

海通资管锐思汇智 2 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：南京银行股份有限公司

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

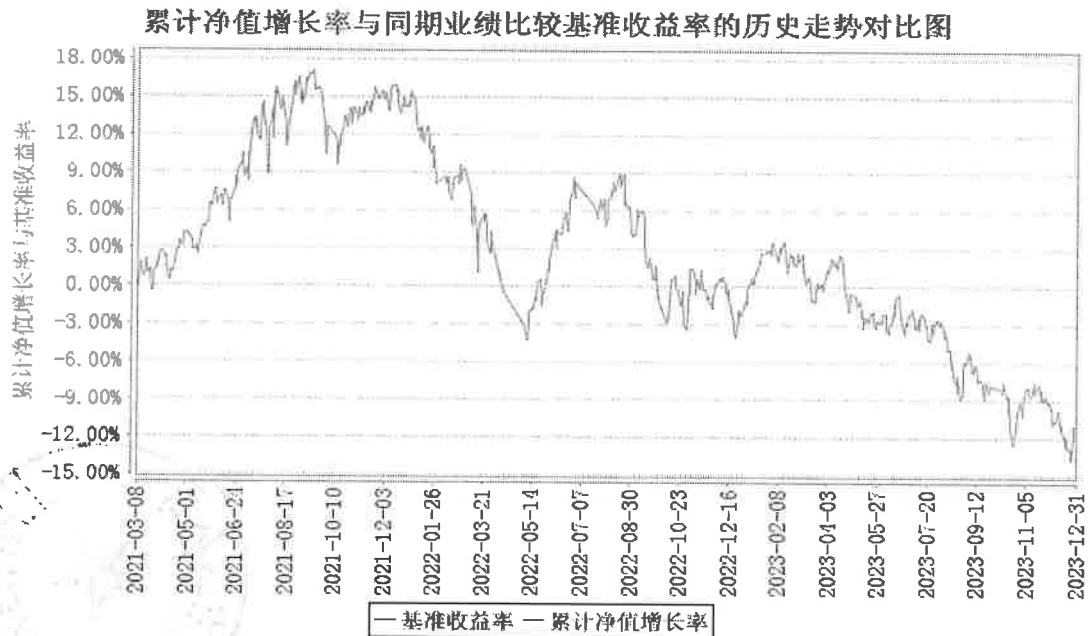
| | |
|---------|---------------------------|
| 投资组合名称: | 海通资管锐思汇智 2 号 FOF 集合资产管理计划 |
| 合同生效时间: | 2021-03-08 |
| 管理人: | 上海海通证券资产管理有限公司 |
| 托管人: | 南京银行股份有限公司 |

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) | 34,417,617.97 |
| 本期利润(元) | -3,447,097.85 |
| 份额净值(元) | 0.8768 |
| 份额累计净值(元) | 0.8768 |

(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 | 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 | 130,345.45 | 6,929.13 | 短期借款 | - | - |
| 结算备付金 | - | - | 交易性金融负债 | - | - |
| 存出保证金 | 350.74 | 1,132.06 | 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 | - | 2,252,100.82 | 应付管理人报酬 | 70,482.76 | 78,136.56 |
| 应收利息 | - | - | 应付托管费 | 1,762.04 | 1,953.45 |
| 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 | - | -525.22 | 应付税费 | - | 51.41 |
| 发放贷款和垫款 | - | - | 应付清算款 | - | - |
| 交易性金融资产 | 34,365,166.58 | 36,027,910.89 | 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 | 6,000.00 | 6,000.00 |
| 长期股权投资 | - | - | 负债合计 | 78,244.80 | 86,141.42 |
| 其他资产 | - | - | 净资产： | - | - |
| - | - | - | 实收资本 | 39,252,144.44 | 39,605,736.58 |
| - | - | - | 其他综合收益 | - | - |
| - | - | - | 未分配利润 | -4,834,526.47 | -1,404,330.32 |
| - | - | - | 净资产合 | 34,417,617.97 | 38,201,406.26 |

| | | | | | |
|-------|---------------|---------------|-----------|---------------|---------------|
| | | | 计 | | |
| 资产总计: | 34,495,862.77 | 38,287,547.68 | 负债与净资产总计: | 34,495,862.77 | 38,287,547.68 |

