

海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划 2022 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：中国民生银行股份有限公司

报告期间：2022 年 10 月 01 日-2022 年 12 月 31 日

报告送出日期：2023 年 01 月 31 日



一、基本信息

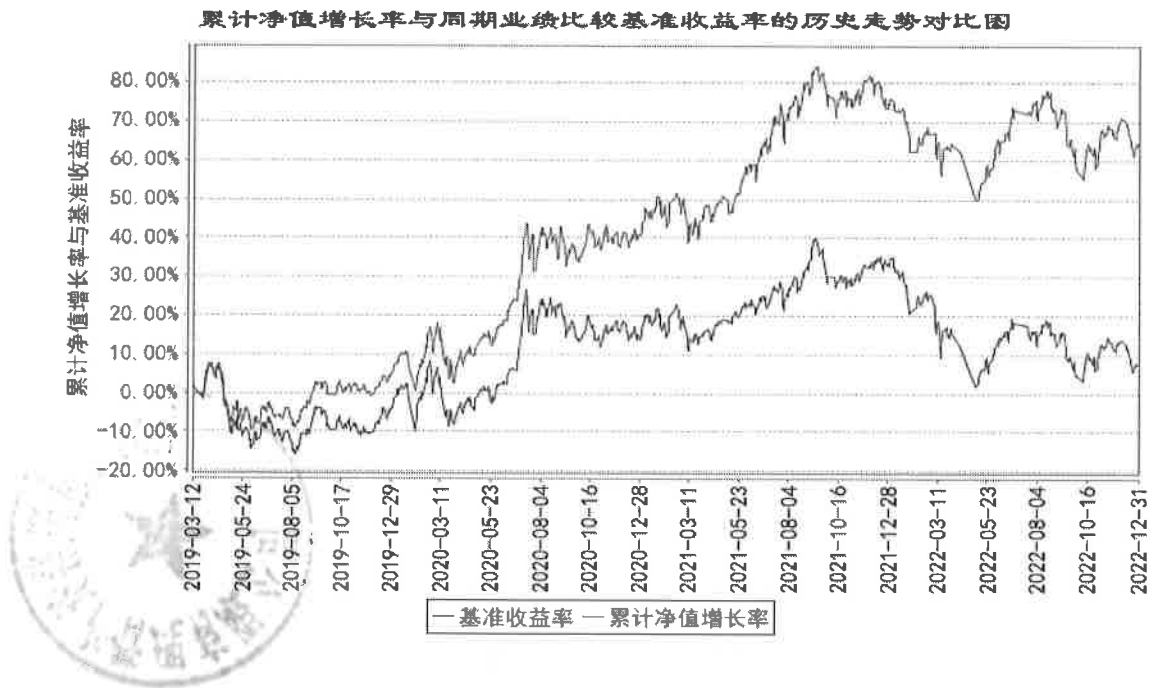
投资组合名称:	海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同生效时间:	2019-03-12
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	中国民生银行股份有限公司

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)	98,678,503.51
本期利润(元)	3,699,807.31
份额净值(元)	1.6200
份额累计净值(元)	1.6200

(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



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	88,906,958.57	89.92
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	9,967,080.10	10.08
7	其他资产	829.83	0.00
8	资产合计	98,874,868.50	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	SNM385	诚奇新动力指数增强1号	15,783,921.67	19,793,037.77	20.06
2	SN536B	鸣石中证500指数增强春天15号H期B类	21,198,298.77	16,388,404.78	16.61
3	T05723	信弘征程2号B类	13,724,116.23	14,049,377.78	14.24
4	SLY384	衍复恒星增强一号	11,335,628.08	13,438,387.09	13.62
5	QA116B	睿亿投资稳健增长1号B类	9,365,701.58	8,819,681.18	8.94

(五) 资产管理计划运用杠杆情况

本集合计划本报告期末的杠杆比率（总资产/净资产）为 100.20%。

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
赵翀	硕士	19	赵翀先生，上海财经大学金融学硕士，拥有 19 年金融工作经验。现任上海海通证券资产管理有限公司投资经理，管理并主投私募 FOF 型资管计划。

(二) 投资策略回顾与展望

市场表现：

四季度沪深 300 上涨 1.75%，上证指数涨 2.14%，创业板指涨 2.53%，中证 500 涨 2.63%。申万一级行业涨多跌少，社会服务(21.84%)、计算机(14.18%)、传媒(14.08%)、综合(13.48%)、医药生物(10.56%)领涨，煤炭(-16.37%)、石油石化(-5.12%)、电力设备(-3.89%)、有色金属(-2.44%)、房地产(-0.90%)领跌。

我们管理人跟踪池有数据的 80 家主观私募管理人代表产品，本季度平均值为 1.62%，首尾收益相差 66.86%，47 家实现正收益，占比 58.75%，有 13 家季度收益超过 10%。跟踪的 34 家指增量化策略多头产品，本季度平均涨 4.06%，首尾相差 17.08%，31 家实现正收益，占比 91.18%，1 家季度收益超过 10%。

市场展望：

2023 年海外衰退风险加大，出口型行业基本面承压。2022 年下半年以来美联储加息对经济的冲击加速显现，基本面要求货币政策暂停收紧；但地缘因素、能源转型、劳动力短缺等供给因素会抬升通胀长期中枢，美联储利率高位维持时间可能较长，外需存在超预期衰退的可能。

随着外需回落加深，稳内需政策进入发力期，中央经济工作会议明确扩内需成为下一阶段战略重心。一方面，防疫政策变化会带动就业恢复，就业的恢复进一步带来收入增长的提升，从而促进消费的回升；在经济回升过程中，消费信心也会逐步恢复，从而促进超额储蓄释放，增强弹性。另一方面，地产销售、投资已经回落至接近长期均衡水平，随着地产政策的强化、疫情影响的逐步消退，地产对经济的拖累将显著弱化。

在组合投资布局和策略上，新年计划满仓运作，目前的组合配置相对合理，在配置逻辑不变的情况下，我们可能考虑等量替换同策略优秀管理人。

(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

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	按前一日资产净值的 0.7%年费率计提
计提方式	每日计提，逐日累计
支付方式	按季支付

(二) 托管费

计提基准	按前一日资产净值的 0.05%年费率计提
计提方式	每日计提，逐日累计
支付方式	按季支付

(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	期间年化收益率 (R) $\geq 10\%$ ，计提比例为 10%
支付方式	管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人主要完成，托管人协助完成并根据业绩报酬划付指令执行相关操作。

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) 报告期内，本产品投资管理人及关联方管理的资产管理产品（含公募基金及资产支持证券）、投资管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（含资产支持证券）或承销期内承销的证券（含资产支持证券）、其他关联交易情况

无

(五) 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

2023年01月31日