

中信建投启航美好生活集合资产管理计划  
2023 年年度报告

管理人：中信建投证券股份有限公司

托管人：广州农村商业银行股份有限公司

送出日期：2024年03月29日

## 重要提示

本报告由资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料的真实性、准确性和完整性。

资产管理计划托管人广州农村商业银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划说明书。

本报告期间：2023年01月01日至2023年12月31日。

## 第一节 集合资产管理计划概况

### 1.1 基本资料

名称	中信建投启航美好生活集合资产管理计划
类型	混合类
成立日	2022年01月13日
报告期末份额总额	12,319,413.92
投资范围及比例	<p>本集合计划的投资范围为：权益类资产、固定收益类资产、商品及金融衍生品。</p> <p>权益类资产包括：国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，包括一级市场新股申购、参与股票增发）、港股通标的股票（包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）、存托凭证（包括在科创板上市的存托凭证）、证券投资基金（债券型和货币型证券投资基金除外）及中国证监会认可的其他标准化股权类资产。</p> <p>固定收益类资产包括：银行存款、货币市场基金、同业存单、债券逆回购、国债、企业债、公司债、可转债、可交换公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、资产支持证券、中央银行票据、债券型基金、债券正回购、经银行间市场交易商协会批准在册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、证券公司短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持票据等）以及其他债券。</p> <p>商品及金融衍生品包括：在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的股指期货。</p> <p>本计划可以参与证券回购业务。</p> <p>（1）固定收益类的投资比例为总资产的 0-80%；</p> <p>（2）权益类资产的投资比例为总资产的 20-100%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品持仓合约价值占总资产的比例 0-80%。</p>
业绩比较基准	无
管理费率（%）	1
管理费计提方式	每日计提
管理费支付方式	按季支付
托管费率（%）	0.02
托管费计提方式	每日计提
托管费支付方式	按季支付
业绩报酬计提时点	资产管理计划分红时计提，资产管理计划投资者赎回时计提，资产管理计划到期计提

业绩报酬计提基准	8%
业绩报酬计提方式	资产管理计划分红时计提, 资产管理计划投资者赎回时计提, 资产管理计划到期计提
业绩报酬支付方式	托管人收到业绩报酬划付指令之后支付

## 1.2 管理人

名称	中信建投证券股份有限公司
注册地址	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址	北京市朝阳区光华路10号
法定代表人	王常青
联系地址	北京市东城区朝内大街188号
联系电话	400-888-8108
传真	010-84651186
网址	<a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>

## 1.3 托管人

名称	广州农村商业银行股份有限公司
办公地址	广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
法定代表人(负责人或授权人)	蔡建
托管部门联系人	李中良
联系电话	020-22389371

## 1.4 注册登记机构

名称	中信建投证券股份有限公司
办公地址	北京市朝阳区光华路10号
公司网址	<a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>

## 第二节 主要财务指标、集合资产管理计划净值表现及收益分配情况

### 2.1 主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	-2,486,734.37
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-856,565.07
每份额本期已实现净收益	-0.0707
期末资产净值	11,374,022.61

