

# 海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划 2023 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：2023 年 01 月 01 日-2023 年 12 月 31 日

报告送出日期：2024 年 04 月 30 日



## 一、基本信息

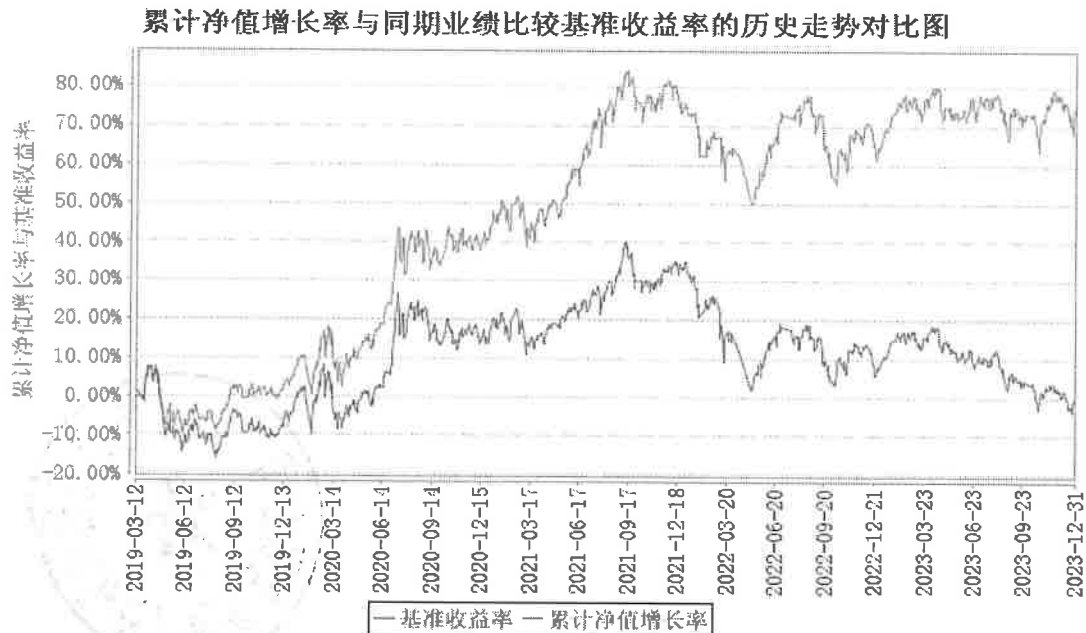
投资组合名称:	海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同生效时间:	2019-03-12
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	中国民生银行股份有限公司

## 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)	33,504,391.64
本期利润(元)	6,303,480.91
份额净值(元)	1.7258
份额累计净值(元)	1.7258

### (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	1,108,121.50	9,967,080.10	短期借款	-	-

结算备付金	-	-	交易性金融负债	-	-
存出保证金	673.97	829.83	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	62,352.42	174,873.95
应收利息	-	-	应付托管费	4,453.81	12,491.04
应收股利	-	-	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	-	-
发放贷款和垫款	-	-	应付清算款	-	-
交易性金融资产	32,471,402.40	88,906,958.57	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	9,000.00
长期股权投资	-	-	负债合计	75,806.23	196,364.99
其他资产	-	-	净资产：	-	-
-	-	-	实收资本	19,413,380.08	60,912,478.82
-	-	-	其他综合收益	-	-
-	-	-	未分配利润	14,091,011.56	37,766,024.69
-	-	-	净资产合计	33,504,391.64	98,678,503.51
资产总计	33,580,197.87	98,874,868.50	负债与净	33,580,197.87	98,874,868.50

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	6,822,697.29	-6,694,958.35
利息收入	28,310.32	69,637.05
投资收益（损失以“-”填列）	2,502,199.09	-2,233,172.27
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）	4,288,397.41	-4,540,251.88
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
其他业务收入	3,790.47	8,828.75
二、营业总支出	519,216.38	751,179.40
管理人报酬	475,007.63	690,470.41
其中：暂估管理人报酬	-	-
托管费	33,929.23	49,319.37
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
其他费用	10,279.52	11,268.42
三、利润总额	6,303,480.91	-7,446,137.75
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,303,480.91	-7,446,137.75
五、其他综合收益的税后净额	-	-

