中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划
2020 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：2021 年 3 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 **2021** 年 **3** 月 **25** 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 **2020** 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.....5
三、管理人报告.....6
四、投资组合报告.....8
五、集合计划份额变动.....9
六、重要事项提示.....10
七、备查文件目录.....10

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：	23,325,194.42
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	10,198,020.36
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	9,401,142.08
加权平均每份额本期已实现净收益	0.3517
期末资产净值	32,200,005.96
期末每份额净值	1.3805

期末每份额累计净值	1.6875

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	19.71%	0.00%	19.71%
过去六个月	26.12%	0.00%	26.12%
过去一年	41.52%	0.00%	41.52%
合同生效日至今	79.17%	0.00%	79.17%

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 2020 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.3805 元，累计单位净值 1.6875 元，本期集合计划收益率增长 41.52%。

2、投资主办人简介

蔡青,硕士 英国朴茨茅斯大学，金融学硕士。曾任南方基金管理有限公司国际业务部研究员、基金经理助理、基金经理；2018 年加入中信证券股份有限公司，现任资产管理业务投资经理。

3、投资主办人工作报告

1）市场回顾和投资操作

2020 年是非常特殊一年，新冠疫情对全球经济基本面造成了非常沉重的打击。在此基础上，不同制度文化下的不同国家的应对方法出现了明显分化。权益市场曾一度出现了显著的回调，但随着全球央行的超常规宽松货币政策，且全球政府亦实行了积极的财政政策以刺激经济复苏，全球大类资产快速反弹。多重因素共同作用下，2020 年权益市场整体表现显著超预期。

2）市场展望和投资策略

预期 2021 年全球经济将大幅反弹，其中 2021 年上半年在今年低基数背景下有望加速增长。对于国内市场，货币政策和财政政策预计均会边际收紧，但大概率不会大幅转向。预计国内内需和出口将成为重要引擎，经济继续保持高质量增长。而对于海外市场，疫苗进展和后续财政政策将成为影响海外基本面复苏的重要因素，存在一定不确定性。总体来说，盈利加速将成为后续权益市场的重要支柱。

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	25,857,330.55	79.78%
债券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	6,553,455.32	20.22%
其他资产	575.59	0.00%
其中：资产支持证券	0.00	0.00%
合计	32,411,361.46	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	-	-
其他债券	-	-
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

本产品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	01810	小米集团-W	247,400.00	6,897,027.10	21.42%
2	02020	安踏体育	66,000.00	6,811,142.58	21.15%
3	09633	农夫山泉	113,000.00	5,209,246.89	16.18%
4	02269	药明生物	40,500.00	3,496,006.98	10.86%

5	600809	山西汾酒	5,700.00	2,139,153.00	6.64%
6	600031	三一重工	37,300.00	1,304,754.00	4.05%

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

本产品报告期末未持有基金

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	434,249.03	2,477,103.57
托管费	57,899.86	330,280.54
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	4,125.91

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	33,234,506.49
报告期间参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	9,909,312.07
报告期末份额总额	23,325,194.42

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	-
报告期间总参与份额	-
红利再投资份额	-
报告期间总退出份额	-
报告期末份额总额	-

本产品报告期末未持有关联方持仓本集合计划份额。

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

2020-05-08 关于增加中信证券华南股份有限公司为代销机构的公告

2020-08-11 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期的公告

2020-10-19 关于更换中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划投资经理的公告

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

2021 年 3 月 30 日