

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资产管理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。

§3 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:	中信证券资产管理有限公司
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	-491,761.58
2. 本期已实现收益	-636,477.32
3. 期末资产净值	52,109,250.64
4. 期末每份额净值	1.5611
5. 期末每份额累计净值	1.5611

§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1.5611元,累计单位净值1.5611元,本期集合计划复权单位净值增长率为-0.94%。

5.2 投资经理简介

曾旻睿女士,美国伊利诺伊理工学院硕士研究生。曾就职于某海外对冲基金、北京证券期货研究院。2016年加入中信证券从事FOF投资相关工作,拥有丰富的境内外基金投资经验。现任中信证券资产管理有限公司FOF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

回顾2023年,A股市场表现波动,行业轮动和主题投资成为市场结构性主线。经济复苏进程中叠加风险情绪的拖累,A股市场冲高回落后开始步入震荡行情。宽基指数全年收跌,上证指数、深证成指、创业板指分别下跌3.70%、13.54%、19.41%;小盘股表现略好于大盘

股，沪深 300 指数、中证 500 指数分别下跌 11.38%、7.42%。风格方面，价值风格优于成长风格。

权益市场全年主要分为以下五个阶段：阶段一：“强预期，强现实”（年初-春节前）。春节前受疫情防控政策的优化及地产政策的放松影响，投资者对于经济复苏的预期较高，这一阶段人民币汇率整体保持升值趋势，中美关系保持相对温和，市场总体表现强势。

阶段二：“强预期，弱现实”（春节后-4 月底）。春节后有部分投资者开始担忧复苏的持续性，之前过于乐观的经济预期在这一阶段略有修正，但整体来看，投资者对于经济复苏的预期仍然较强。从实际的经济数据来看，这一阶段的经济数据喜忧参半，人民币汇率有所贬值，中美关系因“气球事件”阶段性预冷。在此背景下，上证指数走势曲折反复。

阶段三：“弱预期，弱现实”阶段（4 月底-7 月底）。全国两会、央行货币政策一季度例会以及 4 月的国家重要会议对于经济的表述均较为乐观，但在政策方面也有较强的定力，这使得投资者对于政策强刺激的预期逐渐落空，叠加陆续公布的经济数据中有部分不及投资者预期，在 4 月国家重要会议之后，市场开始进入到“弱预期、弱现实”的状态，上证指数在这一时期的表现也相对偏弱。

阶段四：“利好频出，反应钝化”阶段（7 月底-10 月 23 日）。7 月底国家重要会议后，围绕活跃资本市场和房地产相关的政策利好频出，但市场在对于长期问题的担忧以及海外地缘和流动性的扰动下对利好产生“钝化”，甚至错误地形成了“利好越出，下跌速度反而加快”的固有印象，上证指数一度在 10 月 23 日跌至 2923.51 点，市场情绪达到阶段性“冰点”。

阶段五：“多重积极因素共振的震荡行情”阶段（10 月 24 日-至今）。中美关系缓和、中央财政发力及平准基金入市预期共同驱动市场迎来超跌反弹，但市场仍然面临着来自海外资金流出与投资者信心不足等带来的多重压力，整体逐步震荡下行。

行业表现方面，全年中信一级行业指数涨少跌多，11 个行业上涨，受 AI 概念影响，相关行业表现突出，通信（24.78%）、传媒（19.84%）行业涨幅位居全年全行业前两名，煤炭（13.39%）次之；19 个行业收跌，受经济复苏偏弱的影响，消费及地产板块表现较弱，其中消费者服务行业表现最差，下跌 41.18%，房地产（-24.80%）、电力设备及新能源（-24.65%）、建材（-20.47%）等表现靠后。

财富精选指数增强 1 号 FOF 全年在震荡的市场环境下，努力追求稳定的超额收益，今年以来上涨 4.26%，跑赢中证 500 指数 11.68%。

5.3.2 市场展望和投资策略

当前 A 股估值、成交、上市公司行为等一系列指标显示资产价格可能已经隐含了过于悲观的预期，而内外部环境正显现积极变化，国内稳增长政策仍在积极发力，美联储释放鸽派信号，环境边际变化对 A 股市场相对有利。同时，A 股整体估值处于历史较极端水平，结构估值风险充分释放，看好春季行情。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	51,829,241.61	99.39
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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	316,786.70	0.61
8	其他资产	28.27	0.00

9	合计	52,146,056.58	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

本产品报告期末未持有股票。

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

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值（元）	占资产净值的比例（%）
1	SSZ380.OF	世纪前沿指数增强专享1号	9,987,701.46	10,385,211.98	19.93
2	SJH866.OF	衍复指增3号	8,000,000.00	10,010,400.00	19.21
3	T06819.OF	信享中证500指增一号B	8,973,910.88	8,728,923.11	16.75
4	SNU636.OF	诚奇信享中证500指数增强	4,400,000.00	5,320,480.00	10.21
5	SGR157.OF	因诺天丰7号	2,356,643.56	4,546,436.76	8.72
6	SQW677.OF	衍复1000指增4号	3,304,451.05	3,941,549.21	7.56
7	T05248.OF	量锐指增1000三号B	3,293,877.85	3,577,151.35	6.86
8	SGK422.OF	珠海宽德九睦	2,440,769.59	2,891,091.58	5.55
9	SXM072.OF	曠远尊享中证1000指数增强1号	1,986,294.57	2,007,945.18	3.85
10	005148.OF	新华活期添利E	420,052.44	420,052.44	0.81

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。

6.8 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	65,692.45	65,184.90
托管费	6,569.22	6,518.47
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【0.500】%年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{【实际天数】}, \text{ 本资产管理计划年管理费率为【0.500】\%}$$

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

6.8.2 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【0.050】%年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{【实际天数】}, \text{ 本资产管理计划年托管费率为【0.050】\%}$$

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

6.8.3 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（【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。

6.8.4 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	0.00

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、销售服务费等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	33,379,146.69
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	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。

§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《中信证券财富精选指数增强1号FOF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、中信证券财富精选指数增强 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书；
- 2、中信证券财富精选指数增强 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券财富精选指数增强 1 号 FOF 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