

中信证券科创领先5号集合资产管理计划 2023年第4季度报告

§1 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10月01日起至12月31日止。

§2 托管人履职报告

本报告期内，本托管人在对中信证券科创领先5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资产管理有限公司编制和披露的中信证券科创领先5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。

§3 资产管理计划概况

名称：	中信证券科创领先5号集合资产管理计划
类型：	小集合
成立日：	2019年7月2日
报告期末份额总额：	11,662,601.80

投资目标:	主要通过优选A股及“港股通”股票，并择机参与科创板股票，力争获取超额收益；同时灵活配置债权类资产等资产，力求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:	中信证券资产管理有限公司
托管人:	中信银行股份有限公司总行营业部
注册登记机构:	中信证券资产管理有限公司

§4 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	-705,387.48
2. 本期已实现收益	-245,739.60
3. 期末资产净值	13,747,908.96
4. 期末每份额净值	1.1788
5. 期末每份额累计净值	1.1788

§5 管理人报告

5.1 业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.1788 元，累计单位净值 1.1788 元，本期集合计划复权单位净值增长率为-4.88%。

5.2 投资经理简介

于聪先生，北京大学硕士研究生、香港大学硕士研究生。2012 年加入中信证券资产管理部，历任行业研究员、权益投资经理。现任中信证券资产管理有限公司权益投资经理。

5.3 投资经理工作报告

5.3.1 市场回顾和投资操作

市场短期调整压力缓解，各核心指数的估值水平已经位于历史中低水平，从一年维度看，应该积极作为。

年初以来，宽松的流动性体现了逆周期调节下的货币政策放松，减税降费的落地使得企业盈利的长期预期好转，中美贸易摩擦出现缓和的信号使市场信心得到了恢复。虽然经济下行的压力仍将长期存在，上半年企业的盈利情况仍然是下行态势，但是市场调整已经反映了对于经济和企业盈利的悲观预期，预期改善将带来权益市场的投资机会。

6月份到8月份市场好转，绝对收益显著，公募相对收益跑赢市场。9月份和10月份市场持续杀跌，跌破3000点，因为仓位较高，而且组合有经济顺周期的风险敞口，净值回落较多，12月以来，随着市场逐步企稳，公募净值开始回升。

5.3.2 市场展望和投资策略

今年主要布局了今年几个明确的投资机会：1、低估值的核心资产。这类股票以白马蓝筹股为主，估值位于历史低位，后续各类长期资金进场的空间很大。2、科创板相关的成长性行业。国家对科技的重视前所未有，而且政策舆论导向上，希望资本市场为科创板助力。民企融资环境好转，企业回款改善，能够投入科技研发的支出提升。中美贸易摩擦有缓和迹象，随着知识产权保护的进一步落实，原先受阻的一些科技类项目将继续推进，相关板块有估值修复的空间。3、央企改革带来企业估值修复。许多央企项目资金前期投入大、回款慢，许多公司现金流出现了问题，带来估值大幅杀跌。在今年偏宽松的资金环境下，优质公司的估值有率先修复的空间。

展望2024年，有望与市场共振向上，市场估值位于底部区间，配置的品种以上述三个方向为主，向上的空间较大，仍然对市场相对乐观。

5.4 风险控制报告

管理人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。

§6 投资组合报告

6.1 资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	权益投资	9,629,522.34	69.88
	其中：股票	9,629,522.34	69.88
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
	其他	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,000,030.00	21.77
7	银行存款和结算备付金合计	619,585.27	4.50
8	其他资产	530,899.45	3.85
9	合计	13,780,037.06	100.00

6.2 运用杠杆情况

序号	项目	金额（元）	占资产净值的比例（%）
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 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占资产净值的比例（%）
1	600309.SH	万华化学	13,900.00	1,067,798.00	7.77
2	300750.SZ	宁德时代	5,200.00	848,952.00	6.18
3	600519.SH	贵州茅台	300.00	517,800.00	3.77
4	000651.SZ	格力电器	15,400.00	495,418.00	3.60
5	603259.SH	药明康德	6,800.00	494,768.00	3.60
6	002601.SZ	龙佰集团	25,200.00	431,676.00	3.14
7	01088.HK	中国神华	12,000.00	292,366.80	2.13
7	601088.SH	中国神华	4,300.00	134,805.00	0.98
8	601098.SH	中南传媒	39,900.00	405,783.00	2.95
9	601233.SH	桐昆股份	26,600.00	402,458.00	2.93
10	003038.SZ	鑫铂股份	11,660.00	400,521.00	2.91

6.4 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本产品报告期末未持有债券。

6.5 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本产品报告期末未持有资产支持证券。

6.6 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本产品报告期末未持有基金。

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,宁德时代新能源科技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	53,100.36	53,453.35
托管费	8,142.05	8,196.19
业绩报酬	-	-
投资顾问费	-	-

6.8.1 管理费计提规则

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:

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{【实际天数】}, \text{ 本资产管理计划年管理费率为【1.500】\%}$$

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

6.8.2 托管费计提规则

资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.230】%年费率计提。计算方法为:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{【实际天数】}, \text{ 本资产管理计划年托管费率为【0.230】\%}$$

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 业绩报酬计提规则（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。

6.8.4 投资顾问费计提规则（如有）

无

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	417.78

注:本项目交易费用包括基金、理财产品、信托、债权计划、资产管理计划等资产管理产品的认购费、申购费、赎回费以及分红或赎回产生的业绩报酬等费用，相关费用严格依据签订的所投资资产管理产品合同进行收取。所投资资产管理产品的管理费、托管费、销售服务费费用已在本计划所投资资管产品的净值中体现，不含在本项目交易费用。

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

本产品报告期末未持仓关联方发行的资管产品。

§7 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	11,662,601.80
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	11,662,601.80

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	792,079.21
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	0.00
报告期末份额总额	792,079.21

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。

§8 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。

§9 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

2023-10-30 中信证券股份有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告

2023-11-01 中信证券股份有限公司与中信证券资产管理有限公司发布《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》，按照《中信证券科创领先5号集合资产管理计划资产管理合同》约定，经与托管人协商一致，本产品的管理人自2023年11月1日起由"中信证券股份有限公司"变更为"中信证券资产管理有限公司"。

2023-11-02 关于资产管理计划管理人基本信息的公告

2023-11-17 中信证券资产管理有限公司关于私募资产管理计划关联交易及自有资金相关事项的公告

2023-11-17 关于资产管理计划直销募集渠道及相关账户更新的公告

2023-12-05 关于中信证券资产管理有限公司管理的资产管理计划管理人网站地址变更的公告

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中信证券科创领先5号集合资产管理计划说明书；
- 2、中信证券科创领先5号集合资产管理计划资产管理合同；

- 3、中信证券科创领先 5 号集合资产管理计划托管协议；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、托管人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

10.2 存放地点

北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层。

10.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95548

公司网址：<http://www.citicsam.com>

中信证券资产管理有限公司

2024 年 1 月 31 日