

中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划 2021 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：2022 年 3 月 31 日

目录

一、管理人履职报告	3
二、托管人履职报告	3
三、资产管理计划概况	3
四、资产管理计划投资表现	5
五、管理人报告	5
六、投资组合报告	6
七、资产管理计划份额变动	9
八、资产管理计划投资收益分配情况	10
九、重要事项提示	10
十、备查文件目录	11

一、管理人履职报告

报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、其他相关法律法规以及本计划说明书和合同的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产。

报告期内，本计划合法合规运作，投资管理符合相关法律法规、本计划说明书和合同的规定，不存在违法违规、未履行合同承诺或损害本计划委托人利益的情形。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

二、托管人履职报告

本报告期内，本托管人在对中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害资产委托人利益的行为。

本报告期内，本托管人依法对中信证券股份有限公司编制和披露的中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划 2021 年年报中财务指标、净值表现、利润分配情况、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

三、资产管理计划概况

1、基本资料

名称：	中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划
类型：	小集合

成立日：2015 年 1 月 23 日

报告期末份额总额：38,504,438.40

投资目标：主要通过有效率的买入标的股票，积极主动地去争取实现自己的股东利益或投资收益，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：上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼

法定代表人：李庆萍

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

四、资产管理计划投资表现

1、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	4,016,408.81
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	8,866,090.51
期末资产净值	46,969,685.75
期末每份额净值	1.2199
期末每份额累计净值	2.1791

五、管理人报告

1、投资结果

截至 2021 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.2199 元，累计单位净值 2.1791 元，本期集合计划收益率增长 19.3%。

2、投资主办人简介

唐莹先生，中信证券资产管理业务高级副总裁，经济学硕士。有多年行业研究经验，2008 年至 2010 年在天相投资顾问有限公司任行业研究员，2010 年至 2015 年在农银人寿保险股份有限公司任行业研究员、股票投资经理，2015 年加入中信证券资产管理业务，任银行委外、保险、年金业务权益类投资经理，已经取得基金从业资格，无其他兼职，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

3、投资主办人工作报告

1) 市场回顾和投资操作

2021 年全年上证指数上涨 4.80%，创业板指上涨 12.02%，中小板指和深证成指分别涨 4.62%和 2.67%。风格方面，市场风格更加均衡。行业上，电力设备及新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁等行业表现较好，消费者服务、非银行金融、家电、房地产、农林牧渔等行业表现落后。

2) 市场展望和投资策略

展望 2022 年，经济工作会议的定调，将推动宽货币和宽信用预期逐步落地，市场将随之迎来结构性机会。风格方面，我们认为应保持成长价值风格相对均衡的配置，包括政策边际放松的低估值基建地产链、估值回归的必选消费、调整后估值性价比合理的科技成长。

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。

六、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	36,400,542.30	76.81%
债券	4,592,610.11	9.69%
基金	10,126.16	0.02%

银行存款及清算备付金合计	6,372,604.42	13.45%
其他资产	16,152.59	0.03%
其中：资产支持证券	0.00	0.00%
合计	47,392,035.58	100.00%

2、资产管理计划运用杠杆情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例
1	报告期末债券回购融资余额	0.00	-
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%

3、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	4,592,610.11	9.78%
公司债	-	-
其他债券	-	-
中期票据	-	-
合计	4,592,610.11	9.78%

4、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	127022	恒逸转债	19,478.00	2,444,800.65	5.21%
2	113542	好客转债	16,880.00	1,903,726.40	4.05%
3	110081	闻泰转债	1,460.00	230,198.20	0.49%
4	128136	立讯转债	110.00	13,884.86	0.03%

5、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	002241	歌尔股份	86,100.00	4,658,010.00	9.92%
2	00175	吉利汽车	222,000.00	3,862,793.34	8.22%
3	600258	首旅酒店	108,600.00	2,837,718.00	6.04%
4	600745	闻泰科技	21,200.00	2,741,160.00	5.84%
5	02333	长城汽车	86,000.00	1,882,791.12	4.01%
6	603979	金诚信	83,500.00	1,793,580.00	3.82%
7	02382	舜宇光学科技	8,600.00	1,732,448.84	3.69%
8	600025	华能水电	248,400.00	1,636,956.00	3.49%
9	688256	寒武纪-U	14,613.00	1,389,696.30	2.96%
10	600529	山东药玻	28,500.00	1,251,150.00	2.66%

6、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

7、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	003003	华夏现金增利证券投资基金	9,078.15	9,078.15	0.02%
2	519888	汇添富收益快线货币市场基金	104,765.00	1,047.65	0.00%
3	003393	建信天添益货币市场基金	0.36	0.36	0.00%

8、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

9、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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

期末持有的处于转股期的可转换债券明细：

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	113542	好客转债	16,880.00	1,903,726.40	4.05%
2	127022	恒逸转债	19,478.00	2,444,800.65	5.21%
3	128136	立讯转债	110.00	13,884.86	0.03%

10、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	799,111.49	1,017,359.98

托管费	79,911.08	101,735.98
业绩报酬	88,962.98	88,962.98

11、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

12、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

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	003003	华夏现金增利 A	9,078.15	9,078.15	0.02%

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。

七、资产管理计划份额变动

一、资产管理计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	60,780,802.77
报告期间参与份额	0.00
红利再投资份额	693,041.85
报告期间总退出份额	22,969,406.22
报告期末份额总额	38,504,438.40

二、关联方持有本资产管理计划份额变动情况

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	-

本报告期内,关联方未持有本资产管理计划份额。

八、资产管理计划投资收益分配情况

序号	除权日	分配日	分配金额
1	2021-03-15 00:00:00.0	2021-03-17	5,188,200.78

九、重要事项提示

一、本资产管理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、本资产管理计划计划相关其他事项

2021-02-08 关于中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划第六个开放期及下一个封闭期安排公告

2021-02-08 关于中信证券自有资金可能赎回中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划的提示性公告

2021-02-23 关于中信证券自有资金赎回中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划的公告

2021-03-15 中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划第十一次分红公告

2021-04-28 关于中信证券自有资金可能赎回中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划的提示性公告

2021-04-28 中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划合同变更征询函

2021-05-17 关于中信证券自有资金赎回中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划的公告

2021-05-18 中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划合同变更生效公告

2021-09-24 关于中信证券自有资金可能赎回中信证券积极策略 1 号集合资产管理计划的提示性公告

十、备查文件目录

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

