

中信建投扬帆回报 1 号集合资产管理计划

2022 年第 3 季度报告

第一节 重要提示

本报告由资产管理计划管理人编制。资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司北京市分行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资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2022 年 07 月 01 日至 2022 年 09 月 30 日

第二节 集合资产管理计划概况

名称	中信建投扬帆回报 1 号集合资产管理计划
类型	混合类资产管理计划
成立日	2021 年 07 月 26 日
报告期末份额总额	8,983,799.63
投资范围	<p>本集合计划的投资范围为：权益类资产、固定收益类资产。</p> <p>权益类资产包括：国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，包括一级市场新股申购、参与股票增发）、证券投资基金（债券型和货币型证券投资基金除外）及中国证监会认可的其他标准化股权类资产。</p> <p>固定收益类资产包括：银行存款、货币市场基金、同业存单、大额存单、债券逆回购、国债、地方政府债、政策性金融债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债（含非公开发行公司债券）、可转债、可交换公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债等）、资产支持证券、中央银行票据、永续债（含可续期债）、可分离交易债券、债券型基金、债券正回购、经银行间市场交易商协会批准在网发行的各类债务融资工具（如短期融资券、证券公司短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持票据等）以及其他债券。</p> <p>本集合计划可以参与证券回购。</p>
投资比例	(1) 固定收益类的投资比例为总资产的 0-80%（不含）；

	(2) 权益类资产的投资比例为总资产的 0-80% (不含)。
业绩比较基准	无
管理费	<p>本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提。管理费的年费率为 1.5%。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年管理费率} \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费每日计提，逐日累计至每季度季末，按季度支付。管理人于每个季度结束后的次月首日起（含）15 个工作日内向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。</p>
托管费	<p>本集合计划的托管费按前一日集合计划的资产净值计提。托管费的年费率为 0.03%。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年托管费率} \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划托管费 E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划托管费每日计提，逐日累计至每季度末，按季度支付。管理人于每个季度结束后的次月首日起（含）15 个工作日内向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。</p>
业绩报酬	<p>集合计划在分红时、投资者赎回退出时和集合计划终止清算时进行业绩报酬的计提。</p> <p>业绩报酬从集合计划份额持有人赎回资金、分红资金或清算资产中扣除，当集合计划份额期间年化收益率超过业绩报酬计提基准时，管理人可以计提业绩报酬。本计划业绩报酬计提基准为 8%。</p> <p>1、业绩报酬的计提原则</p> <p>在集合计划份额持有人赎回和本集合计划终止时，业绩报酬分别按集合计划份额持有人赎回份额和集合计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔参与份额的一部分，则将该部分赎回份额直接进行核算；若持有人在赎回前多次参与，则赎回时对份额采取“先进先出”的原则进行计算。当集合计划分红时，单笔业绩报酬计提金额不超过分红金额。当集合计划终止清算时，所有投资者视同全部赎回，都按规定计提业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬计算公式</p> <p>计算公式详见合同内容。</p> <p>3、管理人业绩报酬若有计提，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人无需复核业绩报酬，托管人根据划款指令日期完成费用支付，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，</p>

	支付日期自动顺延。 4、本集合计划的业绩报酬提取频率不超过每6个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。
管理人	中信建投证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司北京市分行
注册登记机构	中信建投证券股份有限公司

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）

本期利润	-812,489.67
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	449,709.62
每份额本期已实现净收益	0.0471
期末资产净值	9,432,223.85
期末每份额净值	1.0499
期末每份额累计净值	1.0499
期末杠杆率	100.71%

注：每份额本期已实现净收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额/平均份额

二、本期每份额净值增长率

阶段	净值增长率(%)	份额净值增长率标准差(%)
本期初到本期末	-6.96	1.14

三、集合计划每份额净值增长率历史走势图(2021年07月26日-2022年09月30日)

