

海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划 2021 年年度报告



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 01 月 01 日-2021 年 12 月 31 日

报告送出日期：2022 年 04 月 29 日

一、基本信息

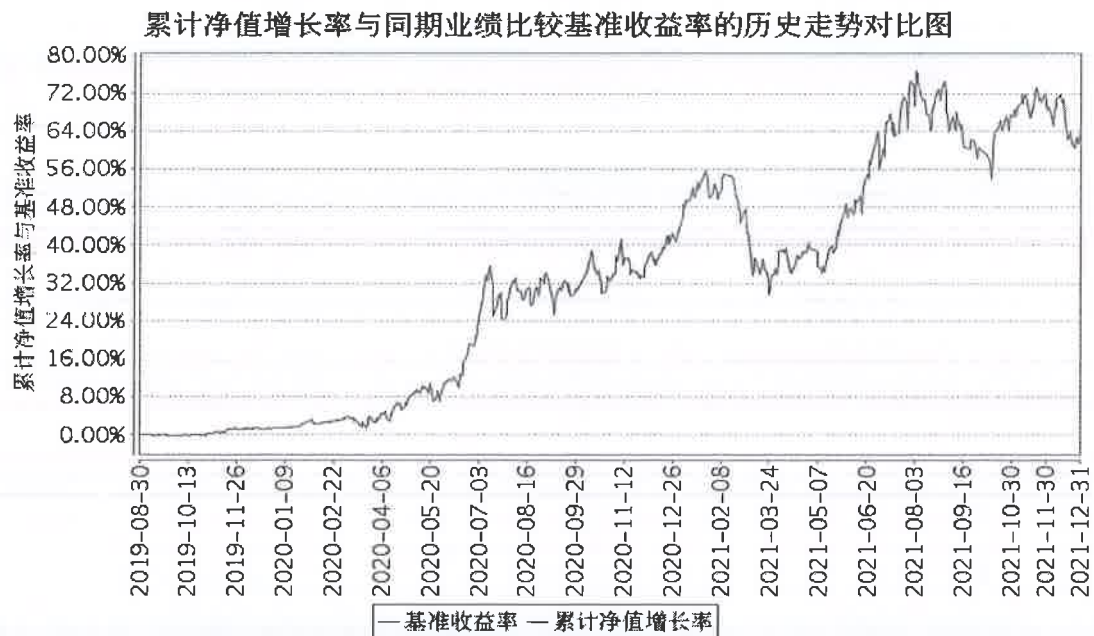
投资组合名称:	海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划
合同生效时间:	2019-08-30
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	招商银行股份有限公司上海分行

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)	89,181,173.02
本期利润(元)	6,359,601.56
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) 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
----	------	------	----------	------	------

银行存款	832,728.10	707,262.90	短期借款	-	-
结算备付金	1,687,637.43	373,000.01	交易性金融负债	-	-
存出保证金	16,241.68	41,238.78	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	73,375,419.68	12,959,457.96	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	67,483,922.28	12,959,457.96	应付证券清算款	1,751,058.28	576,346.72
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	5,891,497.40	-	应付管理人报酬	310,397.93	65,073.94
权证投资	-	-	应付托管费	6,207.94	1,301.37
衍生金融资产	-	-	应付销售服务费	-	-
买入返售金融资产	13,700,000.00	2,900,000.00	应付交易费用	12,844.49	3,474.47
应收证券清算款	1,777,237.42	-	应付税费	116,616.63	66,739.45
应收利息	-4,320.96	-328.30	应付利息	-	-
应收股利	2,354.94	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	2,525,000.00	其他负债	9,000.00	6,000.00
其他资产	-	-	负债合计	2,206,125.27	718,935.95
-	-	-	实收基金	55,901,603.57	13,515,306.52
-	-	-	未分配利润	33,279,569.45	5,271,388.88
-	-	-	所有者权益合计	89,181,173.02	18,786,695.40
资产总计：	91,387,298.29	19,505,631.35	负债与持有人权益	91,387,298.29	19,505,631.35

