

中信证券积极策略1号集合资产管理计划

季度报告

2022年第2季度报告

第一节 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2022年04月01日起至06月30日止。

第二节 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2022年季报中财务指标、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。

第三节 资产管理计划概况

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：36,657,009.00
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。
投资目标：
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

第四节 资产管理计划投资表现

一、主要财务指标（单位：人民币元）

1. 本期利润	1,432,309.40
2. 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-5,213,369.74
3. 期末资产净值	35,605,050.62
4. 期末每份额净值	0.9713
5. 期末每份额累计净值	1.9305

第五节 管理人报告

一、业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本集合计划单位净值 0.9713 元，累计单位净值 1.9305 元，本期集合计划收益率增长 4.21%。

二、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。

三、投资主办人工作报告

1、市场回顾和投资操作

2022 年二季度，受国内主要城市疫情影响、政策面边际变化以及海外利空因素影响，权益市场整体呈现“V”字走势。行业表现方面，二季度中信一级行业指数中多数行业录得正收益，其中 6 个行业涨幅超过 10%，消费者服务行业涨幅 23.17%，汽车 22.73%；综合金融表现垫底，下跌 15.42%。

2、市场展望和投资策略

展望未来，当前国内稳增长政策发力明确，经济处于上行修复区间、疫情边际好转，同时考虑海外通胀压力持续、货币政策收紧等因素，我们认为市场将维持震荡上行态势。具体板块方面，我们关注：（1）保持较高景气度、国内外市场长期需增长向好的成长板块，如电力设备及新能源、军工；（2）疫情边际好转后多重政策支持利好，市场情绪高涨，修复弹性较大的板块，如化工、汽车、轻工制造；（3）经营逐步改善、政策面持续发力使得投资者风险偏好修复的板块，如房地产、银行、建材。

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类风险，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。

第六节 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	24,568,288.11	68.33%
债券	0.00	0.00%
基金	10,134.44	0.03%

银行存款及清算备付金合计	11,333,939.91	31.52%
其他资产	40,969.27	0.11%
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	35,953,331.73	100.00%

二、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%

三、期末市值占资产管理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	00175	吉利汽车	184,000.00	2,803,962.75	7.88%
2	600048	保利发展	107,000.00	1,868,220.00	5.25%
3	601117	中国化学	195,100.00	1,835,891.00	5.16%
4	600690	海尔智家	52,100.00	1,430,666.00	4.02%
5	300498	温氏股份	63,300.00	1,347,657.00	3.79%
6	603979	金诚信	62,800.00	1,212,668.00	3.41%
7	00941	中国移动	26,000.00	1,088,250.80	3.06%
8	000729	燕京啤酒	105,500.00	1,019,130.00	2.86%
9	002714	牧原股份	18,100.00	1,000,387.00	2.81%
10	600025	华能水电	142,100.00	993,279.00	2.79%

四、期末市值占资产管理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

五、期末市值占资产管理计划资产净值前十名基金明细

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	0.03%
2	519888	汇添富收益快线货币市场基金	105,593.00	1,055.93	0.00%
3	003393	建信天添益货币市场基金	0.36	0.36	0.00%

六、期末市值占资产管理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

七、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。

八、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	126,441.30	0.00
托管费	12,644.14	0.00
业绩报酬	0.00	0.00

九、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

十、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	0.03%

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。

第七节 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	38,504,438.40
报告期内参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期内总退出份额	1,847,429.40
报告期末份额总额	36,657,009.00

二、关联方持有本资产管理计划份额变动情况

本报告期内,关联方未持有本资产管理计划份额。

第八节 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。

第九节 重要事项提示

一、本资产管理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、本资产管理计划相关其他事项

2022-04-11 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

第十节 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

2022年7月21日

