中信证券沪港深1号集合资产管理计划

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、未履行合同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：	4,223,191.10
投资目标：	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
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

4.1 主要财务指标（单位：人民币元）

1. 本期利润	93,713.83
2. 本期已实现收益	63,637.98
3. 期末资产净值	3,700,600.39
4. 期末每份额净值	0.8763
5. 期末每份额累计净值	1.1833

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 0.8763 元，累计单位净值 1.1833 元，本期集合计划收益率增长 2.60%。

5.2 投资经理简介

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。

5.3 投资经理工作报告

5.3.1 市场回顾和投资操作

回顾三季度，市场走势可分为两个阶段：（1）在国内重要政治会议召开前，由于二季度经济弱复苏得到确认，市场围绕政策刺激展开激烈博弈，加上美元走弱及国内信贷数据超预期，市场震荡上行，其中包括非银金融、地产、建材及食品饮料等顺周期板块普涨，而通信、传媒、计算机等 TMT 板块有所回调，前期结构性行情有所收敛；（2）在国内重要政治会议定调下一阶段经济工作后，后续政策出台低于市场预期，叠加医疗行业反腐、地产信用风险、美元走强及北上资金持续流出等影响，市场再度转弱，期间一度回落至年内低点。当期，A 股主要指数普跌，除上证 50 指数微涨 0.60%外，沪深 300 指数、中证 500 指数及创业板 50 指数分别下跌 3.98%、5.13%及 10.50%，一级行业中以煤炭、非银金融、石油石化、银行及地产板块领涨，而以传媒、计算机、电力设备新能源、军工及机械板块领跌；港股主要指数普跌，恒生指数、恒生国企分别下跌 5.85%、4.30%，恒生科技微涨 0.24%，一级行业中以能源、原材料及电信服务板块领涨，以综合、工业及公用事业板块领跌。

当期产品净值小幅上涨，表现好于市场指数，主要受部分持仓股票上涨贡献所致；考虑到市场潜在不确定性，期内组合仓位整体下调，期末主要持仓汽车板块。

5.3.2 市场展望和投资策略

国内市场方面，7 月底重要会议定调经济工作方向，随后 8 月、9 月包括地产、货币、资本市场等领域相关配套政策持续出台，及时地回应了市场关切。考虑到全年经济实现合意增速确定性较高，出台大规模刺激政策可能性较为有限，预计现阶段仍以定向施策、精准调控及化解风险为政策主要导向。海外市场方面，本轮美元加息周期逐渐进入尾声，惟美国经济及就业韧性较强，当前处于相持阶段，而美联储鹰派表态则显示其抑制通胀的坚定决心，预计年内政策利率将维持高位，美元指数或延续强势表现；此外，近期一系列地缘政治事件或将推升全球大类资产潜在波动性。

在经历政策预期反复博弈、北上资金持续流出后，当前两地市场逐步企稳、市场信心有所修复。展望后市，考虑到经济数据边际企稳、政策效果逐步显现，

居民消费有所回暖，当前权益资产估值处于历史低位，潜在回报较为吸引，当前不宜也不应过度悲观。我们将沿着“扩大内需、自主可控”与“供给侧结构性改革”两大政策导向，结合行业景气度变化，不断发掘寻找潜在投资机会。

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	218,995.85	5.89%
	其中：股票	218,995.85	5.89%
2	基金投资	-	-
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	3,491,511.90	93.93%
8	其他资产	6,515.34	0.18%
9	合计	3,717,023.09	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

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	02015.HK	理想汽车-W	1,000.00	124,875.90	3.37%
2	01114.HK	BRILLIANCE CHI	26,000.00	94,119.95	2.54%

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

本产品报告期末未持有基金

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	13,868.27	13,758.67
托管费	1,849.09	1,834.46
业绩报酬	-	0.00

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【1.500】%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【1.500】%

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【0.200】%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【0.200】%

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（【8.000】%）以上的部分按照【20.000】%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	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。

6.12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	4,223,191.10
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	4,223,191.10

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

2023-08-21 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

2023-09-11 关于变更中信证券沪港深 1 号集合资产管理计划投资经理的公告

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