

东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计 划 2024 年第一季度资产管理报告

报告期：2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 3 月 31 日

管理人：东海证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司南京分行



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兴业银行股份有限公司南京分行于2024年4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2024年1月1日起，至2024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:	东海证券海汇月月利FOF1号集合资产管理计划
代码	A0D339
类型:	固定收益类集合资产管理计划
成立日:	2023年12月20日
成立规模:	16,275,169.43份
报告期末份额总额:	18,895,064.47份
管理人:	东海证券股份有限公司
托管人:	兴业银行股份有限公司南京分行

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《东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划托管协议》，自 2023 年 12 月 20 日起管理东海证券海汇月月利 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 2024 年第一季度管理人报告。

2024 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

2024 年 1-2 月份，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，各大指数在春节前大幅下跌，尤其是中证 1000、中证 2000 等小微盘指数，救市资金在春节前两天注入市场，汇金向市场注入了大量流动性买入多个宽基 ETF，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。春节过后，市场情绪有所好转，节前大幅下跌的指数反弹力度较大，上证指数在 2 月末重新站上 3000 点。3 月份，指数整体在 3000 点上方震荡，走势较为平稳。从季度数据来看，上证 50、沪深 300、上证指数涨幅 3.81%、3.10%与 2.23%，创业板指数与科创 50 指数跌幅-3.87%与-10.48%。从行业上来看，银行、石油石化与煤炭

分别以 10.60%、10.58%、10.46% 的涨幅居前，医药生物、计算机与电子分别以 -12.08%、-10.51% 和 -10.45% 的跌幅居前。

2024 年政府工作报告将国内生产总值的目标设定在 5%，增速与去年一致。财政政策方面，财政赤字率的目标仍然维持在 3%，全国财政赤字规模 4.06 万亿元，首次突破 4 万亿。国务院总理李强在报告中明确，从今年开始拟连续几年发行超长期特别国债，专项用于国家重大战略实施和重点领域安全能力建设，今年先发行 1 万亿元。一季度披露的多项经济数据也显示目前国内经济仍然是一种弱复苏的状态。由于今年春节与 23 年春节月份错位，1-2 月份数据存在较大的季节性效应。3 月的 PMI 数据为 50.8，显示制造业扩张的速度加快，3 月份 PMI 改善的幅度显著超过季节性，历史上 2 月春节在 2.15 之前的年份来看，剔除疫情显著影响的 2022 年，3 月 PMI 数据超过历史均值 0.5 个百分点，仅次于 2021 年，但非制造业中建筑业 PMI 环比改善的幅度显著低于历史同期。从价格信号来看，1-3 月 CPI 数据分别为 -0.8%、0.7%、0.1%，一季度整体与去年持平。1-3 月 PPI 数据分别为 -2.5%、-2.7%、-2.8%，整体来看一季度的经济通缩与产能过剩的压力还是比较大。外贸的复苏可能是一季度经济的一大亮点，从 23 年 11 月开始，表征全球制造业水平的摩根大通 PMI 数据已经回到荣枯线以上，1-2 月国内出口增速分别为 8.2% 与 5.6%，美国 3 月 ISM 制造业 PMI 上升 2.5 至 50.3，超出市场预期，海外发达经济体的补库存周期对出口存在一定的拉动。美国 3 月份 CPI 公布为 3.5%，较 2 月份 3.2% 有所上升，也高于预期值 3.4%，离美联储的目标 2% 仍有一定的距离，互换合约定价显示，目前市场预计的首次降息时间从 9 月推迟至 11 月，预计今年内美联储只会降息约 40 个基点。

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，由于目前的价格信号仍然偏弱，央行可能在 2024 年降准降息以刺激经济增长。

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。

东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划托管报告

(报告期：2024 年第一季度季报)

本托管人依据东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划的合同、说明书与托管协议（如有），自 2023 年 12 月 20 日起托管“东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《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》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议（如有）的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、本计划合同和托管协议（如有）的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期《资产管理报告》中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，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	16,275,169.43
红利再投资份额	0.00
报告期内净申购份额	2,619,895.04
报告期末份额总额	18,895,064.47

二、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	226,405.05
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	125,598.29
期末资产净值	19,130,870.48
期末每份额净值	1.0125
期末每份额累计净值	1.0125

三、业绩表现

截止到2024年3月31日，本集合计划单位净值为1.0125元，累计净值1.0125元，产品的本期净值增长率为1.24%。

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	6,033,112.80	31.45%
私募基金投资	11,644,579.24	60.70%
银行存款及清算备付金合计	1,507,509.01	7.86%
其他资产	169.43	0.00%
总资产合计	19,185,370.48	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100.2849%，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

资产管理计划财产的年管理费率为 1.00%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div 365$$

H 为每日应计提的资产管理费

E 为前一日的计划财产净值，首日按本计划成立规模计算

本计划投资于本计划管理人所管理的资产管理计划部分不收取固定管理费。

2、计提方式

管理费每日计提，按季支付。

3、支付方式

由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每自然季度初的第 5 个交易日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的管理费。

二、托管费

1、计提基准

资产管理计划财产的年托管费率为 0.015%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.015\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值，首日按本计划成立规模计算

2、计提方式

托管费每日计提，按季支付。

3、支付方式

由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每自然季度初的第 5 个交易日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。

三、业绩报酬

1、计提方式

以上一业绩报酬计提日（如上一业绩报酬计提日不存在，则初始募集期参与的为集合计划成立日，存续期参与的为参与日，下同）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集合计划分红权益登记日、投资者退出日和集合计划终止日。

2、支付方式

业绩报酬由管理人依据本合同计算并复核，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

本报告期内，本集合计划未进行收益分配。

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：1,875,234.36 份，占全部份额的 9.92%。

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	关于东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划暂停参与的公告	2024-1-31	管理人网站
2	关于新增上海天天基金销售有限公司为东海证券海汇月月利 FOF1 号集合资产管理计划推广代理机构的公告	2024-02-06	管理人网站

第十一节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《东海证券海汇月月利FOF1号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《东海证券海汇月月利FOF1号集合资产管理计划说明书》；
- 3、产品成立至报告期内东海证券海汇月月利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。

东海证券股份有限公司
二〇二四年四月二十六日