(二) 利润表

| 项 目 | 本期金额 | 上期金额 |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 一、营业总收入 | -3,134,323.53 | -7,845,752.22 |
| 利息收入 | 2,710.90 | 14,432.55 |
| 投资收益（损失以“-”填列） | -3,227,277.89 | -2,266,190.51 |
| 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） | 90,243.46 | -5,623,968.41 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 其他业务收入 | - | 29,974.15 |
| 二、营业总支出 | 312,774.32 | 349,853.33 |
| 管理人报酬 | 299,290.27 | 335,243.48 |
| 其中：暂估管理人报酬 | - | - |
| 托管费 | 7,482.21 | 8,381.09 |
| 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 | 1.84 | 228.76 |
| 其他费用 | 6,000.00 | 6,000.00 |
| 三、利润总额 | -3,447,097.85 | -8,195,605.55 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -3,447,097.85 | -8,195,605.55 |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | - | - |
| 六、综合收益总额 | -3,447,097.85 | -8,195,605.55 |

(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 | 39,605,736.58 | - | -1,404,330.32 | 38,201,406.26 | 45,381,719.78 | - | 7,010,121.14 | 52,391,840.92 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 二、本年年初余额 | 39,605,736.58 | - | -1,404,330.32 | 38,201,406.26 | 45,381,719.78 | - | 7,010,121.14 | 52,391,840.92 |
| 三、本年增减变动额（减少以“-”号填 | -353,592.14 | - | -3,430,196.15 | -3,783,788.29 | -5,775,983.20 | - | -8,414,451.46 | -14,190,434.66 |

| | | | | | | | | |
|---|-------------------|---|-------------------|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| 列) | | | | | | | | |
| (一) 综合收 益总 额 | - | - | -3,447,097 .85 | -3,447,097 .85 | - | - | -8,195,605 .55 | -8,195,605. 55 |
| (二) 产 品持 有人 申 购 和 赎 回 | -353,592.1 4 | - | 16,901.70 | -336,690.4 4 | -5,775,983 .20 | - | -218,845.9 1 | -5,994,829. 11 |
| 其 中： 产 品 申 购 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产 品 赎 回 | -353,592.1 4 | - | 16,901.70 | -336,690.4 4 | -5,775,983 .20 | - | -218,845.9 1 | -5,994,829. 11 |
| (三) 利 润分 配 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| (四) 其 他综 合收 益结 转留 存收 益 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 四、 本 年 期 末 余 额 | 39,252,144 .44 | - | -4,834,526 .47 | 34,417,617 .97 | 39,605,736 .58 | - | -1,404,330 .32 | 38,201,406. 26 |

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 | 34,365,166.58 | 99.62 |
| 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 | 130,345.45 | 0.38 |
| 7 | 其他资产 | 350.74 | 0.00 |
| 8 | 资产合计 | 34,495,862.77 | 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 | 166301 | 华商新趋势优选混合 | 236,533.33 | 2,105,619.70 | 6.12 |
| 2 | 630008 | 华商策略精选混合 | 926,982.96 | 1,599,972.59 | 4.65 |
| 3 | 161115 | 易方达岁丰添利债券(LOF)A | 998,199.94 | 1,594,125.30 | 4.63 |
| 4 | 110018 | 易方达增强回报债券B | 1,097,293.34 | 1,461,594.73 | 4.25 |
| 5 | 002872 | 华夏智胜价值成长股票C | 908,147.90 | 1,351,959.78 | 3.93 |

(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 |
|--------|----|--------|--|
| 左秀海 | 硕士 | 13 | 左秀海先生，同济大学经济学硕士，13年证券从业经验，曾任海通证券销售交易总部交易管理部经理，海通证券零售与网络金融部交易管理部经理，海通证券财富管理中心交易管理及运营部经理、总经理助理、副总经理，2021年加入上海海通证券资产管理有限公司，现任投资总监（副总经理级）兼组合投资部总监。 |

(二) 投资策略回顾与展望

2023年是中国经济从疫情走出后恢复发展的第一年，经济呈现出弱复苏特征，制造业能力反映在出口方面看出了一定韧性，但国内需求恢复较慢，同时围绕地方政府债务风险和房地产领域风险进行化解，取得一定成效，但对经济增速造成了一定制约。大类资产上，债券不断上涨如实反映了经济的悲观预期和货币政策逆周期调节效果，与之对应的，权益市场则通过高股息和美股科技股映射来同步反映这个状况，其余板块表现非常不理想，全年权益市场表现延续羸弱特征。展望2024年，中国将通过中央财政全力支持经济复苏和发展，围绕三大工程和设备更新周期推动经济增长继续保持5%左右的水平，同时把CPI目标定在3%，力图结束物价持续走低和负反馈局面，我们觉得以上两个主线将是跟踪和投资中国资本市场的脉络。

(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 | 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。 |

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

自2023年11月29日起，赵星宇女士不再担任本集合计划投资经理，由左秀海先生管理本集合计划。

(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 | 富国研究精选灵活配置混合C | 470,912.14 | 470,912.14 | 1,129,718.22 |
| 2 | 海富通改革驱动 | -892,055.86 | 0.00 | 0.00 |

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

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