

中信证券新智能 1 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新智能 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相关规定，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新智能 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。

§3 资产管理计划概况

名称:	中信证券新智能1号集合资产管理计划
类型:	小集合
成立日:	2018 年 1 月 30 日
报告期末份额总额:	3,600,835.23
投资目标:	在控制风险的前提下, 尽量通过选股获取阿尔法收益, 秉承绝对

	收益理念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	-366,627.42
2. 本期已实现收益	-362,558.16
3. 期末资产净值	4,287,769.05
4. 期末每份额净值	1.1908
5. 期末每份额累计净值	1.1908

§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 1.1908 元，累计单位净值 1.1908 元，本期集合计划复权单位净值增长率为-6.98%。

5.2 投资经理简介

龚嘉斌先生，清华大学硕士研究生。曾任职于中国国际金融股份有限公司、金建（深圳）投资管理中心从事投资工作。2022 年加入中信证券资产管理部，任权益投资经理。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

四季度市场依然是普跌行情，主要指数跌幅 4-7%不等，顺周期类跌幅较大，反应的还是经济的悲观预期，北向资金也持续大幅卖出。4 季度组合仓位相对稳定，保持在较高水平。考虑到宏观经济的压力，在 12 月初较大幅度减仓了白酒、建材、新能源等顺周期仓位，避免了后续的大幅下跌。本季度加配了电解铝龙头、煤炭、黄金等资源股，以及高景气的黄金零售板块，也在低位买入了少数半导体设备和医药龙头，同时增加了汽车持仓。组合整体的估值水平维持在较低水平，在 11 倍 PE 左右。

5.3.2 市场展望和投资策略

当前市场情绪依旧悲观，组合中有 1/3 以上的持仓是高股息股票，可以提供一定的防御性。除了高股息等防御性的配置，有独立景气方向的汽车和创新药在大跌之后可能会有较好的机会。市场个股估值确实都在低位，3000 点以下我们认为机会始终是大于风险的，会适当保持中高仓位，同时在波动中持续优化组合持仓。

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	3,262,580.15	75.81
	其中：股票	3,262,580.15	75.81
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	830,396.72	19.30
7	银行存款和结算备付金合计	210,475.30	4.89
8	其他资产	0.00	0.00

9	合计	4,303,452.17	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	01088.HK	中国神华	10,500.00	255,820.95	5.97
2	000651.SZ	格力电器	6,700.00	215,539.00	5.03
3	000933.SZ	神火股份	12,600.00	211,680.00	4.94
4	01658.HK	邮储银行	56,000.00	190,247.90	4.44
5	603259.SH	药明康德	2,200.00	160,072.00	3.73
6	603035.SH	常熟汽饰	7,000.00	132,090.00	3.08
7	600989.SH	宝丰能源	8,900.00	131,453.00	3.07
8	688233.SH	神工股份	3,424.00	120,832.96	2.82
9	00995.HK	安徽皖通高速公路	16,000.00	112,210.56	2.62
10	601137.SH	博威合金	7,100.00	110,263.00	2.57

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司、安徽皖通高速公路股份有限公司、江苏常熟汽饰集团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	18,434.73	20,255.99
托管费	2,457.97	2,700.82
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【0.200】%年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{【实际天数】}, \text{ 本资产管理计划年托管费率为【0.200】\%}$$

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

6.8.3 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	59.25

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	4,590,835.23
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	990,000.00
报告期末份额总额	3,600,835.23

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《中信证券新智能1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、中信证券新智能1号集合资产管理计划说明书；
- 2、中信证券新智能1号集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券新智能1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