

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

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

报告送出日期：2023 年 04 月 28 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)	-7,446,137.75
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) 资产负债表

资产	期末余额	上年年末余额	负债与所有者权益	期末余额	上年年末余额
货币存款	9,967,080.10	2,485,883.13	短期借款	-	-

结算备付金	-	7,562.45	交易性金融负债	-	-
存出保证金	829.83	529.01	衍生金融负债	-	-
衍生金融资产	-	-	卖出回购金融资产款	-	-
应收清算款	-	-	应付管理人报酬	174,873.95	37,020.90
应收利息	-	-	应付托管费	12,491.04	2,644.33
应收股利	-	460,682.36	应付销售服务费	-	-
应收申购款	-	-	应付投资顾问费	-	-
买入返售金融资产	-	-	应付税费	-	332.74
发放贷款和垫款	-	-	应付清算款	-	-
交易性金融资产	88,906,958.57	21,367,671.45	应付赎回款	-	-
债权投资	-	-	应付利息	-	-
其他债权投资	-	-	应付利润	-	-
其他权益工具投资	-	-	其他负债	9,000.00	6,000.00
长期股权投资	-	-	负债合计	196,364.99	45,997.97
其他资产	-	387.31	净资产:	-	-
-	-	-	实收资本	60,912,478.82	13,689,866.27
-	-	-	其他综合收益	-	-
-	-	-	未分配利润	37,766,024.69	10,586,851.47
-	-	-	净资产合计	98,678,503.51	24,276,717.74
资产总	98,874,868.50	24,322,715.71	负债与净	98,874,868.50	24,322,715.71

计：			资产总		
			计：		

(二) 利润表

项 目	本期金额	上期金额
一、营业总收入	-6,694,958.35	4,179,251.14
利息收入	69,637.05	8,168.00
投资收益（损失以“-”填列）	-2,233,172.27	5,470,881.80
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-	-
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,540,251.88	-1,306,584.48
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
其他业务收入	8,828.75	6,785.82
二、营业总支出	751,179.40	693,671.67
管理人报酬	690,470.41	119,754.93
其中：暂估管理人报酬	-	-
托管费	49,319.37	8,553.87
销售服务费	-	-
投资顾问费	-	-
利息支出	-	-
信用减值损失	-	-
税金及附加	121.20	35.65
其他费用	11,268.42	565,327.22
三、利润总额	-7,446,137.75	3,485,579.47
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-7,446,137.75	3,485,579.47
五、其他综合收益的税后净额	-	-

六、综合收益总额	-7,446,137.75	3,485,579.47
----------	---------------	--------------

(三)所有者权益表

项 目	本金额				上年金额			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末余额	13,689,866.27	-	10,586,851.47	24,276,717.74	11,408,829.18	-	4,980,151.68	16,388,980.86
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本年年初余额	13,689,866.27	-	10,586,851.47	24,276,717.74	11,408,829.18	-	4,980,151.68	16,388,980.86
三、本年增减变动额(减少以“-”号填列)	47,222,612.55	-	27,179,173.22	74,401,785.77	2,281,037.09	-	5,606,699.79	7,887,736.88
(一)综合收益总额	-	-	-7,446,137.75	-7,446,137.75	-	-	3,485,579.47	3,485,579.47
(二)产品持有人申购和赎回	47,222,612.55	-	34,625,310.97	81,847,923.52	2,281,037.09	-	2,121,120.32	4,402,157.41
其中：产品申购	49,563,916.28	-	36,236,083.72	85,800,000.00	6,105,640.87	-	4,394,359.13	10,500,000.00
产品赎回	-2,341,303.73	-	-1,610,772.75	-3,952,076.48	-3,824,603.78	-	-2,273,238.81	-6,097,842.59

(三)利润分配	-	-	-	-	-	-	-	-
(四)其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本期末余额	60,912,478.82	-	37,766,024.69	98,678,503.51	13,689,866.27	-	10,586,851.47	24,276,717.74

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	-	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%。

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
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

市场回顾：

2022 年国内疫情反复，地产低迷，海外俄乌战争，美国欧洲通胀处于高位，美联储强力加息 7 次，内外利空因素交织，市场整体承压。由于 2022 年初判断稳增长政策力度有望超出市场预期，可以部分对冲前两年新能源大板块结构性牛市以及全球流动性转向带来的估值压力，仍保持相对乐观，品种均衡。但无法预测疫情以及外部战争的影响。所幸，远见 FOF 系列的方法论进化较为成熟，在宏观判断和底层管理人的风格刻画上做足准备，产品全年虽然小幅亏损，但明显跑赢市场。

2022 年沪深 300 下跌 21.63%，上证指数下跌 15.13%，创业板指下跌 29.37%，中证 500 下跌 20.31%。申万一级行业分化明显，首尾行业相差约 47%，表现前五的行业为煤炭（10.95%）、综合（10.57%）、社会服务（-2.23%）、交通运输（-3.41%）、美容护理（-6.74%），表现靠后的行业有电子（-36.54%）、建筑材料（-26.13%）、传媒（-26.07%）、计算机（-25.47%）、

电力设备（-25.43%）。

市场展望：

2022年的出口表现亮眼，部分降低了当年稳增长的压力，但2023年海外衰退风险加大，出口型行业基本面承压已经是一个相对确定的现实。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，稳内需政策必须发力，中央经济工作会议明确扩内需成为下一阶段战略重心。促进就业、促进消费，从而促进超额储蓄释放，增强弹性。本轮周期中消费行业供给面好于过往任何时期，在供需双重作用下，消费行业盈利弹性将显著加强。

投资方向上，关注哑铃型结构。一方面是大小盘风格的哑铃型结构，核心资产是估值修复的主力品种，也是外资投资中国经济复苏的首选，而专精特新等细分赛道成长股为股市回报提供更多弹性，也更具有激活和维持市场人气的重要作用；另一方面是管理人风格的哑铃型结构，价值投资、逆向投资风格为产品提供波动控制能力，而成长风格为产品提供收益创造能力，2023年缺一不可。

（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

本集合计划本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	按前一日资产净值的0.7%年费率计提
计提方式	每日计提
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
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。

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

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

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
2023年04月28日

