

# 东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计 划2023年第四季度资产管理报告

报告期：2023年10月1日-2023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2024年1月26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10月1日起，至2023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: | 84,233,272.86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 年第四季度管理人报告。

2023 年第四季度，本管理人在管理本集合计划资产期间，严格按照合同约定进行投资运作，不存在损害本集合计划持有人利益的行为。

#### 二、投资经理简介

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

2023 年四季度，A 股主要指数均调整，上证指数下跌 4.36%，深证成指下跌 5.79%，创业板指数下跌 5.62%。指数四季度在众多利好的支持下仍旧疲软，尤其在 9、10 月份出现了单边下跌的趋势，上证指数跌破了 3000 点，沪深 300 指数也击穿了 2022 年四季度的低点。四季度，各种政策已经进入了落实推进阶段，上证指数跌破 3000 点之后有所反弹，但 11 月中旬开始指数再次转向，场内交易量萎缩。从季度数据来看，煤炭、电子与农林牧渔分别以 4.18%、3.92%、1.73% 的涨幅居前，美容护理、房地产与建筑材料分别以 -14.55%、-14.47% 和 -14.47% 的跌幅居前。

从经济基本面的部分数据来看，四季度经济处于低位恢复的过程中，1—11 月份，全国规模以上工业企业实现利润总额 69822.8 亿元，同比下降 4.4%，降幅比 1—10 月份收窄 3.4 个百分点。11 月份，规模以上工业企业实现利润同比增长 29.5%，已经连续 4 个月实现了增长。国家统计局公布的 10—12 月 PMI 数据分别为 49.5、49.4、49，显示制造业呈现收缩的态势，而反应价格信号的两个数据，11 月 CPI 同环比数据同时为-0.5%，PPI 同比-3%，环比-0.3%，显示四季度经济通缩的压力比较大。进入四季度后，海外美联储的加息步伐已经暂停，美国 10 年期国债收益率也从 5% 的高位回落至 4% 以下，但是海外资金对国内资产的配置仍在流出。进入 8 月份，北向资金对于 A 股的配置一直处于下降趋势，截至 12 月 22 日，近 6 月流出 1667 亿元，在此背景下，上证 50 指数也跌穿了 2018 年年底的低点，存量资金博弈下，市场机会乏善可陈，市场投资者的信心极度孱弱。

展望未来一个季度，从经济基本面来看依然处于磨底的状态，央行可能在 2024 年降准降息以刺激经济增长。从指数估值角度看，截至 2023 年年末，上证指数动态市盈率为 11.09 倍，已经低于 2008 年低点位置，其他主要指数估值也均处于历史低位，指数在连续下跌 2—3 年之后在 2024 年继续大幅下跌的概率不大。伴随着国内经济向上的动能积蓄强劲以及海外高利率的环境到顶，预计新的一年海外资金有望重新增加对 A 股的配置，资金流动性层面有望好转。

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 年四季度托管报告

(2023 年 10 月 1 日—2023 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。



## 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    | 119,273,546.82 |
| 红利再投资份额   | 0.00           |
| 报告期内净申购份额 | -35,040,273.96 |
| 报告期末份额总额  | 84,233,272.86  |

### 二、主要财务指标（单位：人民币元）

|                      |               |
|----------------------|---------------|
| 本期利润                 | 780,172.50    |
| 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 4,113,027.66  |
| 期末资产净值               | 96,994,624.73 |
| 期末每份额净值              | 1.1515        |
| 期末每份额累计净值            | 1.1515        |

### 三、业绩表现

截止到2023年12月31日，本集合计划单位净值为1.1515元，累计净值1.1515元，产品的本期净值增长率为0.85%。

## 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         | 5,007,537.09  | 5.15%   |
| 私募基金投资       | 89,669,457.06 | 92.14%  |
| 银行存款及清算备付金合计 | 2,639,823.84  | 2.71%   |
| 其他资产         | 108.84        | 0.00%   |
| 总资产合计        | 97,316,926.83 | 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100.3323%，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：8,623,846.18 份，占全部份额的10.24%。

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  | 关于新增博时财富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 | 2023-10-13 | 管理人网站 |
| 3  | 关于东海证券股份有限公司资产管理部分领导变动的公告                         | 2023-10-13 | 管理人网站 |
| 4  | 东海证券股份有限公司基金行业高级管理人员任命公告                          | 2023-12-07 | 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。