六、综合收益总额	6,303,480.91	-7,446,137.75
----------	--------------	---------------

(三)所有者权益表

项目	本年金额				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	60,912,478.82	-	37,766,024.69	98,678,503.51	13,689,866.27	-	10,586,851.47	24,276,717.74
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本年年初余额	60,912,478.82	-	37,766,024.69	98,678,503.51	13,689,866.27	-	10,586,851.47	24,276,717.74
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	-41,499,098.74	-	-23,675,013.13	-65,174,111.87	47,222,612.55	-	27,179,173.22	74,401,785.77

(一) 综合收益总额	-	-	6,303,480.91	6,303,480.91	-	-	-7,446,137.75	-7,446,137.75
(二) 产品持有人申购和赎回	-41,499,098.74	-	-29,978,494.04	-71,477,592.78	47,222,612.55	-	34,625,310.97	81,847,923.52
其中：产品申购	1,909,753.55	-	1,390,246.45	3,300,000.00	49,563,916.28	-	36,236,083.72	85,800,000.00
产品赎回	-43,408,852.29	-	-31,368,740.49	-74,777,592.78	-2,341,303.73	-	-1,610,772.75	-3,952,076.48
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	-
(四) 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本年年末余额	19,413,380.08	-	14,091,011.56	33,504,391.64	60,912,478.82	-	37,766,024.69	98,678,503.51

#### 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	32,471,402.40	96.70
4	金融衍生品投资	0.00	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	1,108,121.50	3.30
7	其他资产	673.97	0.00
8	资产合计	33,580,197.87	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	SLY384	衍复恒星增强一号私募证券投资基金	6,808,359.22	8,057,012.30	24.05
2	RLZX1A	睿量智行1号私募证券投资基金A类份额	4,420,085.17	7,154,791.86	21.35
3	T05723	信弘征程2号私募证券投资基金B类份额	5,725,178.72	6,826,130.59	20.37
4	TS091B	世纪前沿量化优选1号私募证券投资基金B类份额	4,269,070.16	5,037,075.88	15.03
5	SM190B	明泓股票精选38期私募证券投资基金B类份额	3,687,752.46	3,907,911.28	11.66

## (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 100.23%。

## 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	24	赵翀先生，上海财经大学金融学硕士，拥有 24 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：

受地产低迷、地方债务等问题拖累，2023 年国内经济疫后复苏力度和企业盈利低于年初预期，叠加下半年中美利差加速走阔压制估值，A 股市场以下跌为主，全年沪深 300 下跌 11.38%，上证指数跌 3.70%，创业板指跌 19.41%，中证 500 跌 7.42%，恒生指数跌 13.82%。申万一级行业分化明显，表现前五的行业为通信（25.75%）、传媒（16.80%）、计算机（8.97%）、电子（7.25%）、石油石化（4.32%），表现靠后的行业有美容护理（-32.03%）、商贸零售（-31.30%）、房地产（-26.39%）、电力设备（-26.19%）、建筑材料（-22.64%）。

远见 FOF 系列主观策略跟踪池产品收益均位数为（-6.6%），量化策略跟踪池产品收益均位数为（5.49%），量化策略回报显著优于主观策略。

#### 市场展望：

尽管短期来看，中国正在经历后疫情时代资产负债表修复和经济结构转型的阵痛期，但长期视角下资本市场并不缺乏投资机会。近 5 年来随着国内产业升级扎实推进，工业底层技术持续突破，国内高端制造业加速突破海外市场，使得微观行业在总量增长平淡的环境下仍然获得了爆发式增长的机会。

2024 年转机也许正在来临：国内方面，预计中央财政加杠杆将成为 2024 年破局的关键。2023 年 10 月份以来万亿特别国债、地方化债、新一轮房企救助相继落地，财政发力成为 2024 年的看点。目前我国中央财政仍有较大的潜在杠杆空间，有望为社会和市场主体注入更强的支撑和信心。海外来看，预计美元虹吸效应接近尾声，预计 2024 年美国财政将不可避免的



走向收敛，届时中美财政脉冲将走向收敛，经济差和利差也将收敛。

均值回归将是 2024 年 A 股的关键驱动。2023 年 3 季度上市公司利润同比增速已经由负转正，随着逆周期政策发力，需求端改善力度强化，盈利开启修复，将支撑企业实际价值。同时，A 股估值接近便宜，系统性风险释放充分，国内优势资产已经具备较好的配置价值。

### (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，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	托管人于业绩报酬提取日后 5 个工作日内按照管理人指令从本集合计划资产中一次性支取

## 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

2024 年 04 月 30 日