

利可优选收益一号私募证券投资基金 2022年四季度季度报告

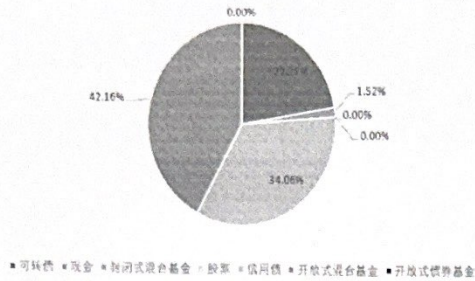
投资业绩

利可优选收益一号	沪深300指数	创业板指数
本季收益率	3.13%	2.53%
本季最大回撤	-0.30%	8.03%
2022年最大回撤	-3.65%	-33.83%
成立以来收益率	20.44%	-19.09%
成立以来年化收益率	10.22%	-9.55%
成立以来最大回撤	-3.65%	-39.65%



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	2.88	-0.28	10.17

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

产品方面, 优选收益一号四季度净值上涨 3.13%, 受权益市场情绪好转影响, 偏股开放式混合基金和转债持仓贡献正收益。展望 2 月往后, 伴随着两会临近, 未来越来越多重磅的刺激政策伺机而动, 对于权益类基金, 调整就是加仓的机会。我们将适当提高风险偏好, 保持相对较高的权益类基金仓位, 同时寻找转债的波段交易机会。当然, 我们预计一季度信用债仍将贡献较高的正收益, 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。