中信证券沪港深1号集合资产管理计划 季度报告

2022 年第 3 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、未履行合同承诺或损害本计划委托人利益 的情形。

本报告期自2022年07月01日起至09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沪港深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 沪港深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: 13,756,079.57

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

投资目标: 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总行营业部

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	-802,041.76
2. 本期利润扣减本期公允价值	24 922 11
变动损益后的净额	36,832.11
3. 期末资产净值	12,444,086.58
4. 期末每份额净值	0.9046
5. 期末每份额累计净值	1.2116

第五节 管理人报告

一、业绩表现

截至2022年09月30日,本集合计划单位净值0.9046元,累计单位净值1.2116元,本期集合计划收益率增长-6.05%。

二、投资主办人简介

蔡青女士,英国朴茨茅斯大学金融决策分析专业硕士。2018年1月加入中信证券资产管理部,此前曾任南方基金国际业务部高级研究员、基金经理,现任中信证券资产管理业务执行总经理、跨境业务负责人。蔡青女士长期从事跨境权益资产研究及投资工作,具备丰富的投资研究经验。已经取得基金从业资格,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 年三季度,两地市场均呈现震荡下跌态势: A 股方面,上证 50、沪深 300、中证 500 及创业板 50 指数分别下跌 14.66%、15.16%、11.47%及 19.86%; 港股方面,恒生指数、恒生国企及恒生科技指数分别下跌 21.21%、22.86%及 29.16%。

分行业来看,A股市场呈现普跌态势,中信一级行业中仅煤炭录得正收益, 其余均有不同幅度下跌,以建材、电子、传媒、医药、化工、汽车及计算机等行业领跌,港股市场恒生一级行业全部下跌,其中工业、医疗保健、地产建筑及科技行业领跌。

基于审慎的风险预算管理,当期组合整体仓位有所下调,并对前期参与的部分反弹品种获利了结。期内,产品净值录得小幅下跌。

2、市场展望和投资策略

复盘三季度,美债利率定价反映了市场对经济衰退过早担忧而低估了通货膨胀的持续性,在美联储延续鹰派表态并上调政策目标利率驱动下,引发全球市场大类资产剧烈波动,包括但不限于美元指数走强、美债利率上行、大宗商品下跌等。国内方面,5月份反弹以来,市场流动性整体偏松但边际递减,叠加多地疫情散发导致防疫政策放松预期有所修正,使得当期市场有所下跌。

展望四季度,当前市场处于相对低位,配置性价比逐渐提升,看待后市不宜过分悲观。行业配置上,一方面,继续看好能源板块延续强势表现,另一方面,着手布局一些前期调整较大、当前估值便宜且基本面仍然持续向好的细分行业龙头。

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。

第六节 投资组合报告

一、资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,275,052.61	18.26%
	其中:股票	2,275,052.61	18.26%
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	0.00	0.00%
	其中:债券	0.00	0.00%
	资产支持证券	0.00	0.00%
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	0.00	0.00%
7	银行存款和结算备付金合计	10,171,244.99	81.62%
8	其他资产	15,480.29	0.12%
9	合计	12,461,777.89	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	0.00	
1	回购融资余额	0.00	-
	其中: 买断式	0.00	0.000/
	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	601668	中国建筑	71,500.00	368,225.00	2.96%
2	300596	利安隆	6,300.00	345,051.00	2.77%
3	03996	中国能源	374,000.0	280,581.53	2.25%

		建设	0		
4	06869	长飞光纤 光缆	15,000.00	244,827.24	1.97%
5	01138	中远海能	36,000.00	215,074.69	1.73%
6	01171	兖矿能源	8,000.00	208,963.16	1.68%
7	601669	中国电建	25,600.00	178,432.00	1.43%
8	00384	中国燃气	13,400.00	115,363.40	0.93%
9	600875	东方电气	5,300.00	108,332.00	0.87%
10	600498	烽火通信	8,700.00	108,054.00	0.87%

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 本产品报告期末未持有基金

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,或在报告编制目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

E为前一日集合计划资产净值

	报告期间计提金额(元)	报告期间支付金额 (元)
管理费	48,342.38	48,727.55
托管费	6,445.58	6,496.98
业绩报酬	-	-

1、管理费

资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【1.50】%年费率计提。 计算方法为:

H=E×年管理费率÷【实际天数】,本资产管理计划年管理费率为【1.50】% H 为每日集合计划应计提的管理费

2、托管费

资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.20】%年费率计提。 计算方法为:

H=E×年托管费率÷【实际天数】,本资产管理计划年托管费率为【0.20】%

- H为每日集合计划应计提的托管费
- E为前一日集合计划资产净值

3、业绩报酬(如有)

在合同约定的业绩报酬计提日,将根据投资者的期间年化收益率 (R),对期间年化收益率超过业绩报酬计提基准 (【8.00】%)以上的部分按照【20.00】%的比例收取管理人业绩报酬。

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 本产品报告期末未持仓关联方发行的资管产品。

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	13,756,079.57
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	13,756,079.57

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

无

第十节 信息披露的查阅方式

网址: www.cs.ecitic.com

热线电话: 95548

