中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划

季度报告

2021 年第 2 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 **2021年7月19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**2021年4月1日**起至**6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：	14,845,411.10
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

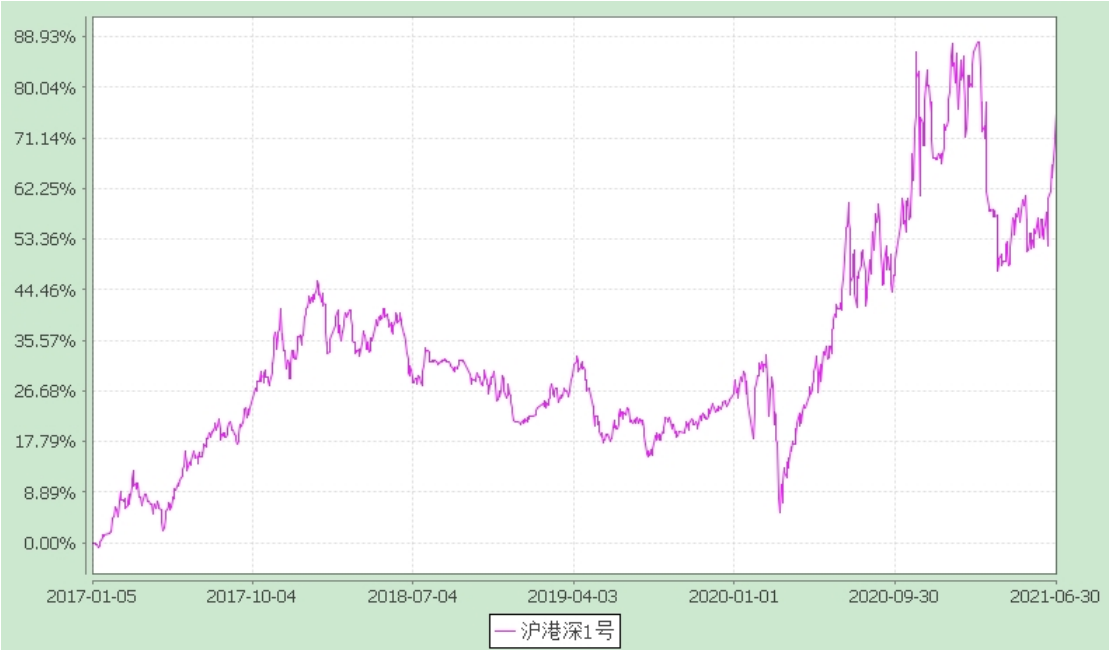
一、主要财务指标（单位：人民币元）

1. 本期利润	3,059,496.70
2. 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,351,000.23
3. 加权平均每份额本期已实现净收益	-0.0910
4. 期末资产净值	20,070,491.82
5. 期末每份额净值	1.3520
6. 期末每份额累计净值	1.6590

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	17.99%	0.00%	17.99%

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2021年06月30日，本集合计划单位净值1.3520元，累计单位净值1.6590

元，本期集合计划收益率增长 17.99%。

二、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。

三、投资主办人工作报告

1、市场回顾和投资操作

回顾二季度，两地市场主要指数走势有所分化。A 股方面，经历前期调整后市场整体有所反弹，以创业板指及科创 50 等偏重成长风格的指数领涨。港股方面，受美元反弹及量化宽松政策退出的担忧，市场整体呈现震荡走势。

分行业来看，A 股市场以电力设备新能源、电子、化工、医药、有色、计算机等成长或周期板块领涨，港股市场则以医疗、可选消费及工业等板块领涨。期内，两地市场分行业表现涨跌互现，呈现结构性分化特点。

伴随市场情绪回暖，当期组合整体仓位略有提升并加大对 A 股的配置比例；持仓结构方面，除加大对纺织服装龙头持仓比例外，减持部分周期品种并提升对半导体、电子、电新及新能源汽车等成长品种的持仓比例。

综上，期内产品净值取得了一定的上涨。

2、市场展望和投资策略

展望三季度，通胀压力引发市场对量化宽松政策退出的担忧持续发酵，流动性如收紧将对高估值板块产生一定压力。

伴随中报业绩陆续披露，我们认为业绩能够持续兑现的成长板块以及存在边际改善空间的低估值板块仍具有较好的配置价值。

从中长期看，科技进步、新消费、医疗保健以及高端制造等领域长期发展趋势确定且发展空间广阔，由此决定存在大量的投资机会。我们将继续围绕自下而上的基本面研究驱动，发掘确定性较高的潜在投资机会。

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	16,438,042.07	81.33%
债券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	3,769,841.03	18.65%
其他资产	4,198.37	0.02%
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	20,212,081.47	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	01211	比亚迪股份	18,000.00	3,479,934.96	17.34%
2	02020	安踏体育	12,000.00	1,826,391.36	9.10%
3	02331	李宁	20,000.00	1,578,609.60	7.87%
4	300327	中颖电子	16,600.00	1,414,818.00	7.05%
5	603486	科沃斯	6,100.00	1,391,288.00	6.93%
6	300671	富满电子	9,500.00	1,250,580.00	6.23%

7	300207	欣旺达	37,900.00	1,234,024.00	6.15%
8	002230	科大讯飞	18,200.00	1,229,956.00	6.13%
9	02382	舜宇光学科技	5,600.00	1,144,192.22	5.70%
10	01368	特步国际	92,500.00	1,127,506.92	5.62%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本产品报告期末未持有债券

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

本产品报告期末未持有基金

五、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本产品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。

七、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	66,665.98	67,355.19
托管费	8,888.78	8,980.67
业绩报酬	0.00	0.00

八、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	0.00

九、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。

第六节集合计划份额变动

一、集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	14,845,411.10

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	0.00
报告期末份额总额	14,845,411.10

二、关联方持有本集合计划份额变动情况

本产品报告期末未持有关联方持仓本集合计划份额。

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

无

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

2021 年 7 月 21 日