

中信证券财富精选指数增强 1 号 FOF 集合资产管理计划

季度报告

2023 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、未履行承诺或损害本计划委托人利益的情形。

本报告期自2023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财富精选指数增强1号FOF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财富精选指数增强1号FOF集合资产管理计划2023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： 中信证券财富精选指数增强1号FOF集合资产管理计划
 类型： 小集合
 成立日： 2019年8月6日
 报告期末份额总额： 33,379,146.69
 投资目标： 本集合计划主要投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品,力争获取超越中证500指数的收益。
 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北京分行
 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 | -1,530,057.08 |
| 2. 本期已实现收益 | 1,152,050.47 |
| 3. 期末资产净值 | 52,601,012.22 |
| 4. 期末每份额净值 | 1.5759 |
| 5. 期末每份额累计净值 | 1.5759 |

第五节管理人报告

5.1 业绩表现

截至2023年09月30日,本集合计划单位净值1.5759元,累计单位净值1.5759元,本期集合计划收益率增长-2.70%。

5.2 投资经理简介

曾旻睿,北京航空航天大学学士,美国伊利诺理工大学硕士。毕业后加入海外对冲基金负责MOM投资,2016年加入中信证券,负责中信证券资产管理业务所有基金研究及引入。拥有丰富的境内外基金投资经验,积累了较强的资产配置能力和管理人选择能力,具有很好的绝对收益理念。投资风格均衡,基金选择能力突出。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。

5.3 投资经理工作报告

5.3.1 市场回顾和投资操作

9月中证全指和wind全A均下跌1.09%。各规模指数整体偏小市值风格，大盘沪深300下跌2.01%，中盘的中证500下跌0.85%，中小盘的中证1000下跌0.42%，小盘的中证2000逆势上涨0.21%。

5.3.2 市场展望和投资策略

基本上，市值层面，从近一周趋势上看，中证2000和国证2000等小盘指数表现略好，同时wind超大、大、中、小、微盘股指数近期也出现单调趋势，结合小盘近三个月以来的走弱，预计未来可能延续长期触底反弹的趋势，进而维持小盘风格，未来可对小市值多加关注；行业概念上，工业母机、通信、5G等成长概念近期强势，且过去一个月在价值风格主导的环境下依然维持稳健，未来可结合政策面多加关注；风格方面，成长风格近一周表现极为强势，预计下个月可能出现价值成长风格切换拐点，应多加关注。

财富精选指数增强1号FOF9月下跌0.02%，中证500指数9月下跌0.85%，本月超额增强0.83%，今年以来上涨5.25%，中证500指数今年以来下跌2.96%，超额增强8.21%。产品今年超额表现平稳，底层方面本月涨跌各半，但均跑赢中证500指数，整体表现符合预期。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 52,300,472.92 | 99.36% |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 335,507.24 | 0.64% |
| 8 | 其他资产 | 0.00 | 0.00% |
| 9 | 合计 | 52,635,980.16 | 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 | 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

本产品报告期末未持有股票

6.4 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

6.5 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

本产品报告期末未持有资产支持证券

6.6 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 | SSZ380.O F | 世纪前沿 指数增强 专享1号 | 9,987,701. 46 | 10,576,975.8 5 | 20.11% |
| 2 | SJH866.O | 衍复指增 | 8,000,000. | 10,144,800.0 | 19.29% |

| | | | | | |
|---|---------------|-----------------------|------------------|--------------|--------|
| | F | 3号 | 00 | 0 | |
| 3 | T06819.O F | 信享中证 500指增 一号B | 8,973,910. 88 | 8,736,999.63 | 16.61% |
| 4 | SNU636. OF | 诚奇信享 中证500 指数增强 | 6,400,000. 00 | 7,872,000.00 | 14.97% |
| 5 | SQW677. OF | 衍复1000 指增4号 | 3,329,180. 94 | 3,914,450.95 | 7.44% |
| 6 | SGV962. OF | 量锐78号 | 2,263,980. 08 | 3,689,834.73 | 7.01% |
| 7 | SGK422. OF | 珠海宽德 九睦 | 2,440,769. 59 | 2,891,091.58 | 5.50% |
| 8 | SJZ983.O F | 蒙玺中证 500指数 增强1号 | 2,152,080. 34 | 2,870,875.17 | 5.46% |
| 9 | SGR157.O F | 因诺天丰 7号 | 840,247.8 7 | 1,603,445.01 | 3.05% |

6.7 报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.8 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

6.9 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。

6.10 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 | 68,356.51 | 69,480.12 |
| 托管费 | 6,835.64 | 6,947.99 |
| 业绩报酬 | 7,504.73 | 7,504.73 |
| 投资顾问 费 | 0.00 | 0.00 |

6.10.1 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【0.500】%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【0.500】%

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

6.10.2 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【0.050】%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【0.050】%

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

6.10.3 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（【10.000】%）时，对期间年化收益率超过（【10.000】%）但不高于（【20.000】%）的部分按照【5.000】%的比例收取管理人业绩报酬，对期间年化收益率超过（【20.000】%）的部分按照【10.000】%的比例收取管理人业绩报酬。

6.10.4 投资顾问费（如有）

无

6.11 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 | 1,137.74 |

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。

6.12 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。

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 | 34,379,146.69 |
| 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 | 1,000,000.00 |
| 报告期末份额总额 | 33,379,146.69 |

7.2 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

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

2023-07-13 中信证券股份有限公司关于运用自有资金投资旗下集合资产管理计划的公告

2023-08-14 关于增加上海天天基金销售有限公司为中信证券财富精选指数增强 1 号 FOF 集合资产管理计划代销机构的公告

2023-08-21 中信证券股份有限公司关于运用自有资金投资旗下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

2023年10月31日