

东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计 划2022年度资产管理报告

报告期：2022年1月1日-2022年12月31日

管理人：东海证券股份有限公司

托管人：广发银行股份有限公司



第一节 重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合资产管理计划托管人广发银行股份有限公司于2023年3月1日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期由2022年1月1日起，至2022年12月31日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。

第二节 集合资产管理计划概况

名称:	东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计划
代码	A0D315
类型:	固定收益类集合资产管理计划
成立日:	2021年09月28日
成立规模:	10,620,668.24份
报告期末份额总额:	78,034,928.38份
管理人:	东海证券股份有限公司
托管人:	广发银行股份有限公司

第三节 管理人履职报告

一、履职情况

东海证券股份有限公司（以下称“本管理人”）依据《东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》、《东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划托管协议》，自 2021 年 9 月 28 日起管理东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）资产。现根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法规的规定，出具 2022 年度管理人报告。

2022 年度，本管理人在管理本计划资产期间，严格按照合同约定进行投资运作，不存在损害本计划持有人利益的行为。

二、投资主办人简介

刘畅，中国科学技术大学 MBA，20 年以上证券从业经验，历任东海证券股份有限公司证券事务代表，资产管理部投资经理。专注 FOF 产品的投资管理，擅长大类资产配置轮动，对管理人及产品的分析和遴选较有心得。不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

三、投资策略及展望

回顾 2022 年，在高通胀压力下欧美货币政策收紧，海外衰退风险累积，乌克兰危机等地缘政治危机持续，美元升值持续，主要国家货币相对贬值，人民币、欧元贬值幅度 10% 左右。权益市场风险偏好下行，沪深 300、中证 500 等指数跌幅 20% 左右。从全年来看，指数的走势主要可以分为四个阶段：第一阶段，1 月-4 月末。在美联储加息、俄乌战争带来对通胀的担忧之下，外资大幅流出，场内两融资金剧烈降低杠杆，上证指数从年初的 3600 点最低跌至 2863 点；第二阶段，从 5 月初至 6 月底。上海疫情解封之后，全社会复工复产和稳增长预期加码，在此期间，宏观政策频出，国务院也召开全国稳住经济大盘电话会议，央行调降房贷利率，市场反弹；

第三阶段，7月初至10月底。7月地产“停贷”事件发酵，房地产企业违约频发，多地疫情散发影响经济，海外美联储7月、9月连续两次加息75基点，离岸人民币快速贬值，指数再次从3400点下跌至2900点；第四阶段，11月初国内疫情防控二十条优化措施出台，地产维稳持续加码，房地产“三支箭”，从供给端着手，改善房地产行业的融资环境；美联储12月份加息50个基点，海外激进加息预期缓解。指数在震荡中上涨。北上资金2022年全年净流入900亿元，相比之前几年大幅度减少，两融资金年末在1.45万亿，相比2021年末降低约15%。从板块涨幅来看，全年煤炭与综合板块取得正收益，涨幅分别为10.95%、10.57%，电子、建筑材料、传媒分别以-36.54%、-26.12%、-26.06%的跌幅居前。

债券市场方面，2022年三季度，中债总全价指数上涨0.19%，中债银行间国债全价指数上涨0.47%，中债企业债总全价指数下跌1.44%。在收益率曲线上，中债10年期国债到期收益率区间震荡，最低下探至2.61%，由于疫情管控措施的放松与地产行业的纾困政策推进，国债利率在11月至12月上旬快速走高，10年期国债活跃券最高上行至2.99%，资金面方面，2022年，人民银行两次降准，两次分别全面降准0.25个百分点，提供超一万亿元长期流动性。降息方面，2022年1年期LPR和5年期以上LPR分别下降15个基点和35个基点，除跨年节点之外，整体银行间市场资金较为充裕。

展望2023年，中央经济工作会议提出扩大内需是2023年经济的主要抓手，要把恢复和扩大消费摆在优先位置。随着对新型冠状病毒感染实施“乙类乙管”的落实，国内人流物流已经畅通，宏观经济将从2022年四季度的低点回升。一季度将召开全国两会，目前市场普遍预期2023年经济增长目标在5%以上。乐观来看，海外美联储加息可能在2023年二季度达到终点，加息对全球风险资产的边际影响将减弱，整体有利于成长股的估值提升。短期来看，上市公司将经历2022年四季度以及一季度业绩的考验，等到业绩风险释放后，市场有望震荡上行。我们判断2023年全年上市公司业绩将实现两位数的增长，考虑到2022年指数的下跌主要是估值因素的影响，在盈利上行的趋势下，权益性价比很高。从市场风格来看，我们预计2023年大盘风格好于2022年，中小盘风格全年预计占优。2022年三季度中小板综合指

数、创业板指数 TTM 净资产收益率已经见底回升，上证综指、沪深 300 指数 TTM 净资产收益率预计在 2023 年一季度见底。

产品将加强对私募管理人的甄别和投后管理，继续寻找专业水平和道德水平过硬的合作伙伴，控制产品的流动性风险和波动率，平滑收益与回撤，给客户更好的持有体验。

东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划

2022 年年度托管报告

(2022 年 1 月 1 日—2022 年 12 月 31 日)

