

# 中信建投启航美好生活集合资产管理计划

## 2024年第2季度报告

### 第一节 重要提示

本报告由资产管理计划管理人编制。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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2024年04月01日至2024年06月30日

### 第二节 资产管理计划概况

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>

	本计划可以参与证券回购业务。 (1) 固定收益类的投资比例为总资产的 0-80%； (2) 权益类资产的投资比例为总资产的 20-100%； (3) 商品及金融衍生品持仓合约价值占总资产的比例 0-80%。
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。
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
注册登记机构	中信建投证券股份有限公司

### 第三节 主要财务指标和资产管理计划净值表现

#### 3.1 主要财务指标 (单位: 人民币元)

本期利润	-821,808.52
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	438,996.62
每份额本期已实现净收益	0.0356
期末资产净值	10,779,796.10
期末每份额净值	0.8750
期末每份额累计净值	0.8750
期末杠杆率	102.70%

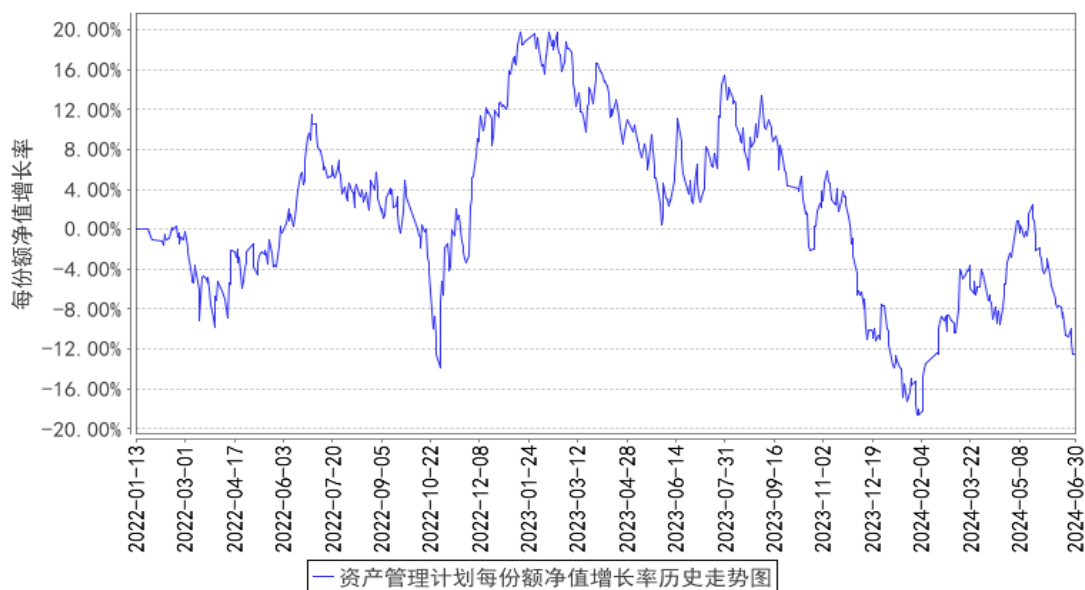
注: 每份额本期已实现净收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额/平均份额

#### 3.2 本期每份额净值增长率

阶段	净值增长率 (%)	份额净值增长率标准差 (%)
本期初到本期末	-7.08	1.16

#### 3.3 资产管理计划每份额净值增长率历史走势图 (2022 年 01 月 13 日-2024 年 06 月 30 日)

资产管理计划每份额净值增长率历史走势图



### 3.4 本期计划收益分配情况

注：本资产管理计划报告期未进行收益分配。

## 第四节 管理人履职报告

### 4.1 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。

### 4.2 投资经理工作报告

#### 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。二季度消费指数跌幅较大，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，从股息率的角度看待现有消费公司的价值普遍有4%的水平，到了预计足够低的阶段。

#### 2、市场展望和投资策略

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。现在的股价超低水平更多的是信心不足和资金面的行为，所以面对这样的市场，纠结于短期还有多少下跌空间、什么时候见底、什么时候会起来、就不是那么重要了，的确未来的经济形势很难判断，不宜盲目乐观。但是不可否认的是股市的运行规律并不总是和经济正相关的，资金、情绪、趋势等等都会造成市场极度的乐观和极度的悲观，股价也是大幅波动。这个时候要做坚持

做长期正确的事情，回归投资的本质，以长期的角度看待持有公司的价值。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。

#### 4.3 风险控制报告

中信建投证券股份有限公司严格遵守法律法规规定，并针对本资产管理计划的运作特点，建立完善的风险监测指标体系，进行日常监控与分析，并及时报告业务运作中的风险状况和风险控制效果。

报告期内，本资产管理计划运作合法、合规，未出现违反相关规定的状况，未发生损害投资者利益的行为。

### 第五节 投资组合报告

#### 5.1 资产组合情况

名称	金额（元）	占总资产比例（%）
股票	9,961,193.54	89.98
债券	0.00	0.00
基金	0.00	0.00
银行存款及清算备付金合计	989,451.41	8.94
其他资产	120,272.64	1.09
合计	11,070,917.59	100.00

#### 5.2 期末市值占资产管理计划资产净值前十名股票明细

序号	代码	名称	数量	金额（元）	占净值比例（%）
1	600519 SH	贵州茅台	1,300.00	1,907,607.00	17.70
2	000858 SZ	五粮液	10,000.00	1,280,400.00	11.88
3	000568 SZ	泸州老窖	8,600.00	1,234,014.00	11.45
4	600809 SH	山西汾酒	2,700.00	569,376.00	5.28
5	600600 SH	青岛啤酒	4,000.00	291,080.00	2.70
6	000596 SZ	古井贡酒	1,100.00	232,177.00	2.15
7	603345 SH	安井食品	3,000.00	222,930.00	2.07
8	02015 HG	理想汽车—W	3,000.00	192,484.21	1.79
9	02020 HG	安踏体育	2,600.00	177,972.60	1.65
10	00753 HG	中国国航	50,000.00	165,651.42	1.54

#### 5.3 期末市值占资产管理计划资产净值前十名债券明细

本资产管理计划报告期末未持有债券。

#### 5.4 期末市值占资产管理计划资产净值前十名基金明细

本资产管理计划报告期末未持有基金。

#### 5.5 期末市值占资产管理计划资产净值前十名资产支持证券明细

本资产管理计划报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.6 期末市值占资产管理计划资产净值前十名权证明细

本资产管理计划报告期末未持有权证。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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。

#### 5.9 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。

#### 5.10 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。

### 第六节 资产管理计划份额变动

单位：份

期初份额总额	12,319,413.92
报告期间总参与份额	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	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、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”)在对中信建投启航美好生活集合资产管理计划(以下简称“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、资产管理计划合同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、资产管理计划合同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 信息披露的查阅方式

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

热线电话：4008895587

中信建投证券股份有限公司

2024年07月19日