集合计划每份额净值增长率历史走势图



四、本期计划收益分配情况

阶段	收益分配总金额	每份额收益分配金额
本期初到本期末	0.00	0.00

第四节 管理人履职报告

一、投资经理简介

肖运柯，上海交通大学化学工程学士，中国人民大学金融学硕士，具备基金从业资格。2014年7月至2020年12月任华夏基金管理有限公司投资研究部化工行业研究员及基金经理助理。2020年12月任中信建投证券股份有限公司资产管理部投资经理。

二、投资经理工作报告

1、市场回顾和投资操作

权益部分：三季度市场在各种负面情绪下大幅调整，但整体基本面变化并不大，主要是美元加息带来的估值收缩压力及国内疫情防控对部分行业景气度造成影响，市场已经重新回到非常有吸引力的水平，大幅调整的风险较小。我们的持仓仍集中来源于自下而上选择的优质成长公司，继续对网络安全，高端制造等行业的优质企业进行加仓。目前组合持仓集中在高端制造，软件互联网，消费等行业。

2、市场展望和投资策略

权益部分：展望未来，经济下行的动能趋弱，会逐渐稳定甚至在政策托底下企稳回升，海外加息进程可能已经过半，甚至在半年内会迎来拐点，国内流动性逐渐充裕。企业盈利增长会逐渐兑现在股价上。我们将持续在高端制造，数字经济，互联网等行业中寻找快速创造价值的公司，同时也在传统行业中不断寻找在自身领域有独特竞争优势，有长期成长空间的股票，通过精选个股创造收益。

三、风险控制报告

中信建投证券股份有限公司严格遵守法律法规规定，并针对本资产管理计划的运作特点，建立完善的风险监测指标体系，进行日常监控与分析，并及时报告业务运作中的风险状况和风险控制效果。

报告期内，本资产管理计划运作合法、合规，未出现违反相关规定的状况，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

名称	市值（元）	占总资产比例（%）
股票	6,783,280.00	71.41
债券	1,335,994.38	14.06
基金	751,322.50	7.91
银行存款及清算备付金合计	628,695.38	6.62
其他资产	0.00	0.00
合计	9,499,292.26	100.00

注：因四舍五入原因，各项资产的分项数值之和与合计数值可能存在尾差。

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	002212 SZ	天融信	166,500.00	1,531,800.00	16.24
2	300575 SZ	中旗股份	81,800.00	1,466,674.00	15.55
3	300408 SZ	三环集团	30,900.00	804,636.00	8.53
4	300144 SZ	宋城演艺	43,000.00	516,000.00	5.47
5	600258 SH	首旅酒店	23,900.00	511,221.00	5.42
6	002928 SZ	华夏航空	46,700.00	496,888.00	5.27
7	002410 SZ	广联达	8,700.00	396,981.00	4.21

8	002886 SZ	沃特股份	17,000.00	275,740.00	2.92
9	603085 SH	天成自控	28,600.00	275,132.00	2.92
10	603712 SH	七一二	7,600.00	269,800.00	2.86

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	代码	名称	数量	市值(元)	占净值比例(%)
1	132020 SH	19 蓝星 EB	11,500.00	1,335,994.38	14.16

四、期末市值占集合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	513330 SH	华夏恒生互联网科技业ETF(QDII)	1,892,500.00	751,322.50	7.97

五、期末市值占集合计划资产净值前十名资产支持证券明细

本集合计划报告期末未持有资产支持证券。

六、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	10,883,799.63
报告期间总参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	1,900,000.00
报告期末份额总额	8,983,799.63

第七节 重要事项提示

一、本资管计划管理人及托管人相关事项

1、在本报告期内，本资管计划管理人、托管人的办公地址没有发生变更。

二、本资管计划相关事项

1、在本报告期内，本资管计划未发生重大关联交易。

2、在本报告期内，本资管计划未发生投资经理变更。

3、在本报告期内，未发生涉及本资管计划的重大诉讼、仲裁、重要财产纠纷事项。

4、在本报告期内，本资管计划未发生影响投资者权益的其他重大事项。

5、在本报告期内，无管理人关联方参与本资管计划。

第八节 信息披露的查阅方式

网址：www.csc108.com

热线电话：4008895587

