

海通资管锐思汇智 2 号 FOF 集合资产管理计划

2023 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：南京银行股份有限公司

报告期间：2023 年 01 月 01 日-2023 年 03 月 31 日

报告送出日期：2023 年 04 月 28 日



一、基本信息

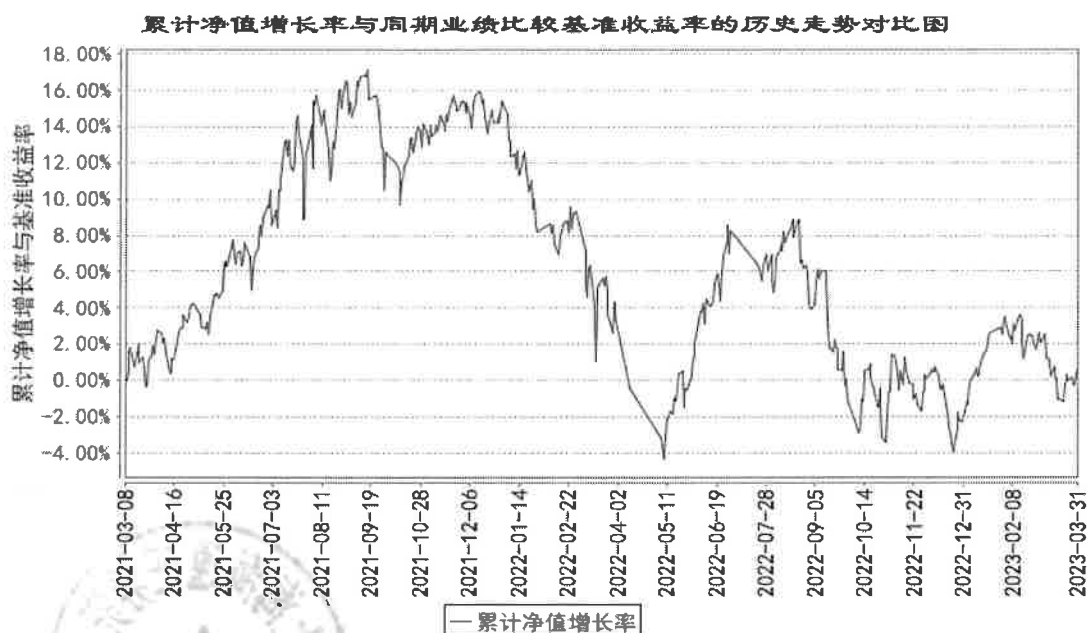
投资组合名称:	海通资管锐思汇智 2 号 FOF 集合资产管理计划
合同生效时间:	2021-03-08
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	南京银行股份有限公司

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)	39,347,176.59
本期利润(元)	1,145,770.33
份额净值(元)	0.9935
份额累计净值(元)	0.9935

(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	-	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	38,887,528.66	98.61
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	546,581.26	1.39
7	其他资产	512.07	0.00
8	资产合计	39,434,621.99	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：本集合资产管理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：本集合资产管理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	013884	交银主题优选 C	1,227,420.83	2,609,005.72	6.63
2	166301	华商新趋势优选	236,533.33	2,358,946.90	6.00
3	519133	海富通改革驱动混合	892,055.86	2,039,507.31	5.18
4	001856	易方达环保主题	446,095.53	1,685,795.01	4.28
5	009274	融通健康产业 C	480,594.78	1,627,293.93	4.14

(五) 资产管理计划运用杠杆情况

本集合资产管理计划本报告期末的杠杆比率（总资产/净资产）为 100.22%。

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
赵星宇	硕士	5	复旦大学计算数学硕士，5年证券从业经验，曾任华创证券研究所金融产品研究员，从事大类资产配置、基金研究等工作。2020年加入上海海通证券资产管理有

			限公司，现任组合投资部投资经理助理。
--	--	--	--------------------

(二) 投资策略回顾与展望

一季度，随着美联储加息进入尾声、全球局势缓和、欧美经济好于预期，全球资本市场开启反弹行情。A股市场，1-2月国内经济修复持续提速，基本面的强劲支撑，带动核心资产为主的主要指数快速上涨；春节后，海外市场扰动加剧，外资流入放缓，经济基本面相对偏弱下，市场行情分化，科技和“中特股”成为市场热点。最终，沪深300、中证500、创业板指分别上涨4.63%、8.11%、2.25%。行业方面，TMT板块领涨，房地产、消费者服务表现较弱。债券市场，市场从强预期回归弱现实，叠加信用利差修复，一季度利率先上后下，整体赚钱效应较佳。

一季度，公募偏股混合型基金平均收益为2.53%，主题炒作及中小盘风格的行情下，公募主动管理能力遭遇挑战。产品运作上，出于看多股市，组合维持较高的权益仓位。2月份以来，基本面弱预期的判断下，降低了一部分核心资产仓位，增配了中小盘风格基金，对组合形成一定正贡献；行业板块上，组合一季度相对超配了医药、新能源，其中，尽管医药指数有所回调，但所选基金经理细分板块轮动能力较强，对组合有一定正贡献；而新能源基金相对拖累组合净值。

展望二季度，当前宏观环境处于等待积极信号阶段，机会大于风险。国内经济弱预期、弱现实已基本被市场计价，来自基本面的利空相对有限；经济复苏潜力仍然较强，短期受制于收入预期改善相对偏慢，仍需耐心等待。市场当前的波动项更主要来自于海外，历史上美联储加息周期都爆发了经济或金融危机。这次美联储激进加息下，已有风险事件发生。未来是否会有其他风险事件发生难以预计，仍需保持谨慎。整体来看，二季度利空因素相对有限，等待地产、收入、居民信贷等数据改善所带来的积极信号。板块上，看好当前景气度改善最大的方向TMT、可选消费等。

组合配置上，我们会采取偏进攻的投资策略，底仓上，一方面优选对于宏观经济节奏把握能力更强的基金经理，另一方面，优选自下而上选股能力较强的选手。此外，我们会加大对看好的行业的配置比例，从收益角度为持有人尽量带来更好的投资体验。

(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	本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为0.8%
计提方式	每日计提
支付方式	按季支付

(二) 托管费

计提基准	本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.02%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	1、期间年化收益率(R) < 6%，计提比例为0%；2、期间年化收益率(R) ≥ 6%，计提比例为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

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

序号	名称	当期发生数 ^{注1}	持仓数量 ^{注2}	市值（元）
1	海富通改革驱动	0.00	892,055.86	2,039,507.31

注：1、当期发生数为当期交易轧差后的结果。

2、若资产为股票，单位为股；若资产为债券，单位为张；若资产为资产管理产品，单位为份额。

(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04月28日

