

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
2023 年第二季度资产管理报告

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 7 月 21 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7月11日复核了本资管计划中的财务指标、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年4月1日起至6月30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 | 13329723.63（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。

托管人复核审查了本资管计划中的财务指标、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。

四、主要财务指标、净值表现、利润分配、费用等情况

（一）主要财务指标

单位：元

| 项目 | 2023年4月1日至2023年6月30日 |
|--------------|----------------------|
| 本期已实现收益 | 246,301.03 |
| 本期利润 | 269,955.30 |
| 期末资产管理计划资产净值 | 14,959,171.24 |
| 期末资产管理计划份额净值 | 1.1222 |

（二）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 收益率标准率 (选填) |
|----|--------------|-------------------|--------------------|--------------------------|
| | | | | |

| | | | | |
|--------------|-------|------|------|------|
| 当季 | 2.10 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自资产管理计划成立起至今 | 12.22 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末累计净值

（三）资产管理计划的收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划无收益分配情况。

（四）资产管理计划的费用情况

| 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 | 16292.10 | 16292.10 |
| 托管费 | 0.025%/年，按日计提，按季度支付 | 814.63 | 814.63 |
| 外包服务费 | 0.025%/年，按日计提，按季度支付 | 814.63 | 814.63 |
| 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） | - | - | - |
| 审计费（如有） | - | - | - |

（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 100.16%。

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 | 7236047.37 |
| 报告期期间资产管理计划总申购份额 | 8500191.08 |
| 减：报告期期间资产管理计划总赎回份额 | 2406514.82 |
| 报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 报告期期末资产管理计划份额总额 | 13329723.63 |

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 | 7,106.83 | |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 股权投资 | - |
| | 其中：优先股 | - |
| | 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 | - |
| | 存出保证金 | 575,663.58 |
| | 股票投资 | 1,145,350 |
| | 债券投资 | 12,255,734.63 |
| | 其中：银行间市场债券 | - |
| | 其中：利率债 | - |
| | 其中：信用债 | 12,255,734.63 |
| | 资产支持证券 | - |
| | 基金投资（公募基金） | 441.94 |
| | 其中：货币基金 | 441.94 |
| | 期货及衍生品交易保证金 | - |
| | 买入返售金融资产 | 999,800.3 |
| 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#0.51； |
| 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 0 | 0 |
| B | 采矿业 | 50,200.00 | 0.34 |
| C | 制造业 | 794,050.00 | 5.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 218,700.00 | 1.46 |
| E | 建筑业 | 0 | 0 |
| F | 批发和零售业 | 0 | 0 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 0 | 0 |
| H | 住宿和餐饮业 | 0 | 0 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 0 | 0 |
| J | 金融业 | 0 | 0 |
| K | 房地产业 | 82,400.00 | 0.55 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| L | 租赁和商务服务业 | 0 | 0 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 0 | 0 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 0 | 0 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0 | 0 |
| P | 教育 | 0 | 0 |
| Q | 卫生和社会工作 | 0 | 0 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 0 | 0 |
| S | 综合 | 0 | 0 |
| | 合计 | 1,145,350.00 | 7.66 |

（三）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

七、资产管理计划涉及投资者利益的重大事项说明

（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

本报告期内，未发生合同变更事项。

（三）重要投资事项

本报告期内，未发生重要投资事项。

八、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 15.00%。

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。

九、其他需要说明的情况

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7月21日