

# 海通海蓝宝润集合资产管理计划 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：中国建设银行股份有限公司

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

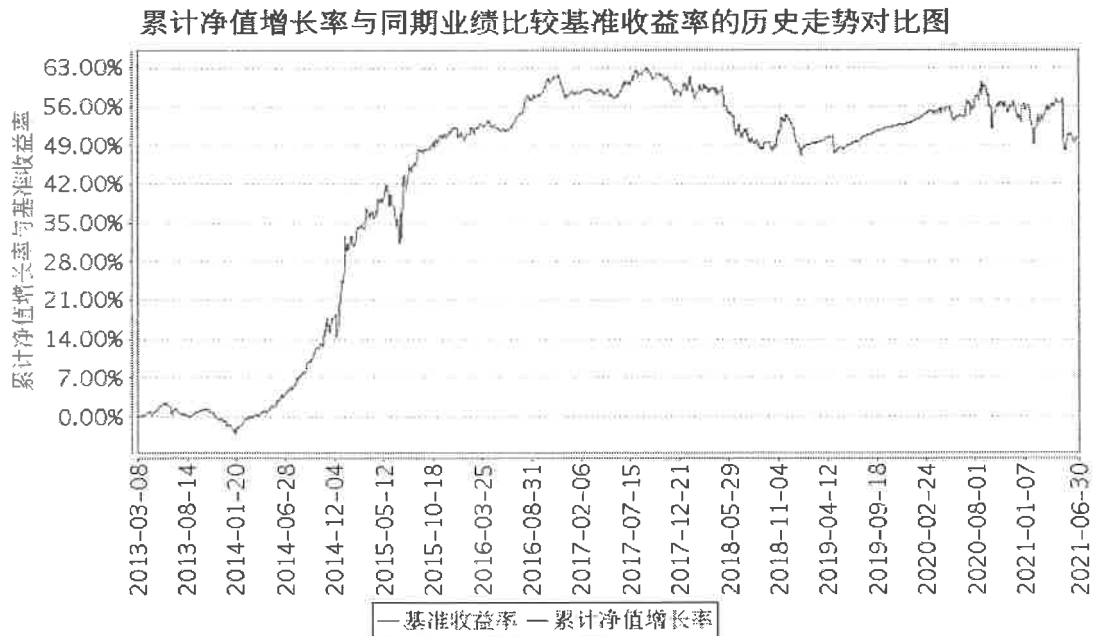
投资组合名称:	海通海蓝宝润集合资产管理计划
合同生效时间:	2013-03-08
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	中国建设银行股份有限公司

## 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)	9,889,153.78
本期利润(元)	-473,522.91
份额净值(元)	0.9806
份额累计净值(元)	1.5156

### (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	967,853.00	9.77
	其中：债券	967,853.00	9.77
	资产支持证券	-	0.00
3	基金	-	0.00
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	8,786,696.77	88.72
7	其他资产	149,171.13	1.51
8	资产合计	9,903,720.90	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

序号	债券代码	债券名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
1	113542	好客转债	3,500.00	379,575.00	3.84
2	110043	无锡转债	2,000.00	225,180.00	2.28
3	019640	20 国债 10	2,000.00	199,960.00	2.02
4	128017	金禾转债	1,000.00	163,138.00	1.65

## (四) 委托资产投资前五名基金（按市值）明细

注：本集合计划本报告期末未持有基金。

# 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
陈广东	硕士	8	上海财经大学金融硕士, 11年从业经验, 2013年加入海通资管, 曾任海通资管投资经理助理, 现任固收一部投资经理. 复合型背景, 具备扎实的信用债研究经验, 投资风格稳健.

## (二) 投资策略回顾与展望

二季度 GDP 同比增速 7.90%，较 19 年同期复合增速 5.52%，增速处于疫情前增速略往下

的水平，从消费、投资、出口分项来看，消费恢复缓慢、投资韧性仍强、出口持续超预期。随着全球接种加快，疫情因素后续可能会逐步消退，但疫情带来的冲击却无法挽回，特别是对中小企业、服务业的冲击，这将制约后期消费的恢复力度。通胀来看，大宗商品维持高位运行，但农业品价格总体颓势，目前 PPI 向 CPI 传导依然缓慢。后市来看，经济仍可能处于缓慢复苏道路，结构性通胀压力或继续存在，货币政策或仍有灵活操作空间。

今年以来，债市整体先抑后扬，信用债仍在分化但边际有改善迹象，利率债遭遇阶段性流动性冲击之后又快速恢复。当前 10 年期国债、政策性金融债收益率水平处于历史偏低水平，但受惠于经济复苏疲弱、货币政策仍有所呵护，债券收益率并不存心明显上行的压力。权益市场来看，受益于外资流入和居民资产配置重构，权益市场或仍有较多结构型机会。展望后市，三季度债券收益率可能继续窄幅震荡，权益市场波动可能加大但中期慢牛趋势依然较强。

### (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	管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为 0.5%。
计提方式	管理费每日计算
支付方式	按月支付

## （二）托管费

计提基准	托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为0.2%。
计提方式	托管费每日计算
支付方式	按月支付

## （三）业绩报酬

计提基准	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日到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。
计提方式	计提方式：1、期间年化收益率（R）<6%，计提比例为0%；2、期间年化收益率（R）≥6%的部分，计提比例为20%。
支付方式	管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于收到指令后5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

## 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、2018年3月21日，凯迪生态环境科技股份有限公司（原名武汉凯迪电力股份有限公司）公告称因重大事项存在不确定性向深圳证券交易所申请，“11凯迪债”（债券代码为“112048”）、“16凯迪01”（债券代码为“112441”）、“16凯迪02”（债券代码为

“112442”）自 2018 年 3 月 22 日上午开市起停牌。2018 年 5 月 7 日，凯迪生态环境科技股份有限公司公告其发行的 2011 年度第一期中期票据，简称“11 凯迪 MTN1”，无法按时兑付本息，发生实质性违约。随后，中诚信证券评估有限公司连续下调被告一主体信用评级和系争凯迪债券的信用评级。2018 年 5 月 25 日，召开了“16 凯迪 01”和“16 凯迪 02”债券持有人大会；2018 年 5 月 29 日，召开了“11 凯迪债”债券持有人大会。上述债券持有人大会分别通过了债券提前到期、要求发行人提前清偿的议案。据此，公司作为资产管理计划管理人，于 2018 年 7 月 23 日向湖北省武汉市东湖新技术开发区人民法院提起诉讼，要求凯迪生态环境科技股份有限公司兑付公司资产管理计划持有的凯迪债券及上述凯迪债券对应的未付利息；阳光凯迪新能源集团有限公司对“11 凯迪债”票面本金和利息的清偿，依约定承担连带担保责任。2020 年 12 月 17 日，凯迪生态股票终止上市并摘牌。2021 年 3 月 15 日，凯迪生态环境科技股份有限公司被湖北省武汉市中级人民法院正式裁定破产重整。我司目前已申报债权。截至本报告期末，本集合计划持有的凯迪债券占产品净值的比例低于 0.06%。

2、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