

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4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10月01日起至12月31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：34,666,974.00
 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。
 业绩比较基准：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

4.1 主要财务指标（单位：人民币元）

1. 本期利润	456,879.87
2. 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,950,877.03
3. 期末资产净值	30,822,834.39
4. 期末每份额净值	0.8891
5. 期末每份额累计净值	1.8483

第五节 管理人报告

5.1 业绩表现

截至2022年12月31日，本集合计划单位净值0.8891元，累计单位净值1.8483元，本期集合计划收益率增长1.58%。

5.2 投资经理简介

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。

5.3 投资经理工作报告

5.3.1 市场回顾和投资操作

本月市场震荡回调。风格方面，资金存量博弈和板块快速轮动的特征依旧明显，市场波动较大，仍存在跷跷板效应。结构和操作方面，从12月来看，防疫政策放开来带了消费板块较好的右侧布局机会，本月加仓了食品饮料、消费服务、商贸零售等一系列大消费板块的优质标的；边际上减仓了部分光伏、电力设备标的；对于半导体、互联网、医药、地产等目前基本面开始边际好转的的板块，我们兑现了部分涨幅较大的地产股和医药股，同时持续跟踪其他板块基本面的边际变化，寻找长期的配置机会。

5.3.2 市场展望和投资策略

我们看好市场的中长期机会，从行业角度来看，我们会聚焦一些顺周期的方向：化工板块及以大消费为主的消费场景复苏受益板块。同时，依然会关注景气度较高的新能源车零部件、光伏组件等制造业板块，坚持自上而下与自下而上相结合地寻找优质标的。总的来看，短期基本面在底部区间，但随着政策博弈、疫情大规模爆发等多方面影响下，市场或短时间维持震荡，从长期角度迎来较好的布局机会。

5.4 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，并提醒投资经理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

6.1 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	23,877,028.97	76.56%
	其中：股票	23,877,028.97	76.56%
2	基金投资	9,307.26	0.03%
3	固定收益投资	4,713,597.22	15.11%
	其中：债券	4,713,597.22	15.11%
	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	2,553,002.62	8.19%
8	其他资产	33,279.86	0.11%
9	合计	31,186,215.93	100.00%

6.2 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%

6.3 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	03690	美团-W	11,500.00	1,796,894.32	5.83%
2	00175	吉利汽车	137,000.00	1,396,873.92	4.53%
3	603979	金诚信	53,700.00	1,375,257.00	4.46%
4	01024	快手-W	20,900.00	1,328,134.81	4.31%
5	000539	粤电力 A	204,600.00	1,135,530.00	3.68%
6	000738	航发控制	43,500.00	1,115,340.00	3.62%
7	601877	正泰电器	39,700.00	1,099,690.00	3.57%
8	601369	陕鼓动力	94,700.00	1,085,262.00	3.52%
9	000537	广宇发展	78,600.00	1,039,878.00	3.37%
10	301327	华宝新能	5,300.00	997,725.00	3.24%

6.4 期末市值占资产管理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	110059	浦发转债	18,430.00	1,933,804.11	6.27%
2	113043	财通转债	8,760.00	947,027.52	3.07%
3	113622	杭叉转债	7,410.00	927,739.71	3.01%
4	113013	国君转债	8,610.00	905,025.88	2.94%

6.5 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	9,306.87	9,306.87	0.03%
2	003393	建信天添益货币市场基金	0.36	0.36	0.00%
3	519888	汇添富收益快线货币市场基金	3.00	0.03	0.00%

所投资的境外基金费率安排如下

本产品报告期末未持仓海外基金

6.6 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

6.7 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，上海浦东发展银行股份有限公司、西安陕鼓动力股份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。

6.8 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	117,608.99	0.00
托管费	11,760.91	0.00
业绩报酬	-	0.00

6.8.1 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：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{【实际天数】}$ ，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

E 为前一日集合计划资产净值

6.8.2 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【0.15】%年费率计提。

计算方法为：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{【实际天数】}$ ，本资产管理计划年托管费率为【0.15】%

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

6.8.3 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。

6.9 投资资产管理产品所产生的交易费用

项目	报告期间费用（元）
交易费用	0.00

注：本项目交易费用包括基金、理财产品、信托、养老金、债权计划、资产管理计划的交易费用。

6.10 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	9,306.87	9,306.87	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

7.1 资产管理计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	36,657,009.00
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	1,990,035.00
报告期末份额总额	34,666,974.00

7.2 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	5,542,014.74
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	1,000,000.00
报告期末份额总额	4,542,014.74

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

9.1 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。

9.2 本资产管理计划相关其他事项

2022-10-14 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

2022年12月30日，中国证券监督管理委员会作出核准中信证券设立资产管

理子公司的批复（证监许可〔2022〕3254号），资产管理子公司注册地为北京市，注册资本为10亿元，业务范围为证券资产管理业务（不含全国社会保障基金境内委托投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、企业年金基金投资管理和职业年金基金投资管理）。中信证券股份有限公司（本计划管理人）将严格按照有关规定及批复要求办理中信证券资产管理子公司设立相关事宜，并及时履行信息披露义务。

第十节 信息披露的查阅方式

网址：www.cs.ecitic.com

热线电话：95548