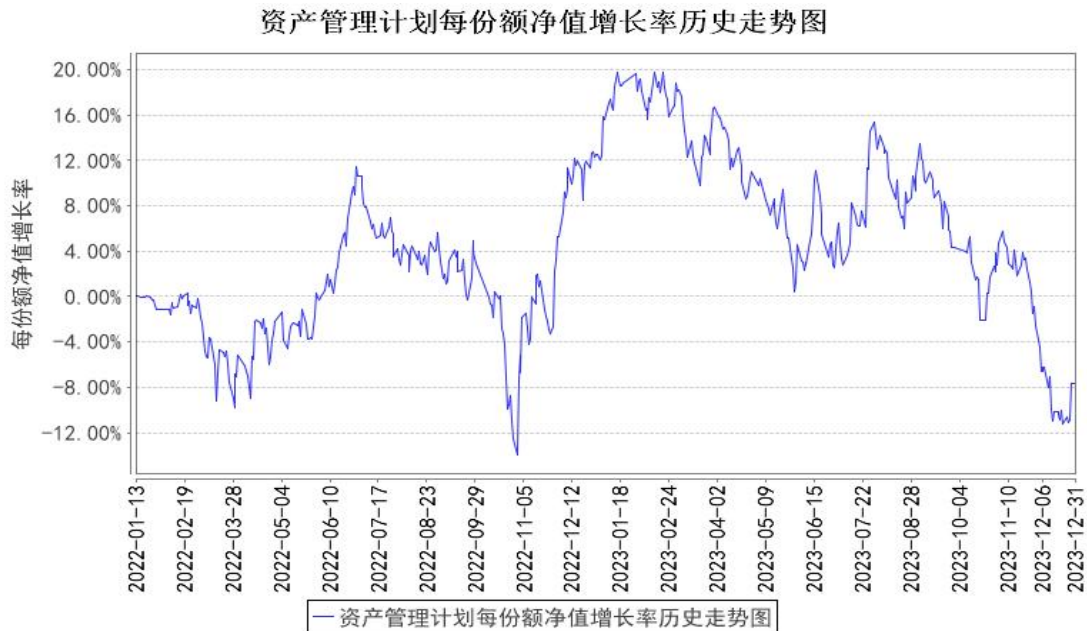
期末每份额净值	0.9233
期末每份额累计净值	0.9233
期末杠杆率	101.17%

注:每份额本期已实现净收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额/平均份额

## 2.2 本集合计划历史各时间段净值增长率

阶段	净值增长率
过去3个月	-11.50%
过去6个月	-10.01%
过去一年	-17.91%
成立至2023年12月31日	-7.67%

## 2.3 集合计划每份额净值增长率历史走势图（2022年01月13日-2023年12月31日）



## 2.4 本期计划收益分配情况

本资产管理计划报告期末未进行收益分配。

## 第三节 管理人履职报告

### 3.1 投资经理简介

朱福建，南开大学税务专业硕士，具备基金从业资格。2018年7月2日加入中信建投证券股份有限公司资产管理部，历任中信建投证券股份有限公司资产管理部大消费研究员，

启航美好生活、启航成长 1 号资产管理计划投资经理。

### 3.2 投资经理工作报告

#### 3.2.1 市场回顾和投资操作

本报告期产品保持高仓位运作，调整持仓结构，提高优质公司的持股比例。2023 年消费指数跌幅较大，市场极度悲观的预期使得消费行业整体估值水平到了历史极低的位置。

#### 3.2.2 市场展望和投资策略

2023 年市场从年初的放开后的乐观到年底的极度悲观，上市公司股价经历了大幅下跌。2023 年消费的恢复不及预期，尤其是假期的人均消费还没有回到 2019 年的水平，CPI 的连续低迷加剧了对于通缩的担忧，加上部分消费公司需要去库存，上市公司基本面和消费环境双重压力使得公司估值持续低估。2023 年是消费复苏的第一年，现阶段的股价已经反映了大部分的悲观预期，站在当前位置没必要更加悲观。现阶段回归投资本质，未来向好的边际变化将会带来价值回归。经济的恢复是一个缓慢的过程，中间难免会反复，重要的是方向要正确。公司的业绩才是决定股价长期上涨的根本动力，利用好市场先生给的低估机会。

## 第四节 财务会计报告

### 4.1 资产负债表

单位：元

资产	期末余额	负债和净资产	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
货币资金	895,848.21	短期借款	-
结算备付金	17,645.04	交易性金融负债	-
存出保证金	13,749.49	衍生金融负债	-
衍生金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
应收清算款	177,321.58	应付管理人报酬	53,998.47
应收利息	-	应付托管费	613.87
应收股利	-	应付销售服务费	-
应收申购款	-	应付投资顾问费	-
买入返售金融资 产	-	应交税费	-
发放贷款和垫款	-	应付清算款	32,210.77
交易性金融资产	10,402,256.80	应付赎回款	-
债权投资	-	应付利息	-

