

# 海通悍马卫士 2 号集合资产管理计划

(2017 年第 4 季报)

资产管理报告



计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司

计划托管人：中国民生银行股份有限公司

报告期间：2017 年 10 月 01 日 - 2017 年 12 月 31 日

## 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国民生银行股份有限公司于2018年1月12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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合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集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

## 一、集合计划简介

### (一) 计划基本资料

1、计划名称：	海通悍马卫士2号集合资产管理计划
2、计划简称：	悍马2号
3、计划合同生效日：	2017年07月11日
4、成立规模：	40,550,000.00
5、报告期末计划份额总额：	40,550,000.00

### (二) 计划产品说明

1、投资目标：	在追求集合计划资产安全性和流动性的前提下，以追求绝对回报为目标，为投资者获取投资收益。
2、投资策略：	根据产品净值运行不同阶段以及市场宏观情况、市场风险度等因素，调整各类资产配置比例，实现一定波动范围内的最佳预期收益。
3、业绩比较基准：	无
4、风险收益特征：	本计划为混合型产品，计划整体属于中高风险品种，适合推广对象为管理人和推广机构现有的客户且为具有较高风险承受能力的合格投资者。以上风险评级为管理人评级，推广机构评级可能与此不同。

### (三) 计划管理人

1、名称：	上海海通证券资产管理有限公司
2、注册地址：	上海市广东路689号海通证券大厦32楼
3、办公地址：	上海市广东路689号海通证券大厦32楼
4、邮政编码：	200001
5、国际互联网址：	www.htsamc.com
6、法定代表人：	裴长江
7、信息披露负责人：	李雪

8、信息披露电话：	021-23212038
9、联系电话：	95553、4008888001
10、传真：	021-63410460
11、电子邮箱：	htam@htsec.com

(四) 计划托管人

1、名称：	中国民生银行股份有限公司
2、注册地址：	北京市西城区复兴门内大街2号
3、办公地址：	北京市西城区复兴门内大街2号
4、邮政编码：	100031
5、国际互联网址：	www.cmbc.com.cn
6、法定代表人：	洪崎
7、信息披露负责人：	赵天杰
8、联系电话：	95568
9、传真：	010-66578700
10、电子邮箱：	zhaotianjie@cmbc.com.cn

(五) 其他有关资料

1、聘请的会计师事务所	
名称：	众华会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：	上海市中山南路100号金外滩广场6楼
2、计划注册登记机构	
名称：	上海海通证券资产管理有限公司
办公地址：	上海市广东路689号海通证券大厦32楼

## 二、主要财务指标和集合计划净值表现

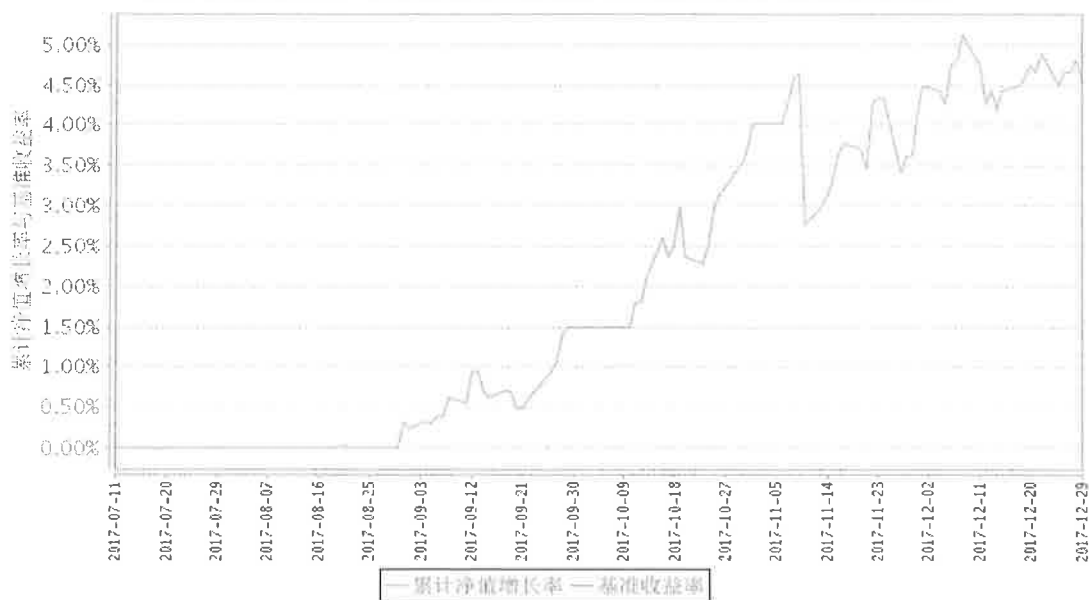
(一) 主要财务指标

(单位：人民币元)

