

# 海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划

## 2024 年 2 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：招商银行股份有限公司上海分行

报告期间：2024 年 04 月 01 日-2024 年 06 月 30 日

报告送出日期：2024 年 07 月 31 日

## 一、基本信息

投资组合名称:	海通资管博睿科创精选 1 号集合资产管理计划
合同生效时间:	2019-08-30
管理人:	上海海通证券资产管理有限公司
托管人:	招商银行股份有限公司上海分行

## 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)	29,727,830.83
本期利润(元)	-566,515.26
份额净值(元)	0.7980
份额累计净值(元)	0.8280

### (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	16,026,081.11	52.99
	其中：股票	16,026,081.11	52.99

2	固定收益投资	151,923.17	0.50
	其中：债券	151,923.17	0.50
	资产支持证券	-	0.00
3	基金	-	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	6,360,000.00	21.03
6	银行存款及结算备付金合计	7,694,932.08	25.45
7	其他资产	8,302.42	0.03
8	资产合计	30,241,238.78	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

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
1	002156	通富微电	101,000.00	2,261,390.00	7.61
2	301308	江波龙	16,800.00	1,591,632.00	5.35
3	603501	韦尔股份	15,200.00	1,510,424.00	5.08
4	688596	正帆科技	44,500.00	1,468,500.00	4.94
5	300373	扬杰科技	37,300.00	1,450,970.00	4.88
6	688012	中微公司	9,100.00	1,285,466.00	4.32
7	300054	鼎龙股份	53,700.00	1,217,916.00	4.10
8	688123	聚辰股份	19,317.00	1,175,053.11	3.95
9	688518	联赢激光	56,500.00	943,550.00	3.17
10	300782	卓胜微	10,300.00	800,722.00	2.69

## (三) 委托资产投资前五名债券（按市值）明细

序号	债券代码	债券名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
1	123085	万顺转2	910.00	88,461.22	0.30
2	128122	兴森转债	100.00	12,474.96	0.04
3	123067	斯莱转债	100.00	11,390.95	0.04
4	113053	隆22转债	100.00	10,174.79	0.03
5	113641	华友转债	100.00	10,146.88	0.03

## (四) 委托资产投资前五名基金（按市值）明细

注：本集合计划本报告期末未持有基金。

## (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 101.73%。

## 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
韩传青	硕士	7	南京大学产业经济学硕士，曾任海通资管权益研究部研究员，权益投资一部投资经理助理，现任海通博睿科创精选 1 号投资主办人。

### (二) 投资策略回顾与展望

#### 市场回顾

2024 年 Q2，上证指数下跌 2.43%、深证成指下跌 5.87%、创业板指下跌 7.41%，沪深 300 指数下跌 7.41%。细分行业来看，中信银行、电力及公用事业、交通运输和煤炭等行业表现较为强势，取得 2% 以上的正收益，中信综合、消费者服务、传媒和商贸零售等表现较为弱势，均录得 15% 以上的负收益。回顾整个 2024Q2，A 股市场在 2 月反弹以来，风险偏好有所下降，以银行、煤炭等为代表的高股息资产表现出不错的相对收益。海通博睿科创精选 1 号，在 2024 年 Q2 取得 -1.81% 的收益。

#### 市场展望

正如上文对于 Q2 市场行情的回顾，参考 A 股历史上短期大幅下跌后续走势，市场当前的核心分歧在于宏观基本面的表现。从 2024 年 6 月出的宏观经济数据来看，喜忧参半，经济仍处于复苏过程中。具体来看：6 月出口数据，以美元计，同比增长 8.6%，强于预期；6 月新增社融 3.3 万亿，新增人民币贷款 2.1 万亿，M1 降幅扩大至 5%，M2 增速回落至 6.2%；二季度 GDP 同比 4.7%（前值 5.3%），社会消费品零售总额同比 2%（前值 3.7%），规模以上工业增加值同比 5.3%（前值 5.6%），经济数据有所回落。海外来看，美国 6 月通胀数据低于预期，随后鲍威尔发言，美联储不必等到通胀率降至 2% 才会考虑降息，偏鸽派，降息预期提前。

#### 操作策略

今年二季度，产品第二次合同变更生效，投资经理对产品权益资产进行重新建仓。当前，市场的主要矛盾依然在弱势的宏观基本面和较低的市场交易量上，呈现出来的特点就是板块轮动加快，仓位择时大于行业配置。在后续仓位管理上，产品会密切关注市场的风险偏好情况，在市场整体风险抬升之前，仍会维持基础仓位运作。在持仓和加仓方向上，产品仍会积极关注出现周期向上的“拐点”型的大盘科技成长股，在中报季会积极把握一些 EPS 超预期的个

股机会。

### (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	1.200%
计提方式	每日计提
支付方式	按季支付

### (二) 托管费

计提基准	0.030%
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	年化收益率
计提方式	期间年化收益率 (R) < 8%，计提比例为 0%；期间年化收益率 (R) ≥ 8%，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，托管人根据业绩报酬划付指令执行相关操作。

## 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

截至本报告期末，董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东及其他关联方参与本集合计划的总计持有金额为 401,484.44 元。

### (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

本报告期内，本集合计划合同进行了变更并于 2024 年 5 月 29 日起生效。

## 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07月31日