其他债权投资	-	应付利润	-
其他权益工具投资	-	其他负债	45,975.40
长期债权投资	-	负债合计	132,798.51
其他资产	-	净资产：	-
	-	实收资金	12,319,413.92
	-	其他综合收益	-
	-	未分配利润	-945,391.31
	-	净资产合计	11,374,022.61
资产总计	11,506,821.12	负债和净资产总计	11,506,821.12

## 4.2 利润表

单位：元

项目	本期金额
一、营业总收入	-2,329,445.93
利息收入	5,473.68
投资收益（损失以“-”填列）	-704,750.31
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-1,630,169.30
汇兑收益（损失以“-”填列）	-
其他业务收入	-
二、营业总支出	157,288.44
管理人报酬	154,018.86
托管费	2,614.28
销售服务费	-
投资顾问费	-
利息支出	-
信用减值损失	-
税金及附加	155.30
其他费用	500.00
三、利润总额	-2,486,734.37
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,486,734.37
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-2,486,734.37

## 4.3 净资产变动表

单位：元

项目	本年金额			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末余额	11,500,633.35	-	1,434,251.59	12,934,884.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本年年初余额	11,500,633.35	-	1,434,251.59	12,934,884.94
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	818,780.57	-	-2,379,642.90	-1,560,862.33
（一）综合收益总额	-	-	-2,486,734.37	-2,486,734.37
（二）产品持有人申购和赎回	818,780.57	-	107,091.47	925,872.04
其中：产品申购	1,818,808.35	-	281,191.65	2,100,000.00
产品赎回	-1,000,027.78	-	-174,100.18	-1,174,127.96
（三）利润分配	-	-	-	-
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本年年末余额	12,319,413.92	-	-945,391.31	11,374,022.61

#### 4.4 报表附注

##### 4.4.1 资产管理产品的基本情况

本计划基本情况参见本报告第一节。

##### 4.4.2 财务报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）和在财务报表附注四所列示的中国证券监督管理委员会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

##### 4.4.3 遵循企业会计准则的声明

本计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

##### 4.4.4 重要会计政策和会计估计

###### 一、会计年度

本计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

###### 二、记账本位币

本计划的记账本位币为人民币。

###### 三、金融工具



金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### （一）金融工具的分类

1. 金融资产——根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，金融资产于初始确认时分类为：(1)以摊余成本计量的金融资产；(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

##### （1）债务工具

本计划持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：本计划管理此类金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且此类金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：本计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。

##### （2）权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本计划将对没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益。

2. 金融负债——金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### （二）初始确认和后续计量

##### 1. 初始确认

金融资产或金融负债于本计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；以摊余成本计量的金融资产和负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

##### 2. 减值

本计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值

的概率加权金额，确认预期信用损失。

本计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

### 3. 终止确认

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 4. 衍生金融工具

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或负债进行相应会计处理，初始确认时，衍生金融工具以公允价值计量。当公允价值为正数时，作为资产反映；公允价值为负数时，作为负债反映。后续计量时，因公允价值变动而产生的利得或损失，计入当期损益。

### 5. 金融工具的公允价值确认

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或发行人/融资主体发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

## 四、实收资金

实收资金为对外发行计划所募集的资本金额。本计划的份额面值为每份人民币1.00元。由于参与和退出引起的实收资金变动分别于计划参与确认日及计划退出确认日确认。

## 五、损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在参与或退出计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在参与或退出计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于计划参与确认日或计划退出确认日确认。本计划未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润”。

## 六、收入/(损失)的确认和计量

### (1) 利息收入

以摊余成本计量的金融资产在持有期间按实际利率计算的利息扣除由管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

### (2) 投资收益

投资收益包括各项投资产生的股息收入、分红收入、交易性金融资产中债券投资及资产支持证券投资在持有期间按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认的投资收益、金融资产/负债处置损益，以及其他除交易性金融资产由于公允价值变动形成的应计入公允价值变动损益之外的已实现利得或损失。

### (3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益是指交易性金融资产以及交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税。

## 七、费用的确认和计量

业绩报酬、固定管理费和托管费在费用涵盖期间按计划合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 八、收益分配政策

同一种类计划的每一份额享有同等分配权。本计划收益分配基准日的份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。本计划收益将按照计划合同约定的默认方式进行分配。