			总计:	
--	--	--	-----	--

(二) 利润表

项 目	本年数	上年数
一、收入	7,558,658.32	7,074,843.11
1、利息收入	310,728.85	298,685.62
其中：存款利息收入	30,491.96	36,242.24
债券利息收入	1.03	9.96
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	280,235.86	262,433.42
其他利息收入	-	-
2、投资收益（损失以“-”填列）	4,814,601.66	4,523,573.21
其中：股票投资收益	4,568,557.02	4,374,584.03
债券投资收益	2,844.44	12,892.92
基金投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	73,922.32
股利收益	240,845.26	62,173.94
基金红利收入	2,354.94	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	2,312,352.06	2,234,184.71
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”填列）	120,975.75	18,399.57
二、费用	1,199,056.76	679,638.53
1、管理人报酬	986,000.44	498,845.43
2、托管费	19,720.07	10,078.92
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	157,298.86	142,906.75

5、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6、税金及附加	17,640.67	17,005.86
7、其他费用	18,396.72	10,801.57
8、资产减值损失	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	6,359,601.56	6,395,204.58
四、净利润（净亏损以“-”填列）	6,359,601.56	6,395,204.58

(三)所有者权益表

项目	本年金额			上年金额		
	实收计划	未分配利润	所有者权益合计	实收计划	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	13,515,306.52	5,271,388.88	18,786,695.40	124,362,551.13	1,767,260.31	126,129,811.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	6,359,601.56	6,359,601.56	-	6,395,204.58	6,395,204.58
三、本期基金份额交易产	42,386,297.05	21,648,579.01	64,034,876.06	-110,847,244.61	839,800.57	-110,007,444.04

生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)						
其中:						
1. 基金申购款	81,991,336.17	44,840,663.83	126,832,000.00	11,875,458.52	3,156,938.41	15,032,396.93
2. 基金赎回款	-39,605,039.12	-23,192,084.82	-62,797,123.94	-122,722,703.13	-2,317,137.84	-125,039,840.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-3,730,876.58	-3,730,876.58
五、期末所有者权益(基金净值)	55,901,603.57	33,279,569.45	89,181,173.02	13,515,306.52	5,271,388.88	18,786,695.40

四、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

(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

五、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，上证指数上涨 4.80%、深证成指上涨 2.67%、中小板指上涨 4.62%、创业板指上涨 12.02%。细分行业来看，中信电力设备及新能源、基础化工、有色金属、煤炭和钢铁等行业表现较为强势，取得 40% 以上的正收益，中信消费者服务、非银行金融、家电、房地产、农林牧渔和食品饮料等行业表现较为弱势，均录得 5% 以上的跌幅。

2021 年的 A 股市场整体仍然表现出较强的结构性，周期性行业受益于供给收缩的涨价，新能源行业受益于渗透率提升等收益不错，消费、地产等由于疫情反复和政策压力较大，表现较为挣扎。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。

海通博睿科创精选 1 号，在 2021 年取得 14.77% 的正收益，产品运作期间最大回撤 16.82%。

市场展望

2022 年 A 股最大的风险是美联储加息和缩减购债，国内经济下行压力仍然较大，政策可能会放松（面临美联储加息约束）。上市公司盈利，加速探底，A 股全年的预期收益率趋降。估值来看，整体历史中枢，部分指数历史极值面临“均值回归”压力。疫情，海外传播未见颓势，国内局部爆发仍形成干扰。策略上，面临上市公司整体盈利的压力，成长将更为稀缺，重点关注光伏+新能源车+消费电子等的投资机会。

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們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。

六、托管人履职报告

详见托管报告。

七、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。

八、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

2021 年 6 月 24 日起，邹立先生不再担任本集合计划投资经理，由韩传青先生继续担任本集合计划投资经理。

(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 380,124.56 元。

(三) 重大关联交易情况

无

(四) 其他需要说明的情况

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。

九、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

