

# 中电投先融（上海）资产管理有限公司 创盈 1 号集合资产管理计划 2022 年年度资产管理报告

管理人：中电投先融（上海）资产管理有限公司  
托管人：兴业证券股份有限公司  
报告送出日期：2023 年 4 月 27 日



## 重要提示

资产管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

资产托管人兴业证券股份有限公司根据本资产管理计划资产管理合同约定，于2023年2月6日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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

资产托管人兴业证券股份有限公司根据本资产管理计划资产管理合同约定，于2023年4月24日出具了对应的托管报告。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作资产管理计划，但不保证资产一定盈利。

本报告中财务资料经【大信会计师事务所】审计。

本报告期自2022年1月1日起至12月31日止。

## 一、资产管理计划概况

### （一）基本情况

资产管理计划名称	中电投先融创盈1号集合资产管理计划
资产管理计划编号	SQS095
资产管理计划管理人	中电投先融（上海）资产管理有限公司
资产管理计划托管人	兴业证券股份有限公司
资产管理计划运作方式	本资产管理计划为开放式运作。
资产管理计划成立日	2021年5月25日
报告期末资产管理计划份额总额	11017388.24（单位：份）
投资目标	本资产管理计划主要采取多策略投资方法，从多个角度搭建策略体系，制定多维化投资策略，多方向操作，寻求风险调整后的高收益。
投资策略	投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产80%；投资于股票等股权类资产的比例低于资产管理计划总资产20%。
产品类别	固定收益类
风险收益特征	本计划的投资风险收益特征为R2（中低风险等级）。

### （二）管理人和托管人

项目	管理人	托管人
名称	中电投先融（上海）资产管理有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	蒋一舟
	联系电话	021-63325000
	电子邮箱	xram@spicam.net
传真	021-63326099	0591-38507797
注册地址	上海市黄浦区中山南路268号1号楼17层	福州市湖东路268号证券大厦
办公地址	上海市黄浦区中山南路268号新源广场1号楼17层	福州市湖东路268号证券大厦
邮政编码	200010	350003
法定代表人	倪江	杨华辉

### （三）其他机构

项目	名称	办公地址
会计师事务所	大信会计师事务所	北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室
注册登记机构	兴业证券股份有限公司	福州市湖东路268号证券大厦
外包机构	兴业证券股份有限公司	福州市湖东路268号证券大厦
代销机构（如有）	上海天天基金销售有限公司	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
	上海中正达广基金销售有限公司	上海市徐汇区龙兰路277号1号楼

		1203、1204 室
投资顾问（如有）	无	-

## 二、管理人履职报告

### （一）管理人简介

中电投先融（上海）资产管理有限公司于 2015 年 10 月成立于上海，是隶属于国家电力投资集团资本控股有限公司的专业化资产管理公司，注册资本金 3.5 亿元。

### （二）投资经理简介

本资产管理计划投资经理为郑一宁、陈国栋。

投资经理的从业简历、学历及兼职情况如下：

郑一宁，中山大学分析化学理学博士、上海交通大学工商管理硕士，具有 9 年二级市场丰富投研经验，历任德邦证券研究所医药研究员、研究所副所长（主持工作）、德邦证券资产管理总部董事总经理、投资主办，现任中电投先融（上海）资产管理有限公司研究总监。

陈国栋，华东理工大学应用化学理学博士，具备 10 年投资研究经验，历任湘财证券研究员、国融证券研究员、德邦证券研究员及投资经理、德邦星盛资本投资经理、德邦基金资深研究员。现任中电投先融（上海）资产管理有限公司高级投资经理。

投资经理取得了基金从业资格、通过期货从业资格考试，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。专职于中电投先融（上海）资产管理有限公司，除在中电投先融（上海）资产管理有限公司任职之外，不存在其他兼职情形。

### （三）交易相关制度执行情况

本报告期内，管理人监控异常交易行为，严格执行公平交易制度，公平对待管理的各资产管理计划。

#### （四）本资产管理计划运作合规守信情况

本报告期内，管理人严格遵循《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关法律法规、监管部门的相关规定和资管合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理资产管理计划资产。

本报告期内，本资产管理计划整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，未发生损害投资者利益的行为。

### 三、托管人履职报告

本报告期内，托管人严格遵守法律法规、监管规定、自律规则的规定以及资产管理合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，托管人按照国家有关规定、资产管理计划合同、托管协议和其他有关规定，对本资产管理计划的资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核，对本资产管理计划的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，托管人复核审查了本资产管理计划的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

具体情况详见托管人出具的托管报告。

## 四、主要财务指标、净值表现及利润分配情况

### （一）产品主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	485,492.28	390,264.91	-
本期利润	548,751.92	390,264.91	-
期末数据和指标	2022年末	2021年	2020年
期末可供分配利润	852,107.69	455,225.96	-
期末可供分配基金份额利润	0.0773	0.0371	-
期末基金资产净值	11,934,081.44	12,740,681.57	-
期末基金份额净值	1.0832	1.0371	-
累计期末指标	2022年末	2021年	2020年
计划份额累计净值增长率	8.32%	3.71%	-