#### 4.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本资产管理计划本报告期未发生会计估计变更，在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 4.4.6 管理费

##### 4.4.6.1 资产管理计划管理费金额

项目	本期
当期发生的资产管理计划应支付的基本管理费	130,713.56
当期发生的资产管理计划应支付的超额管理费	23,305.30
暂估超额管理费	-

##### 4.4.6.2 管理费的相关说明

本资产管理计划管理费包含基本管理费和超额管理费（如有），计提标准、计提方式以及支付方式详见本报告第一节。暂估超额管理费（如有）为管理人根据本报告期末财务数据模拟计算的超额管理费。投资者实际承担的管理费按照合同约定方式计算并支付，与暂估超额管理费可能存在差异。

#### 4.4.7 公允价值

##### 4.4.7.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 4.4.7.2 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
第一层次	10,402,256.80
第二层次	-
第三层次	-
合计	10,402,256.80

#### 4.4.7.3 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、卖出回购金融资产款、其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 4.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 4.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

##### 4.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本计划未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 4.4.9 关联方关系及关联交易

##### 4.4.9.1 关联方关系

关联方名称	与本资产管理计划的关系
中信建投证券股份有限公司	资产管理计划管理人
广州农村商业银行股份有限公司	资产管理计划托管人

##### 4.4.9.2 关联方交易

###### 4.4.9.2.1 应支付的关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	当期佣金	期末应付佣金余额
中信建投证券股份有限公司	143,861.89	45,975.40

###### 4.4.9.2.2 资产管理计划管理费

单位：人民币元

项目	本期
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	130,713.56

###### 4.4.9.2.3 资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期
当期发生的基金应支付的托管费	2,614.28

###### 4.4.9.2.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	期末余额	当期利息收入
广州农村商业银行股份有限公司	895,792.06	3,741.64

#### 4.4.10 金融工具风险及管理

##### 4.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本计划管理人建立了由风险管理部、稽核审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、稽核审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

本计划管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本计划的投资目标，结合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 4.4.10.2 信用风险

信用风险是指资产管理计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者资产管理计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致资产管理计划资产损失和收益变化的风险。本资产管理计划管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。

#### 4.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指无法通过变现资产等途径以合理成本及时获得充足资金，用于偿付到期债务、满足计划委托人赎回需求、履行其他支付义务和满足正常业务开展的其他资金需求的风险。本计划的流动性风险一方面来自于委托人于约定开放日要求赎回本计划计划，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

流动性风险的管理目标是建立科学完善的流动性风险管理体系，对流动性风险进行有效识别、计量、监测和控制，确保流动性需求能够及时以合理成本得到满足。

针对因兑付赎回资金导致的流动性风险，本计划对投资范围、投资对象和投资比例有着明确约定，管理人将合理安排现金类资产比例，托管人根据合同约定监督本计划的投资比例，以保持组合在开放期资产流动性，尽可能满足委托人的退出需求。

#### 4.4.10.4 市场风险

市场风险是指计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素

的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

(1) 利率风险

利率风险是指计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本计划的管理人定期对本计划所投资的利率敏感性金融工具进行监控，以对该风险进行管理。

(2) 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本计划无重大外汇风险。

(3) 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。

本计划对投资范围和投资比例进行明确限制，通过承担适当的市场风险以获取投资收益。管理人将基于宏观经济和上市公司的深入研究，应用相关投资经验和投资技术，在本计划合同和说明书约定的范围内，制定合理的投资策略，并及时根据市场发展情况进行调整，减少市场风险对投资收益的影响。托管人将根据计划合同、说明书及托管协议的约定，对管理人投资行为进行监督，降低因管理人违反说明书规定投资而超出本计划承受范围之外的市场风险。

4.4.11 使用侧袋机制的说明

本计划未使用侧袋机制。

## 第五节 投资组合报告

### 5.1 资产组合情况

名称	市值(元)	占总资产比例(%)
股票	10,402,256.80	90.40
债券	-	-
基金	0.00	0.00
银行存款及清算备付金合计	913,493.25	7.94
其他资产	191,071.07	1.66
合计	11,506,821.12	100.00

