

# 中信证券信信向荣 3 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上海分行

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.....	10

## 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、未履行承诺或损害本计划委托人利益的情形。

本报告期自 2021 年 07 月 30 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信信向荣 3 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信信向荣 3 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：	中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划
类型：	小集合

成立日： 2021 年 7 月 30 日  
报告期末份额总额： 1,517,741,146.34  
投资目标： 重点投资于债权类资产，在严格控制风险、保障流动性、追求安全性的前提下，获得相对稳定的投资收益。  
投资理念： -  
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上海分行  
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上海分行  
办公地址： 上海市浦东新区世博馆路 138 号中信银行大厦 10 层  
法定代表人： -

## 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	18,387,541.64
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	15,897,850.95
期末资产净值	1,551,763,922.54
期末每份额净值	1.0224
期末每份额累计净值	1.0224

#### 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 1.0224 元，累计单位净值 1.0224 元，本期集合计划收益率增长 2.24%。

##### 2、投资主办人简介

李薇女士，应用数学硕士，曾任中国建设银行金融市场部自营交易处业务经理，2015 年加入中信证券，担任固定收益投资经理。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

回顾 2021 年，债券市场整体呈下行走势。利率债方面，年初及四季度初，大宗商品价格上涨推升通胀预期，利率债收益率有所回调，其余时间，在宽货币的基调之下，下半年两次降准、一次降息，推动利率债收益率持续下行，全年来看，10 年国债收益率下行幅度 37bp。信用债方面，一方面利率中枢持续下行，另一方面宽松资金面推升信用债需求，全年信用利差持续压缩，整体信用债全年收益率大幅下行，3 年 AAA 中票全年下行幅度 61bp，同时部分高信用利差品种

如银行永续债、银行二级资本债、券商永续债等全年收益率下行幅度达到 80-100bp。

## 2) 市场展望和投资策略

展望未来，1 月社融数据企稳后，整体市场宽松预期有所修正，债券市场收益率节后明显上行。同时近期各地地产政策边际有所放松，今年整体的政策基调宽信用，宽信用中前期，预计货币政策仍将维持宽松。不过在市场学习效应之下，利率与社融的时滞越来越小，一季度可能在宽信用无法证伪、专项债供给上量、经济增速反弹等影响下利率有上行风险，之后在融资增速回升有限，海外供应链修复导致出口回落等因素的推动下二季度重有利率下行机会。下半年将主要观察政策对市场的影响。

## 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	0.00	0.00%
债券	1,406,270,514.30	86.91%
基金	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	5,289,538.27	0.33%

其他资产	206,515,325.62	12.76%
其中：资产支持证券	103,707,320.00	6.41%
合计	1,618,075,378.19	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	36,299,529.00	2.34%
	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	1,002,900.00	0.06%
企业债	197,875,428.50	12.75%
可转债	-	-
公司债	715,508,185.80	46.11%
其他债券	371,414,000.00	23.93%
中期票据	120,470,000.00	7.76%
合计	1,406,270,514.30	90.62%

## 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	139475	21 河钢 01	600,000.00	60,000,000.00	3.87%
2	032100681	21 环太湖 PPN001	500,000.00	50,095,000.00	3.23%
3	012103424	21 昆明城建 SCP002	500,000.00	49,845,000.00	3.21%
4	032100963	21 滨州城投 PPN003	400,000.00	40,396,000.00	2.60%
5	188883	21 铁投 01	400,000.00	40,316,000.00	2.60%
6	184101	21 淄博 05	400,000.00	40,000,000.00	2.58%

7	197102	21 阜投 01	400,000.00	40,000,000.00	2.58%
8	196950	21 即墨 03	400,000.00	40,000,000.00	2.58%
9	188975	21 赣交 Y4	400,000.00	40,000,000.00	2.58%
10	185004	21 秦发 02	400,000.00	40,000,000.00	2.58%

### 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

本产品报告期末未持有股票

### 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

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	136551.SZ	荟柒 7B	320,000.00	31,686,080.00	2.04%
2	082100930. IB	21 诚惠 ABN005 优先 A3	200,000.00	20,052,000.00	1.29%
3	136372.SZ	庐陵 01 优	150,000.00	15,000,600.00	0.97%
4	189914.SH	烨熠 1A2	130,000.00	13,000,000.00	0.84%
5	136357.SZ	度小满 5B	100,000.00	10,000,500.00	0.64%
6	193104.SH	光信 15B	70,000.00	7,000,000.00	0.45%
7	189915.SH	烨熠 1A3	40,000.00	4,000,000.00	0.26%
8	136485.SZ	荟享 068B	30,000.00	2,968,140.00	0.19%

### 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

本产品报告期末未持有基金

### 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中，秦皇岛城市发展投资控股集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。该类情形对该发行主体的经营和财务没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及基金合同的要求。

期末持有的处于转股期的可转换债券明细：

无



### 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	1,190,442.24	814,794.19
托管费	99,203.55	67,899.53
业绩报酬	156,335.76	156,335.76

### 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

本产品报告期末未持仓关联方发行的资管产品。

## 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	55,300,000.00
报告期间参与份额	1,517,736,683.73
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	55,295,537.39
报告期末份额总额	1,517,741,146.34

### 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

本产品在本报告期内没有投资收益分配。

## 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

2021-07-30 中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划成立公告

2021-08-26 中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划合同变更征询函

2021-08-31 中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划合同变更生效公告

2021-09-17 中信证券股份有限公司关于所管理的中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划分销买入“21 启东 02(分销)”的公告

2021-11-19 中信证券股份有限公司关于所管理的中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划分销买入“21 赣高 01(分销)”的公告

## 十、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中信证券“信信向荣 3 号”集合资产管理计划的文件
- 2、《中信证券“信信向荣 3 号”集合资产管理计划说明书》
- 3、《中信证券“信信向荣 3 号”集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《中信证券“信信向荣 3 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“信信向荣 3 号”集合资产管理计划《验资报告》
- 7、中信证券“信信向荣 3 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](http://www.cs.ecitic.com)

热线电话：95548