### （二）产品净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差 (选填)	业绩比较基准收 益率(选填)	业绩比较基准收 益率标准差(选填)
当年	4.45	-	-	-
自基金合同 生效起至今	8.32	-	-	-

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

### （三）产品利润分配情况

年度	每份计划份额分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2022	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2020	0.0000	0.00	0.00	0.00	

### （四）产品费用说明

费用种类	计提基准、计提 方式和支付方式	报告期内计提情况	报告期内支付情况
管理费	0.5%/年，按日计 提，按季度收取	76027.68	76027.68

托管费	0.025%/年，按日计提，按季度支付	3801.37	3801.37
外包服务费	0.025%/年，按日计提，按季度支付	3801.37	3801.37
业绩报酬	本资管计划一年提取业绩报酬的次数不超过2次，间隔不少于6个月； $Y1(R) = A \times P \times (R - 6\%) \times 40\% \times T / 365$	-	-
投资顾问费(如有)	无	-	-
审计费(如有)	年度审计费用5500元/次	5500	5500

### (五) 杠杆运用情况 (如有)

截至本报告期末，本资产管理计划杠杆率为 100.20%。

## 五、份额变动情况

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	12285455.61
报告期期间资产管理计划总申购份额	8048030.90
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	9316098.27
报告期期间资产管理计划拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末资产管理计划份额总额	11017388.24

## 六、投资组合报告

### (一) 期末资产组合情况

单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	6,977.75
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-



资	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
境内证券投资规模	结算备付金	99,091.38
	存出保证金	-
	股票投资	717,140.00
	债券投资	8,535,433.10
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	8,535,433.10
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	1,000,100.02
	其中：货币基金	1,000,100.02
	期货及衍生品交易保证金	-
	买入返售金融资产	1,599,551.46
	其他证券类标的	-
资管计划投资	商业银行理财产品投资	-
	信托计划投资	-
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	-
	保险资产管理计划投资	-
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	-
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	-
	私募基金产品投资	-
	未在协会备案的合伙企业份额	-
另类投资	另类投资	-
境内债权类投资	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-
	应收账款投资	-
	各类受（收）益权投资	-
	票据（承兑汇票等）投资	-
	其他债权投资	-
境外投资	境外投资	-
其他资产	其他资产	应收股利#51.68;
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-



其他融资总额	-
--------	---

## （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

单位：元

序号	行业类别	公允价值	占资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	401,540.00	3.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	196,200.00	1.64
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	119,400.00	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	717,140.00	6.01

## （三）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

单位：元

行业类别	公允价值（人民币）	占资产净值比例（%）
港股通	-	-
合计	-	-

## 七、年度财务报告

### （一）资产负债表

单位：元

资产	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
----	----------------------	-----------------------

资产：		
银行存款	6,977.75	159.36
结算备付金	-	-
存出保证金	99,091.38	152.80
交易性金融资产	10,252,673.12	-
其中：股票投资	717,140.00	-
基金投资	1,000,100.02	-
债券投资	8,535,433.10	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,599,551.46	12,702,402.90
应收证券清算款	-	-
应收利息	-	58,552.55
应收股利	51.68	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,958,345.39	12,761,267.61
负债和所有者权益	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	15,992.20	14,454.33
应付托管费	799.61	722.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	6,672.53	4,686.27
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	799.61	722.72
负债合计	24,263.95	20,586.04
所有者权益：		
实收基金	11,017,388.24	12,285,455.61
未分配利润	916,693.20	455,225.96
所有者权益合计	11,934,081.44	12,740,681.57
负债和所有者权益总计	11,958,345.39	12,761,267.61

## （二）利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2022-01-01 至 2022-12-31	2021-05-25 至 2021-12-31
一、收入	674,290.95	427,131.40
1. 利息收入	119,483.08	425,168.32
其中：存款利息收入	25,356.24	6,290.47
债券利息收入	-	0.00
资产支持证券利息收入	-	0.00
买入返售金融资产收入	96,950.68	431,444.39
其他利息收入	-2,823.84	-12,566.54
2. 投资收益（损失以“-”填列）	504,817.20	1,963.08
其中：股票投资收益	47,506.00	0.00
基金投资收益	41,192.52	0.00
债券投资收益	415,650.38	0.00
资产支持证券投资收益	-	0.00
贵金属投资收益	-	0.00
衍生工具收益	-	0.00
股利收益	468.30	1,963.08
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”填列）	63,488.20	0.00
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-13,497.53	0.00
减：二、费用	125,539.03	36,866.49
1. 管理人报酬	76,027.68	32,144.12
其中：固定管理费	76,027.68	32,144.12
业绩报酬	-	0.00
2. 托管费	3,801.37	1,607.20
3. 销售服务费	-	0.00
4. 外包服务费	3,801.37	1,607.20
5. 交易费用	34,221.50	0.00
6. 利息支出	-	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	-	0.00
7. 其他费用	7,687.11	1,507.97
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	548,751.92	390,264.91
减：所得税费用	-	0.00
四、净利润 （净亏损以“-”号填列）	548,751.92	390,264.91