### 5.2 按券种分类的债券投资组合

项目名称	市值(元)	占总资产比例(%)
国债	0.00	0.00
金融债	0.00	0.00
企业债	0.00	0.00

公司债	0.00	0.00
可转债	0.00	0.00
其他债券	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

### 5.3 报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例（%）
1	600519 SH	贵州茅台	1,100.00	1,898,600.00	16.69
2	000858 SZ	五粮液	10,300.00	1,445,193.00	12.71
3	000568 SZ	泸州老窖	8,000.00	1,435,360.00	12.62
4	600809 SH	山西汾酒	4,100.00	945,993.00	8.32
5	00700 HG	腾讯控股	3,100.00	824,805.20	7.25
6	002304 SZ	洋河股份	6,800.00	747,320.00	6.57
7	02020 HG	安踏体育	4,000.00	274,584.66	2.41
8	00168 HG	青岛啤酒股份	4,000.00	189,943.71	1.67
9	600600 SH	青岛啤酒	2,500.00	186,875.00	1.64
10	000651 SZ	格力电器	5,500.00	176,935.00	1.56

### 5.4 报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名债券明细

本资产管理计划报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名基金明细

本资产管理计划报告期末未持有基金。

### 5.6 报告期末按市值占资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本资产管理计划报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按市值占资产净值比例大小排序的权证明细

本资产管理计划报告期末未持有权证。

### 5.8 期末市值占资产管理计划资产净值前十名期货明细



本资产管理计划报告期末未持有期货。

#### 5.9 期末市值占资产管理计划资产净值前十名场外期权明细

本资产管理计划报告期末未持有期权。

#### 5.10 期末市值占资产管理计划资产净值前十名收益互换明细

本资产管理计划报告期末未持有收益互换。

#### 5.11 期末市值占资产管理计划资产净值前十名其他非标准化资产明细

本资产管理计划报告期末未持有其他非标准化资产。

#### 5.12 其他财务报表事项

##### 5.12.1 期末持有的处于转股期的可转换债券/可交换债券明细

本资产管理计划报告期末未持有处于转股期的可转换债券/可交换债券。

##### 5.12.2 其他资产

项目名称	市值(元)	占总资产比例(%)
资产支持证券	0.00	0.00
存出保证金	13,749.49	0.12
应收证券清算款	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
其他	177,321.58	1.54
合计	191,071.07	1.66

## 第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	11,500,633.35
报告期间总参与份额	1,818,808.35
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	1,000,027.78
报告期末份额总额	12,319,413.92

## 第七节 重要事项提示

### 一、本资管计划管理人及托管人相关事项

1、在本报告期内，本资管计划管理人变更办公地址，变更后主要办公地址及邮政编码：北京市朝阳区光华路10号，100020。

此外，公司资产管理业务主要办公地址及邮政编码目前维持不变：北京市东城区朝阳门内大街2号，100010；北京市东城区朝内大街188号，100010。

在本报告期内，托管人的办公地址没有发生变更。

### 二、本资管计划相关事项

1、在本报告期内，本资管计划未发生重大关联交易。

2、在本报告期内，本资管计划未发生投资经理变更。

3、在本报告期内，未发生涉及本资管计划的重大诉讼、仲裁、重要财产纠纷事项。

4、在本报告期内，本资管计划未发生影响投资者权益的其他重大事项。

## 第八节 托管人履职报告

本报告期内，广州农村商业银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对本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》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法律法规、资产管理计划和托管协议的有关规定，不存在损害资产管理计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了资产管理计划托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法律法规、资产管理计划和托管协议的有关规定，对本资产管理计划的投资运作、资产管理计划资产净值计算、资产管理计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本资产管理计划管理人存在损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

## 第九节 备查文件目录

- 1、本资产管理计划资产管理合同及相关协议；
- 2、定期报告，包括季度报告和年度报告；
- 3、管理人业务资格批件、营业执照；
- 4、托管人业务资格批件、营业执照；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

查询网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

热线电话：4008895587

