

2022 年 10 月 11 日

➤ 配置策略及建议:

产品配置方面, 优选收益一号三季度净值上涨 0.09%, 受权益市场下跌拖累, 偏股开放式混合基金和转债持仓贡献负收益, 仓位上继续保持谨慎, 同时寻找转债的波段交易机会, 信用债贡献较高正收益, 开放式债券基金也贡献了一部分正收益, 四季度整体控制权益资产仓位, 继续持有部分高收益信用债, 城投债方面将继续严控资质和久期, 积极参与公募 Reits 和可转债的打新。

➤ 投资业绩

利可优选收益一号	沪深300指数	创业板指数
本季收益率	0.09%	-14.82%
本季最大回撤	-1.66%	-15.37%
今年以来最大回撤	-3.65%	-28.65%
成立以来收益率	16.46%	-31.39%
成立以来年化收益率	13.44%	-17.89%
成立以来最大回撤	-3.65%	-39.59%



利可优选收益一号私募证券投资基金月度收益率（单位：%）

时间	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年收益率
2020												0.00	0.00
2021	-0.26	-0.39	0.48	1.65	0.95	0.49	0.28	2.29	1.10	0.42	1.30	1.55	10.27
2022	2.09	2.22	-3.25	2.35	1.29	1.14	0.89	-0.76	-0.06	-0.31			

➤ 投资组合



➤ 产品概况

成立时间	2020-12-30	投资经理	傅金锡
产品类型	固收+	托管机构	广发证券
固定费用	固定管理费：1%/年 托管及外包服务费：0.1%	开放日	周一
业绩报酬	收益超过6% 以上部份提取40%		

➤ 投资经理回顾及展望

产品配置方面，优选收益一号三季度净值上涨 0.09%，受权益市场下跌拖累，偏股开放式混合基金和转债持仓贡献负收益，仓位上继续保持谨慎，同时寻找转债的波段交易机会，信用债贡献较高正收益，开放式债券基金也贡献了一部分正收益，四季度整体控制权益资产仓位，继续持有部分高收益信用债，城投债方面将继续严控资质和久期，积极参与公募 Reits 和可转债的打新。

免责声明

本报中的所有信息均来源于市场公开资料，我公司对相关信息的准确性和完整性不作任何保证。报告中的信息或所表达的意见，不构成买卖建议，但我公司可能持有报告中提到的公司所发行的证券头寸并进行交易。本报告版权归我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得擅自以任何方式翻版、复制、刊登、发表或引用。