一、报告期托管人遵规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在本计划的保管过程中，严格遵守有关法律法规及合同协议的规定，不存在资金信托持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了保管人应尽的义务。

二、托管人对报告期内投资运作情况的说明

本报告期内，本托管人根据有关法律法规及合同协议的规定，对本计划的投资运作进行了必要的监督，对费用开支、收益分配等进行了认真的复核，未发现本计划有任何违反法律法规、合同协议及损害份额持有人利益的行为。

三、托管人对报告期内的财务信息发表意见

本报告期内，本托管人认真复核了管理人提供的财务数据、信息披露报告等材料，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

广发银行股份有限公司

2023 年 3 月 1 日

第五节 资产管理计划投资表现

一、集合资产管理计划份额变动（单位：份）

期初份额总额	34,019,538.60
红利再投资份额	0.00
报告期间净申购份额	44,015,389.78
报告期末份额总额	78,034,928.38

二、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	4,360,973.82
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	2,307,886.20
期末资产净值	84,891,165.59
期末每份额净值	1.0879
期末每份额累计净值	1.0879

三、业绩表现

截止到2022年12月31日，集合计划单位净值为1.0879元，累计净值1.0879元，产品的本期净值增长率为6.33%。

第六节 资产管理计划投资组合报告

一、期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
基金投资	6,992,100.34	8.22%
私募基金投资	64,678,433.70	76.01%
银行存款及清算备付金合计	3,743,484.18	4.40%
其他资产	9,677,883.91	11.37%
总资产合计	85,091,902.13	100.00%

注：本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第七节 资产管理计划运用杠杆情况

本报告期末，本集合计划资产总值与资产净值的比例为100.2365%，其中正回购资金余额为0。

第八节 资产管理计划相关费用情况

一、管理费

1、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 1.00%。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年管理费率} \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

2、计提方式

管理费每日计提，按季支付。

3、支付方式

经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度结束后的次月首日起 3 个工作日内依据管理人划款指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至下一个工作日。

二、托管费

1、计提基准

本集合计划的托管费按前一日集合计划的资产净值计提。托管费的年费率为 0.03%。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

2、计提方式

托管费每日计提，按季支付。

3、支付方式

经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度结束后的次月首日起 3 个工作日内依据管理人划款指令从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至下一个工作日。

三、业绩报酬

1、计提方式

以投资者的参与日（初始募集期参与的为资产管理计划成立日，存续期参与的为参与日）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。其中业绩报酬计提日即为资产管理计划投资者退出日和资产管理计划终止日。

2、支付方式

业绩报酬由管理人依据本集合计划合同计算并复核，托管人不承担复核义务。业绩报酬在业绩报酬计提日提取，管理人在提取业绩报酬当日以邮件等方式告知投资人，并向托管人发送业绩报酬提取金额。托管人据此入账，并于 5 个工作日内依据管理人出具的业绩报酬划款指令从资产管理计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

第九节 集合资产管理计划投资收益分配情况

本集合计划不进行收益分配。

第十节 重大事件揭示

一、关联交易情况

1、本报告期内，本产品投资于管理人及管理人关联方设立的资产管理产品的情况：2022年2月8日申购东海证券股份有限公司旗下的“东海证券海鑫添利短债债券型集合资产管理计划”，基金代码970081，申购金额5,000,000元人民币；2022年3月7日申购东海证券股份有限公司旗下的“东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划”，基金代码970082，申购金额1,000,000元人民币。2022年5月16日申购东海证券股份有限公司旗下的“东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划”，基金代码970082，申购金额500,000元人民币。

2、本报告期内，本产品投资于本机构、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或者承销期内承销的证券的情况：无。

二、本报告期末，本产品发生管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划的份额：920,815.60份，占全部份额的1.18%。

三、自有资金参与情况：本报告期末，自有资金参与本集合计划300,000.00份，占全部份额的0.38%。

四、其他重要公告：

序号	公告事项	披露日期	披露方式
1	关于东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划开放期有关事项的公告	详情见官网	管理人网站
2	关于新增上海云湾基金销售有限公司为东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划推广代理机构的公告	2022-02-08	管理人网站
3	关于东海证券海汇周利 FOF1 号集合资产管理计划关联交易的公告	2022-02-09	管理人网站
4	关于东海证券海汇周利 FOF1 号集合	2022-02-17	管理人网站

	资产管理计划暂停推广代理机构东海证券股份有限公司参与的公告		
5	关于东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划关联交易的公告	2022-03-08	管理人网站
6	关于东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划关联交易的公告管理人网站	2022-05-17	管理人网站
7	东海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2022-09-07	管理人网站
8	关于东海证券股份有限公司资产管理部负责人变动的公告	2022-11-22	管理人网站
9	关于东海证券股份有限公司高级管理人员变动的公告	2022-11-30	管理人网站
10	关于东海证券股份有限公司资产管理部分管领导变动的公告	2022-12-01	管理人网站

第十一节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计划集合资产管理合同》；
- 2、《东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计划说明书》；
- 3、报告期内东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计划在管理人网站披露的各项公告；
- 4、中国证监会要求的其他文件。

二、查询方式

网址：<http://www.longone.com.cn>

客户服务电话：95531

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东海证券股份有限公司。

