

海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划

2021 年 4 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：招商银行股份有限公司上海分行

报告期间：2021 年 10 月 01 日-2021 年 12 月 31 日

报告送出日期：2022 年 01 月 28 日

一、基本信息

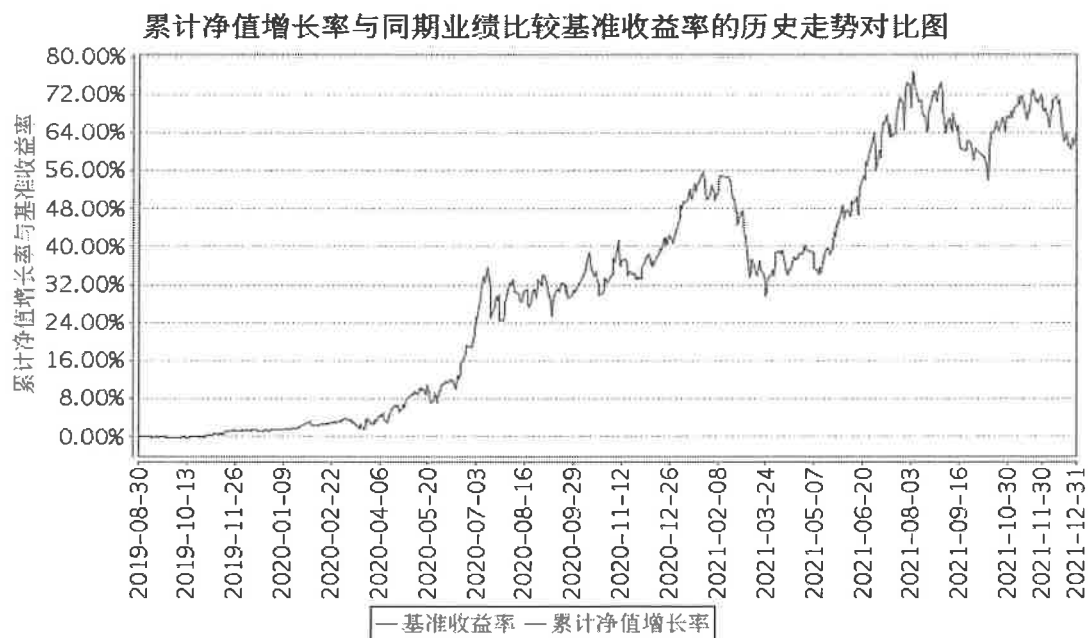
投资组合名称:	海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划
合同生效时间:	2019-08-30
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	招商银行股份有限公司上海分行

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)	89,181,173.02
本期利润(元)	1,491,603.36
份额净值(元)	1.5953
份额累计净值(元)	1.6253

(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	67,483,922.28	73.84
	其中：股票	67,483,922.28	73.84

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	5,891,497.40	6.45
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	13,700,000.00	14.99
6	银行存款及结算备付金合计	2,520,365.53	2.76
7	其他资产	1,791,513.08	1.96
8	资产合计	91,387,298.29	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

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	110,000.00	5,412,000.00	6.07
2	601012	隆基股份	60,860.00	5,246,132.00	5.88
3	300316	晶盛机电	70,500.00	4,899,750.00	5.49
4	300450	先导智能	56,600.00	4,209,342.00	4.72
5	300750	宁德时代	7,100.00	4,174,800.00	4.68
6	002129	中环股份	93,400.00	3,899,450.00	4.37
7	002371	北方华创	10,500.00	3,643,710.00	4.09
8	002466	天齐锂业	33,800.00	3,616,600.00	4.06
9	300782	卓胜微	10,460.00	3,418,328.00	3.83
10	300724	捷佳伟创	29,700.00	3,394,710.00	3.81

(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	000912	英大现金宝货币A	2,000,000.00	2,000,000.00	2.24
2	159995	华夏国证半导体芯片ETF	853,500.00	1,389,498.00	1.56
3	515790	光伏ETF	795,900.00	1,362,580.80	1.53
4	515030	华夏中证新能源汽车ETF	482,600.00	1,139,418.60	1.28

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
韩传青	硕士	4	南京大学产业经济学硕士，曾任海通资管权益研究部研究员，权益投资一部投资经理助理，现任海通博睿科创精选 1 号投资主办人。

