

海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划

2022 年 1 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：2022 年 01 月 01 日-2022 年 03 月 31 日

报告送出日期：2022 年 04 月 29 日

一、基本信息

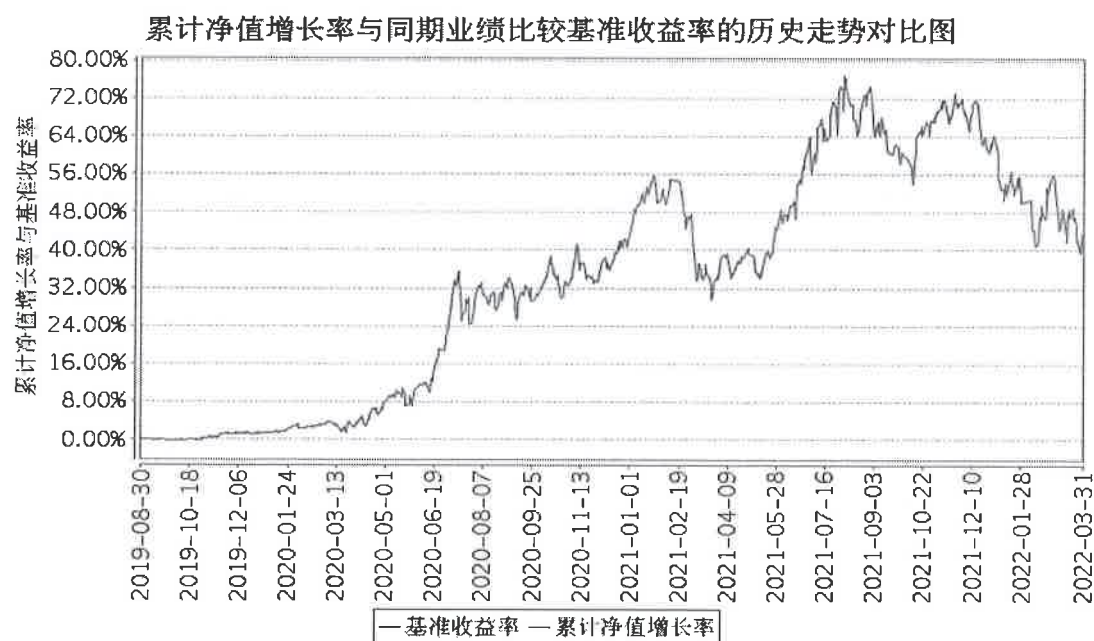
投资组合名称:	海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划
合同生效时间:	2019-08-30
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	招商银行股份有限公司上海分行

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)	77,177,372.41
本期利润(元)	-13,625,701.75
份额净值(元)	1.3515
份额累计净值(元)	1.3815

(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	57,966,829.98	74.41
	其中：股票	57,966,829.98	74.41

2	固定收益投资	1,437,781.40	1.85
	其中：债券	1,437,781.40	1.85
	资产支持证券	-	0.00
3	基金	4,025,868.50	5.17
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	12,200,000.00	15.66
6	银行存款及结算备付金合计	1,803,990.41	2.32
7	其他资产	467,510.56	0.60
8	资产合计	77,901,980.85	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	002371	北方华创	19,600.00	5,370,400.00	6.96
2	300316	晶盛机电	76,000.00	4,560,000.00	5.91
3	601012	隆基股份	60,860.00	4,393,483.40	5.69
4	002129	中环股份	95,300.00	4,069,310.00	5.27
5	300750	宁德时代	7,800.00	3,995,940.00	5.18
6	300450	先导智能	63,300.00	3,699,252.00	4.79
7	300661	圣邦股份	11,200.00	3,657,024.00	4.74
8	002475	立讯精密	110,000.00	3,487,000.00	4.52
9	002466	天齐锂业	37,100.00	3,019,569.00	3.91
10	002460	赣锋锂业	20,700.00	2,600,955.00	3.37

(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	113053	隆 22 转债	5,740.00	703,018.69	0.91
2	123137	锦浪转债	3,335.00	412,443.10	0.53
3	110074	精达转债	1,690.00	253,651.87	0.33
4	113641	华友转债	570.00	68,667.74	0.09

(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	2.59
2	159995	华夏国证半导体芯片 ETF	853,500.00	1,084,798.50	1.41

3	515030	华夏中证新能源汽车ETF	482,600.00	941,070.00	1.22
---	--------	--------------	------------	------------	------

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

2022年Q1，上证指数下跌10.65%、深证成指下跌18.44%、创业板指下跌19.96%、万得全A下跌13.92%。细分行业来看，中信煤炭、房地产、银行和农林牧渔等行业表现较为强势，取得正收益，中信其他一级行业均录得负收益，其中中信电子、国防军工、汽车、食品饮料和家电等行业表现较为弱势，均录得20%以上的跌幅。

2022年Q1的A股市场整体表现较差。我们认为跟最近一系列宏观因素边际变弱相关。海外美联储加息缩表，十年期国债收益率趋势向上，可能对我国的货币政策操作空间带来一定的掣肘，同时资金面也有可能面临短期流出的压力。近期国内疫情边际恶化，上海疫情仍未见顶，广州、深圳、北京等多地也出现局部疫情，市场担忧疫情对经济的影响扩大化。我们也观察到，俄乌冲突和谈仍处于博弈拉锯阶段，市场仍担忧地缘风险。

市场展望

目前A股市场尚处于磨底阶段，美债利率、油价、国内疫情、货币政策、地缘风险等宏观因素仍是当前A股的主要矛盾，反弹仍需等待上述因素出现边际改善。当前，虽然政策底已现，经济底和市场底在上述宏观因素的冲击下，仍面临较大的不确定，尚需时日。总之，在系列宏观因素明朗之前，我们对市场仍保持谨慎态度，以把握结构为主的逢低布局是当前相对较优策略。

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、基础化工等行业。短期，我们认为2022年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

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 322,032.43 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 04 月 29 日