## （三）所有者权益表

单位：元

项目	本期
----	----

	2022-01-01 至 2022-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,285,455.61	455,225.96	12,740,681.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	548,751.92	548,751.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,268,067.37	-87,284.68	-1,355,352.05
其中：1. 基金申购款	8,048,030.90	351,969.10	8,400,000.00
2. 基金赎回款	-9,316,098.27	-439,253.78	-9,755,352.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,017,388.24	916,693.20	11,934,081.44
项目	上年度可比期间 2021-5-25 至 2021-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,000,416.66	-	10,000,416.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	390,264.91	390,264.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,285,038.95	64,961.05	2,350,000.00
其中：1. 基金申购款	2,285,038.95	64,961.05	2,350,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	12,285,455.61	455,225.96	12,740,681.57

## 八、资产管理计划的重大事项说明

### （一）关联交易事项

本报告期内，本计划未发生关联交易。

### （二）合同变更事项

截止报告日，对资产管理合同的“利益冲突及关联交易”章节进行变更，明确了重大关联交易的含义、细化了披露流程，已于2022年3月11日生效。具体情况请见管理人于2022年3月4

日于官网发布的《中电投先融（上海）资产管理有限公司关于明确重大关联交易定义及相关披露流程的告知书》临时信息披露公告(官网地址：[www.spicam.cn](http://www.spicam.cn))。

经与托管人协商一致，我司管理的“中电投先融创盈1号集合资产管理计划”，自2022年4月14日起调整固定收益品种估值方法。具体情况请见管理人于2022年4月13日于官网发布的《关于“中电投先融创盈1号集合资产管理计划”调整固定收益品种估值方法的公告》临时信息披露公告(官网地址：[www.spicam.cn](http://www.spicam.cn))。对资产管理合同的“利益冲突及关联交易”章节进行变更，明确了重大关联交易的含义、细化了披露流程，已于2022年3月11日生效。具体情况请见管理人于2022年3月4日于官网发布的《中电投先融（上海）资产管理有限公司关于明确重大关联交易定义及相关披露流程的告知书》临时信息披露公告(官网地址：[www.spicam.cn](http://www.spicam.cn))。

根据业务需要，经中电投先融（上海）资产管理有限公司研究，决定对投资经理作如下调整：何庭瑶女士不再担任本计划的投资经理，聘任陈国栋先生为本计划的投资经理。自2022年04月20日起，本计划投资经理由郑一宁女士、陈国栋先生两人共同担任。具体情况请见管理人于2022年04月13日于官网发布的《关于中电投先融创盈1号集合资产管理计划投资经理变更的公告》临时信息披露公告(官网地址：[www.spicam.cn](http://www.spicam.cn))。

根据业务需要，经中电投先融（上海）资产管理有限公司研究，决定对投资经理作如下调整：陈国栋先生不再担任本计划的投资经理。自2022年07月29日起，本计划投资经理由郑一宁女士一人担任，具体情况请见管理人于2022年07月22日于官网发

布的《关于中电投先融创盈1号集合资产管理计划投资经理变更的公告》临时信息披露公告(官网地址：[www.spicam.cn](http://www.spicam.cn))。

### （三）重要投资事项

本报告期内，未发生重要投资事项。

### （四）其他

本报告期内，管理人法定代表人于2022年10月14日变更，具体情况请见管理人于2022年10月18日于官网发布的《关于中电投先融（上海）资产管理有限公司法定代表人变更的公告》临时信息披露公告(官网地址：[www.spicam.cn](http://www.spicam.cn))。

## 九、自有资金、关联方和其他相关人员投资本资管计划情况

### （一）自有资金持有资管计划份额情况及交易明细

截至报告期末，管理人自有资金持有本资管计划2000083.33份，占总份额的18.15%，符合监管要求及资产管理合同约定。

本报告期内，管理人自有资金未进行本资产管理计划的申购、赎回或转让、受让等交易。

### （二）关联方和其他相关人员持有本资管计划份额情况及交易明细

截至本报告期末，除上一款所述自有资金投资情况外，未有关联方和其他相关人员持有本资管计划。

本报告期内，关联方和其他相关人员未进行本资产管理计划的申购、赎回或转让、受让等交易。

## 十、其他需要说明的情况

2022年12月2日，由于投资者赎回部分份额，S20 盘旅（151607.SH，以下简称“标的债券”）持仓市值占当日产品净值的比例升至25.19%，超出《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》“一个集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的25%”的投资比例限制。截至报告期末，该超限情况依然存在。管理人已于报告期内对标的债券行使回售权，标的债券回售金额已于2023年1月9日到账，至此，该超限情况已不复存在。

除此外，本报告期内，本资产管理计划无其他情况需要说明。

投资者对本报告如有疑问，可咨询管理人。管理人客户服务电话：400-820-8477。

中电投先融（上海）资产管理有限公司

2023年4月27日