

海通资管锐思汇智 2 号 FOF 集合资产管理计划

2023 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：南京银行股份有限公司

报告期间：2023 年 10 月 01 日-2023 年 12 月 31 日

报告送出日期：2024 年 01 月 31 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)	-1,268,517.31
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



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	34,365,166.58	99.62
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	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

本集合资产管理计划本报告期末的杠杆比率（总资产/净资产）为 100.23%。

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
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

四季度，产品配置中股票及混合偏股占比 81.19%，混合偏债占比 17.32%，QDII 产品占比 1.49%。四季度 A 股市场震荡下跌，上证 50 指数、沪深 300 指数跌幅较大，分别为-7.5%、-7.4%，中证 500 指数跌幅-4.6%，产品四季度收益率为-3.55%，相较于指数具有稳定的超额。2023 年，市场持续大幅下行，主动管理型的权益类基金年内复权单位净值增长率中位值是-12.63%。2023 年主动管理型基金指数跑输市场，主要原因为公募基金资金流入为负，存量博弈的状态明显；另外，小盘成长风格占优，大中盘价值风格基金相对跌幅较小。

对于后市，今年的关注点更多是紧盯中央财政政策的力度和进展，寻找阶段性进攻机会。未来 6-10 个月，基于经济恢复、估值优势和外部金融及地缘政治情况，A 股将有望逐步走出一波估值修复行情，账户管理将重点关注财政政策和风险偏好是否超预期。基于此，采用深度左侧研究，右侧布局的思路，调整底层仓位和占比。

（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

自2023年11月29日起，赵星宇女士不再担任海通资管锐思汇智2号FOF集合资产管理计划投资经理，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	0.00	470,912.14	1,129,718.22

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

2024年01月31日