	主要财务指标	2017年10月01日 - 2017年12月31日
1.	本期利润	1,255,358.21
2.	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	55,358.21
3.	期末集合计划资产净值	42,416,879.13
4.	期末单位集合计划资产净值	1.0460

(二) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本集合资产管理计划无业绩比较基准。

(三) 本计划合同生效以来每年的计划收益分配情况

本集合资产管理计划自合同生效以来未进行收益分配。

### 三、集合计划管理人报告

(一) 投资经理简介

赵翀先生，上海财经大学金融学硕士，拥有 16 年金融工作经验。现兼任上海海通证券资产管理有限公司投资经理，组建私募基金研究小组，并管理主投私募基金的 FOF 型资管计划。

(二) 投资经理工作报告

本季度上证指数下跌 1.25%，沪深 300 指数上涨 5.07%，中证 500 指数下跌 5.34%。市场风格差异化极大。

产品所配置的量化对冲与固收组合策略表现平稳，净值自 10 月初 1.0152 稳步上涨到 12 月底的 1.0460，月度盈利全部为正收益，分别为 2.18%，0.39%，0.46%。

产品约 90%收益来自于量化对冲策略。第四季度，所投量化对冲产品扣费前的 Alpha 策略收益贡献为 9.25%，由于基差收敛，股指期货基差损失造成-1.65%的亏损，综合扣费前收益为 7.6%。判断如果未来基差稳定，alpha 的优势将体现出来，超额收益水平会有所提高。

### 四、集合计划财务报表

1、资产负债表

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	26,741.36	-	短期借款	-	-
结算备付金	-	-	交易性金融负债	-	-
存出保证金	-	-	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	488,289.73	-	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	-	-	应付证券清算款	-	-
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
资产支持证券投资	-	-	应付赎回费	-	-
基金投资	488,289.73	-	应付管理人报酬	52,918.57	-
权证投资	-	-	应付托管费	5,291.84	-
衍生金融资产	-	-	应付销售服务费	-	-
买入返售金融资产	-	-	应付交易费用	-	-
应收证券清算款	-	-	应付税费	-	-
应收利息	4,854.15	-	应付利息	-	-
应收股利	73.09	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	-	其他负债	4,000.00	-
其他资产	41,959,131.21	-	负债合计	62,210.41	-
	-	-	实收基金	40,550,000.00	-
	-	-	未分配利润	1,866,879.13	-
	-	-	所有者权益合计	42,416,879.13	-
资产总计：	42,479,089.54	-	负债与持有人权益总计：	42,479,089.54	-

## 2、利润表

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	1,315,693.44	1,987,428.35
1、利息收入	110,805.09	212,665.56
其中：存款利息收入	49.64	15,086.00
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	110,755.45	197,579.56
2、投资收益（损失以“-”填列）	4,888.35	8,362.79
其中：股票投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
基金红利收入	4,888.35	8,362.79
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	1,200,000.00	1,766,400.00
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”填列）	-	-
二、费用	60,335.23	120,549.22
1、管理人报酬	52,918.57	106,356.79
2、托管费	5,291.84	9,802.43
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	-	-
5、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	2,124.82	4,390.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	1,255,358.21	1,866,879.13
四、净利润（净亏损以“-”填列）	1,255,358.21	1,866,879.13

## 五、投资组合报告

### 1、本报告期末计划资产组合情况

项目名称	金额（元）	占计划资产总值比例%
------	-------	------------

股票	-	-
基金	488,289.73	1.15
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	-	-
银行存款	26,741.36	0.06
应收证券清算款	-	-
其他资产	41,964,058.45	98.79
总计	42,479,089.54	100.00

注：因四舍五入原因，分项占比之和与合计数可能存在尾差。

## 2、本报告期末按市值占计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	市值（元）	市值占净值%
1	SN2682	联海星优稳健一号私募基金	32,000,000.00	33,766,400.00	79.61
2	SV5381	海裕1号7天期01号	8,192,731.21	8,192,731.21	19.31
3	000475	广发天天利货币A	488,289.73	488,289.73	1.15

## 六、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
40,550,000.00	-	-	40,550,000.00

## 七、重要事项提示

### （一）本集合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与本集合计划相关的处罚。

### （二）本集合计划相关事项

无

## 八、备查文件目录

### (一) 备查文件目录

- 1、《海通悍马 2 号集合资产管理计划合同》
- 2、《海通悍马 2 号集合资产管理计划说明书》
- 3、《海通悍马 2 号集合资产管理计划风险揭示书》

### (二) 查阅方式

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

热线电话：95553

上海海通证券资产管理有限公司

2018年01月22日

