

# 海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划

## 2021 年 2 季度报告



资产管理计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：交通银行股份有限公司上海市分行

报告期间：2021 年 04 月 01 日-2021 年 06 月 30 日

报告送出日期：2021 年 07 月 30 日

## 一、基本信息

投资组合名称:	海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同生效时间:	2020-07-28
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	交通银行股份有限公司上海市分行

## 二、资产管理计划投资表现

### (一) 基本收益率信息

	本期末
期末资产净值(元)	14,113,708.56
本期利润(元)	348,078.54
份额净值(元)	1.0404
份额累计净值(元)	1.0404

### (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



注：本集合资产管理计划无业绩比较基准。

## 三、资产管理计划投资组合报告

### (一) 委托资产配置情况

序号	资产类别	市值 (元)	占总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	0.00
	其中：股票	-	0.00

2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	基金	14,400,803.24	95.55
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款及结算备付金合计	613,411.27	4.07
7	其他资产	56,747.00	0.38
8	资产合计	15,070,961.51	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。

## (二) 委托资产投资前十名股票（按市值）明细

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

## (三) 委托资产投资前五名债券（按市值）明细

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

## (四) 委托资产投资前五名基金（按市值）明细

序号	基金代码	基金名称	持仓数量 (份)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
1	003949	兴全稳泰债券 A	2,200,446.10	2,354,917.42	16.69
2	519782	交银裕隆纯债 A	1,664,721.34	2,072,411.60	14.68
3	000914	中加纯债债券	1,744,524.99	1,854,081.16	13.14
4	511880	银华日利	12,700.00	1,285,138.40	9.11
5	003978	中信建投稳祥 A	1,226,340.80	1,258,348.29	8.92

## 四、管理人履职报告

### (一) 投资经理情况

投资经理姓名	学历	证券从业年限	主要工作经历
李亦星	硕士	11	上海财经大学经济学硕士。现任上海海通证券资产管理有限公司公募固收部副总监，海通月月鑫、海通季季鑫和海通半年鑫投资主办。拥有 13 年金融从业经验、8 年投资管理经验。

## (二) 投资策略回顾与展望

2021年二季度，基本面对债市温和有利，宏观数据持续复苏，疫苗大规模接种提升了国内和国际经济活力。制造业投资维持修复趋势，地产、基建则是结构性增速下滑。消费随着国内疫情的持续稳定而反弹，但整体依然偏弱。出口数据保持亮眼，但随着国际经济秩序的逐步恢复，可能挤压未来这部分的增长。流动性方面较为宽松，全球角度宽松持续加码，美国退出宽松虽有预期但短期无忧。国内鼓励资金流入中小微企业，严防房地产资金流入的稳健货币政策没有变化。整体看三季度经济断崖式下滑的可能性不大，但是经济复苏可能会逐步放慢。市场关注点从之前的“从修复中寻找错杀”转变为“从反弹中寻求底线”的底线思维。随着新的盈利数据发布，估值的向下修复、避雷或许会成为三季度的主旋律。产品继续以 80%债券基金和 20%被动权益基金为配置。兼顾稳健和收益。

## (三) 公平交易专项说明

报告期内，本资产管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

## (四) 报告期内资管计划投资收益分配情况

注：本集合资产管理计划报告期内未进行收益分配。

## 五、托管人履职报告

详见托管报告。

## 六、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

### (一) 管理费

计提基准	本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6%年费率计提。
计提方式	$H = E \times 【0.6】\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的集合计划管理费； E 为前一日资产净值扣除所持有的管理人自身管理的且已收取管理费的比照公募基金管理的资产管理产品份额所对应的资产净值后的余额
支付方式	管理费自集合计划成立日起，按日计提，按自然季度支付，由托管人根据与

	管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果,于每自然季度结束之日起第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,托管人应于扣款当日配合管理人进行查询、核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。
--	--

## (二) 托管费

计提基准	本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%年费率计提。
计提方式	$H = E \times 【0.05】\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的托管费; E为前一日集合计划资产净值。</p>
支付方式	托管费自集合计划成立日起,按日计提,按自然季度支付,由托管人根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果,于每自然季度结束之日起第3个工作日自托管专户自动扣划托管费,管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管专户资金余额不足的,托管人可待托管专户有资金时再划扣。费用自动划扣后,托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。

## (三) 业绩报酬

计提基准	<p>业绩报酬计提原则:</p> <p>①同一投资者不同时间多次参与的,对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬;</p> <p>②在投资者退出确认日或计划终止日,对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;</p> <p>③在投资者退出确认日或计划终止时提取业绩报酬的,业绩报酬从退出资金或清算分配资金中扣除;</p> <p>④投资者申请退出时,管理人按“先进先出”的原则,即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额,计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p>
计提方式	业绩报酬计提方法、计提比例、提取频率: 业绩报酬提取不得超过业绩报

	<p>酬计提基准以上投资收益的60%。业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。因投资者退出资产管理计划,管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日(以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”,如该笔参与份额不存在上一个业绩报酬计提基准日,则募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日,存续期参与的为份额参与日,下同)到本次业绩报酬计提基准日的年化收益率,作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下:业绩报酬计提基准日为投资者退出日或计划终止日;业绩报酬计提日为投资者退出确认日或计划终止日;为业绩报酬计提基准日的计划单位累计净值;为上一个业绩报酬计提基准日的计划单位累计净值;为上一个业绩报酬计提基准日的计划单位净值;表示上一个业绩报酬计提日(如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日,则募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日,存续期参与的为份额参与确认日)到本次业绩报酬计提日的实际天数;为年化收益率。管理人对每笔参与份额的业绩报酬计提如下:年化收益率(R) 计提比例 业绩报酬(Y)的计提公式 <math>R &lt; B \quad 0 \quad Y = 0 \quad R \geq B \quad X \quad Y = A \times (R - B) \times X \times (D / 365)</math> Y=业绩报酬; B=业绩报酬计提基准,本集合计划为5.8%; X=业绩报酬计提比例,本集合计划为50%; X=业绩报酬计提比例,具体以管理人公告为准; A=每笔参与份额在上一个业绩报酬计提基准日对应的资产净值。</p>
支付方式	<p>管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,托管人根据业绩报酬划付指令执行相关操作。</p>

## 七、涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

### (一)投资经理变更

无

### (二)公司关联人员持有本资产管理计划的情况

无

### (三)重大关联交易情况

无

### (四)其他需要说明的情况

1、2021年3月底，公司收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对上海海通证券资产管理有限公司采取责令暂停部分业务措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关人员出具了监管措施。公司高度重视，按照法律法规相关要求梳理了相关业务流程，制定了整改措施，并抓紧落实整改工作。

## 八、声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。



上海海通证券资产管理有限公司

2021年07月30日