(二) 投资策略回顾与展望

市场回顾

2021 年 Q4，上证指数上涨 2.01%、深证成指上涨 3.83%、中小板指上涨 6.21%、创业板指上涨 2.40%。细分行业来看，中信传媒、国防军工、通信、综合金融、轻工制造、汽车、电子和农林牧渔等行业表现较为强势，取得 10%以上的正收益，中信煤炭、石油石化、钢铁和消费者服务等行业表现较为弱势，均录得 10%以上的跌幅。

今年的第四季度，国内伴随着“保供顺价”升级等政策应对，以煤炭为代表的商品价格大幅回调。南非新冠变种病毒的发酵引发全球新一轮的恐慌，投资人关心新型毒株对市场造成的影响。海外方面，美联储货币政策明显转向鹰派，导致市场对美联储货币收紧担忧持续发酵，海外市场波动加剧。A 股整体表现仍然呈现一定的结构性。

海通博睿科创精选 1 号，在 2021 年 Q4 取得 2.34%的正收益，产品运作期间最大回撤 7.26%。

市场展望

海外来看，近期美联储主席鲍威尔发言“放弃通胀是暂时的”、“可能提前几个月完成 taper”，美联储 FOMC 会议宣布加速 Taper，同时散点图预期 2022 年加息增至 3 次，货币政策明显转向鹰派，导致市场对美联储货币收紧担忧持续发酵，美股尤其是科技股大跌。同时，美国公布《外国公司问责法案》实施规则，相关政策即将进入实质执行阶段，导致中概股深度调整。中美贸易摩擦出现新变化，美国财政部将 8 家中国科技企业加入名单，商务部则宣布再将来自中国的 34 家实体加入实体清单。美国 1.75 万亿美元的财政支出法案受阻，其中包括了 5500 亿美元清洁能源和气候变化领域的投资，成为近期新能源车板块回调的部分原因。

国内方面，国务院总理李克强提出“适时降准”，成为本轮“宽货币”政策加码和“宽信用”周期开启的重要信号。中央经济工作会议的召开，会议首提“经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力”，时隔三年重提“以经济建设为中心”，要求“明年经济工作要

稳字当头、稳中求进”、“政策发力适当靠前”、“财政政策和货币政策要协调联动，跨周期和逆周期宏观调控政策要有机结合”。经济下行压力下，近期决策层不断释放稳增长信号。12月，1年期LPR下调5个BP，股票市场对此反映相对平淡，随后几个交易日在临近年底流动性环境、国内疫情新变化以及新能源车产业链事件性因素等综合影响下，市场整体表现较为低迷。

操作策略

产品基本延续之前的行业配置结构，行业配置集中在电子、电力设备新能源、机械、有色金属、基础化工和传媒等行业。短期，我们认为四季度经济增长的压力较大，疫情对消费和服务业造成了冲击仍需时间修复，同时托底政策加码的预期进一步强化，我们维持之前的观点，战略上在进攻的同时兼顾防守。长期，新能源、科技自主可控、国防安全和智能制造仍将是我们的重点关注和投资的方向。

在震荡市中，我们将更加注重独立、深度、前瞻研究，为各位持有人朋友创造价值。

(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	前一日集合计划资产净值
计提方式	管理费按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提
支付方式	管理费自集合计划成立日起，每日计提，逐日累计，按季支付

(二) 托管费

计提基准	0.03%
计提方式	托管费按前一日集合计划资产净值的0.03%年费率计提。计算方法如下： 计算方式： $H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$ H为每日应计提的托管费； E为前一日集合计划资产净值。 托管费自集合计划成立日起，每日计提，逐日累计，按季支付。
支付方式	每自然季度结束之日起10个工作日内由管理人向托管人发送当个自然季度托管费划付指令，托管人复核后于10个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(三) 业绩报酬

计提基准	年化收益率
计提方式	年化收益小于6%，计提比例0%；年化收益大于等于6%，计提比例20%
支付方式	管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。因涉及注册登记数据，托管人对业绩报酬不承担复核责任，仅配合执行托管账户资金划付。

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

1、截至本报告期末，董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东及其他关联方参与本集合计划的总计持有金额为380,124.56元。

(三) 重大关联交易情况

无

(四)其他需要说明的情况

无

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

2022年01月28日