生物	32,000.00	1,589,120.00	3.67%
4	002050	三花智控	74,800.00	1,296,284.00	2.99%
5	002044	美年健康	83,600.00	1,244,804.00	2.87%
6	300750	宁德时代	10,600.00	1,127,840.00	2.60%
7	600438	通威股份	84,300.00	1,106,859.00	2.55%
8	300724	捷佳伟创	28,300.00	1,072,287.00	2.48%
9	00268	金蝶国际	149,000.00	1,041,510.00	2.40%
10	300413	芒果超媒	26,520.00	927,139.20	2.14%

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

本产品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	006449	浙商汇金量化 精选灵活配置 混合型证券投资 基金	3,170,98 3.61	4,214,871.4 1	9.73%
2	519888	汇添富收益快 线货币市场基 金	287,974, 501.00	2,879,745.0 1	6.65%
3	004292	鹏华沪深港互 联网股票型证 券投资基金	786,802. 00	939,913.67	2.17%
4	004138	上银鑫达灵活 配置混合型证 券投资基金	180,820. 20	256,439.21	0.59%
5	393001	中海优势精选 灵活配置混合 型证券投资基金	183,886. 23	213,675.80	0.49%

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

本产品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

9、业绩报酬及费用的计提和支付

	报告期间计提金额（元）	报告期间支付金额（元）
管理费	1,114,396.32	1,172,999.36
托管费	148,586.18	156,399.90
业绩报酬	0.00	0.00

10、所投资资产管理计划发生的费用

项目	报告期间费用（元）
交易费用	54,452.64

11、投资管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品的情况

本产品报告期末未持仓关联方发行的资管产品。

五、集合计划份额变动

一、集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	96,584,468.06
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	54,083,668.06
报告期末份额总额	42,500,800.00

二、关联方持有本集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	999,900.00
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	200,000.00
报告期末份额总额	799,900.00

注：关联方指本公司董事、监事、员工及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方。

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

2019-01-31 关于中信证券新智能 1 号集合资产管理计划恢复申购的公告

2019-07-23 关于中信证券股份有限公司旗下部分集合资产管理计划可投资于科创板股票的公告

2019-07-24 关于中信证券股份有限公司旗下部分拟投资于科创板股票集合资产管理计划增加临时赎回开放期的公告

七、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中信证券“新智能 1 号”集合资产管理计划的文件
- 2、《中信证券“新智能 1 号”集合资产管理计划说明书》
- 3、《中信证券“新智能 1 号”集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《中信证券“新智能 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“新智能 1 号”集合资产管理计划《验资报告》
- 7、中信证券“新智能 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

