

东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计 划2023年第一季度资产管理报告



报告期：2023年1月1日-2023年3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4月14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未经审计。

本报告期由2023年1月1日起，至2023年3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:	134,641,130.92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》、《东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《东海证券海汇周周利 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 2023 年第一季度管理人报告。

2023 年第一季度，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

1、市场回顾

2023 年一季度，10 年期国债收益率上行 2BP，1 年期国债上行 14BP，1 年期中债隐含评级 AAA 城投债收益率上行 6BP，其他品种多数下行，1-3 年中债隐含评级 AA 和 AA(2) 城投债下行 36-97BP 不等。报告期内，10 年期国债收益率先上后下，转折点发生在 3 月 3 日央行新闻发布会，央行新闻发布会内容指出货币、信贷、社融政策将回归正常化，经济更多依靠自身动能修复，同时肯定了降准释放长期流动性对支持实体经济的效果，而后两会给出一个偏保守的经济增长目标，降低了市场对后面稳增长政策和经济的预期，随着经济数据表现出弱修复的特征，10 年期国债收

益率震荡下行。在 10 年期国债收益率窄幅变动、资金面中性偏松的情况下，随着资金回流，前期大幅偏离的信用债收益率逐步修复。2023 年一季度，产品加大了杠杆操作。

2 市场展望

从 2、3 月份社融数据看，社融的贡献主要来自于：1) 信贷和财政政策支持下，信贷重点投放，比如基建重大工程；2) 银行在一季度的集中投放，早放贷早收益；3) 地产、消费积压需求释放带来商品房销售增速上行，居民贷款明显多增。3 月 CPI 同比增速继续下行，低于市场预期，PPI 环比持平 2 月份，但因基数抬升，同比跌幅扩大，由于消费修复强度不及预期，市场对物价从通胀转向通缩。虽然一季度经济、社融数据都比较好，但经济内生复苏动力来源于疫情期间积压的需求释放，随着需求释放的高峰过后，叠加出口压力增大，经济增长动能趋势减弱，二季度债券利率或继续震荡下行，同时货币政策回归常态，资金价格虽有抬升，但量够，信用债也将继续修复，特别是个券的超额利差。

3、投资计划

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

2023 年一季度托管报告

(2023 年 1 月 1 日—2023 年 3 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 4 月 14 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	78,034,928.38
红利再投资份额	0.00
报告期间净申购份额	56,606,202.54
报告期末份额总额	134,641,130.92

二、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	2,465,702.51
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	909,354.03
期末资产净值	149,729,054.08
期末每份额净值	1.1121
期末每份额累计净值	1.1121

三、业绩表现

截止到2023年3月31日，本集合计划单位净值为1.1121元，累计净值1.1121元，产品的本期净值增长率为2.22%。

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	18,860,708.50	12.57%
私募基金投资	123,195,954.42	82.12%
银行存款及清算备付金合计	3,899,145.55	2.60%
其他资产	4,070,449.32	2.71%
总资产合计	150,026,257.79	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100.1985%，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，本集合计划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：无。

2、本报告期内，本集合计划投资于本机构、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，本集合计划发生管理人董事、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：无。

三、自有资金参与情况：无。

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	东海证券股份有限公司高级管理人员变更公告	2023-02-01	管理人网站
3	关于东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划自有资金退出的公告	2023-02-17	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。

