

东海证券海汇周周利FOF1号集合资产管理计 划2023年度资产管理报告

报告期：2023年1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3月22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2023年1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 年度管理人报告。

2023 年度，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，武汉理工大学材料科学与工程专业学士，中国科学技术大学工商管理硕士。2003 年以来，历任东海证券股份有限公司董事会办公室证券事务代表，资产管理部投资经理。

三、投资策略及展望

回顾 2023 年，上证指数自开年强势上涨至 3 月初，一度创出 7 个月新高，随后小幅开启震荡；深证成指和创业板指数在 1 月份触顶，并持续回调走低。以生成式 AI 为代表的 ChatGPT 引发的软件、游戏、互联网、云计算、半导体、数字经济等多个主题反复轮动，受到了资金的大量追捧，板块涨幅巨大。而以新能源汽车为代表的老赛道则在基本面的疲软之下遭到资金抛售，板块收益不佳。三四月份经济预期逐渐转弱，在经济数据走弱的同时，高股息低估值的资产受到青睐，“中特估”资产与 AI 成为市场唯二的两个主题投资方向。5 月之后，随着经济数据确认环比下滑，中特估板块跟随大势调整，6 月市场仅 AI 主题投资有一定的赚钱效应，6 月末也开始进入调整。三季度，随着政治局会议的召开，稳增长的政策开始发力，针对资本

市场的利好政策如降低印花税政策也出台，但是指数三四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。从年度数据来看，通信、传媒与计算机分别以 25.75%、16.79%、8.96% 的涨幅居前，美容护理、商贸零售与房地产分别以 -32.08%、-31.30% 和 -26.39% 的跌幅居前。

从经济基本面的部分数据来看，2023 年四季度的经济总体处于低位弱恢复的状态，反应价格指数的 CPI 持续 4 个月负增长，PPI 则从二季度的深度负增长缓慢修复，降幅缩窄。制造业与服务业 PMI 连续下降 4 个月之后小幅回升，建筑业景气度保持较高。M1 增速接近历史新低之后 24 年 1 月开始反弹，但是整体信用传导仍然不通畅。房地产开发投资增速仍在扩大，对经济的拖累仍在持续。12 月份召开的中央经济工作会议对经济形式的判断是有效需求不足、部分行业产能过剩、社会预期偏弱、风险隐患仍然较多，国内大循环存在堵点。进入 2024 年之后，跟踪高频经济数据可以发现，地产的销售仍未见好转。展望 2024 年全年，受制于产能过剩，目前制造业产能利用率不高，受“三大工程”以及“保交楼”存量投资支撑，房地产投资跌幅有望收敛，全年来看，CPI、PPI 价格指数有望小幅修复带动名义 GDP 修复至实际 GDP 之上。在货币政策上，央行将强化逆周期和跨周期调节，从总量、结构、价格三方面发力，或将通过 PSL、降准等工具投放基础货币，当下实际利率偏高，全年来看政策利率存在下调的空间。

2024 年 1 月份至春节前夕，指数层面经历了一轮历史级别的下跌，在这轮下跌过程中，跟踪中证 500 和中证 1000 的雪球产品集中敲入，市场被动降杠杆对指数形成了短期的集中抛压，部分量化策略被动出清。在春节前夕，中央汇金公司于 2 月 6 日公告扩大了指数基金的增持范围，并将持续加大增持力度，市场信心得到极大恢复，止损盘、强平盘、恐慌盘减少，市场抛压减轻，各大指数在春节前夕依次大幅度反弹。从股债性价比指标来看，当下权益资产相对比债券资产的性价比已经处于历史很高的分位，拉长时间一年来看，我们认为指数在 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，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，我们判断指数层面全年有望实现正收益。

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 年年度托管报告

(2023 年 1 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。

广发银行股份有限公司

2024 年 3 月 22 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	6,198,344.48
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	6,546,847.95
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	7,203,321.34
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5.85%。

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
4	关于东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划恢复推广代理机构东海证券股份有限公司参与的公告	2023-05-19	管理人网站
5	关于新增博时财富基金销售有限公司为东海证券海汇周周利 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
6	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	2023-10-13	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。

