

东海证券海阳3号集合资产管理计划

2021年第四季度资产管理报告

报告期：2021年10月1日-2021年12月31日

管理人：东海证券股份有限公司

托管人：中信银行股份有限公司



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中信银行股份有限公司于2022年1月20日复核了本报告中的财务指标。

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2021年10月1日起，至2021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:	东海证券海阳3号集合资产管理计划
代码	A0D312
类型:	集合资产管理计划
成立日:	2021年05月07日
成立规模:	62,549,463.42份
报告期末份额总额:	36,192,080.01份
管理人:	东海证券股份有限公司
托管人:	中信银行股份有限公司

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《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划说明书》、《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划托管协议》，自 2021 年 5 月 7 日起管理东海证券海阳 3 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 2021 年第四季度管理人报告。

2021 年第四季度，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

刘希辉，男，中国科学院微电子学博士，现任东海证券资产管理部投资经理，曾任东海证券研究所研究员、东海证券股份有限公司上海证券资产管理分公司研究员、投资经理、兴业银行兴业经济研究咨询股份有限公司信用分析师。在行业研究、信用研究以及资产管理业务领域从业 6 年，拥有丰富的研究及投资经验，投资风格稳健；对大类资产配置有独特见解；坚持价值投资、在严格控制风险的基础上获取绝对收益的投资理念。不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。本计划投资经理已具备证券从业与基金从业资格，近三年未有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

三、投资策略及展望

国内方面，2021 年 12 月 10 日中央经济工作会议通稿公布。会议首次以“三重压力”描述中国当前的经济现状，充分表达了政策层对短期稳增长的高度重视。12 月 PMI 数据显示制造业 PMI 录得 50.3，环比上升 0.2，连续第二个月重回扩张区间。从分项看需求仍比较低迷，生产分项 51.4 仍处于扩张区间但环比回落 0.6，表明生产扩张速度放缓；货币政策方面，12 月 6 日，央行发布公告决定于 12 月 15 日下调金融

机构存款准备金率 0.5 个百分点；央行四季度货币政策例会表示坚持稳健的货币政策要灵活适度，宏观稳杠杆的要求延续，精准加大重点领域金融支持力度，目前已经下发首批碳减排支持工具。

海外方面，美联储 12 月议息会议宣布加速缩减购债，点阵图显示市场加息预期提前，声明中删除对通胀的“暂时性”表述，经济预测中也大幅上调通胀预期。议息会议纪要显示，官员们已对货币政策正常化进行了充分讨论，且态度较为鹰派。不仅首次加息的时间点可能提前，更重要的是“缩表”也可能来的更快。

市场方面，四季度十年期国债收益率先上后下，进入 10 月后，随着通胀上行，国债收益率上行调整。在 10 月中到 12 月底，在通胀担忧下降、对经济增长担忧加强的背景下，利率重新下行。12 月之后，降准落地、LPR 降息，债市收益率重新下行。股市方面，四季度指数以反弹为主，中央经济工作会议之前指数震荡上涨，传媒、军工、汽车零部件等板块领涨。中央经济工作会议过后，市场整体下行偏弱。

展望 2022 年一季度，国内经济下行压力渐大，宏观政策将更加侧重于稳增长。2021 年四季度，海阳 3 号保持了光伏、储能、芯片等高端制造的仓位，增持了消费公司的仓位，新加配了地产竣工产业链公司的仓位、挂钩港股市场的指数基金。我们将密切跟踪宏观经济要素，在不同的宏观经济环境下配置最具性价比的资产，力争取得好的业绩表现。

第四节 托管人履职报告

在托管《东海证券海阳3号集合资产管理计划》（以下简称“委托资产”）的过程中，托管人中信银行股份有限公司严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等相关法律法规的规定以及《东海证券海阳3号集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券海阳3号集合资产管理计划托管协议》的约定，对委托资产的管理人东海证券股份有限公司2021年第四季度的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害委托人利益的行为。

在报告期内，本托管人未发现东海证券股份有限公司在委托资产的投资运作、委托资产净值的计算、费用开支等问题上，存在损害委托人利益的行为；未发现东海证券股份有限公司在产品运作中，存在违反有关法律法规和合同约定的行为。

本托管人认为，东海证券海阳3号集合资产管理计划2021年第四季度报告中的财务指标信息真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。



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	65,058,122.93
红利再投资份额	0.00
报告期间净申购份额	-28,866,042.92
报告期末份额总额	36,192,080.01

二、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	1,883,746.18
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	722,071.22
期末资产净值	39080420.52
期末每份额净值	1.0798
期末每份额累计净值	1.0798

三、业绩表现

截止到2021年12月31日，集合计划单位净值为1.0798元，累计净值1.0798元，产品的本期净值增长率为2.20%。

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
权益类投资	17,285,621.85	44.08%
基金投资	7,304,462.43	18.63%
固定收益类投资	3,801,879.68	9.69%
银行存款及清算备付金合计	516,765.03	1.32%
其他资产	10,307,099.38	26.28%
总资产合计	39,215,828.37	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100.3465%，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：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

管理费按日计提，按自然季度支付。

3、支付方式

由集合计划管理人于集合计划合同生效之日的每个自然季度首日起10个工作日内向集合计划托管人发送集合计划管理费划付指令，经集合计划托管人复核后于3个工作日内从集合计划资产中支付给集合计划管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

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：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管费

E为前一日集合计划资产净值

2、计提方式

托管费按日计提，按季支付。

3、支付方式

由集合计划管理人于集合计划合同生效之日的每个自然季度首日起 10 个工作日内向集合计划托管人发送集合计划托管费划付指令,经集合计划托管人复核后于 3 个工作日内从集合计划资产中支付给集合计划托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延,若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。本合同终止(包括提前或延期)后,依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

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

因涉及注册登记数据,业绩报酬由管理人依据本合同计算并复核,托管人根据管理人发送的指令执行划款操作。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集合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：无。

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：4,218,525.54 份，占全部份额的 11.66%。

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 3,936,507.94 份，占全部份额的 10.88%。

四、其他重要公告：

序号	公告事项	披露日期	披露方式
1	关于东海证券海阳3号集合资产管理计划开放期有关事项的公告	2021-10-25	管理人网站
2	关于东海证券海阳3号集合资产管理计划自有资金退出的公告	2021-11-03	管理人网站
3	关于东海证券海阳3号集合资产管理计划开放期有关事项的公告	2021-11-29	管理人网站
4	关于东海证券海阳3号集合资产管理计划开放期有关事项的公告	2021-12-27	管理人网站
5	东海证券股份有限公司关于资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	2021-12-31	管理人网站
6	关于新增上海天天基金销售有限公司为东海证券海阳3号集合资产管理计划推广代理机构的公告	2021-12-31	管理人网站

第十一节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《东海证券海阳3号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《东海证券海阳3号集合资产管理计划说明书》；
- 3、报告期内东海证券海阳3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。

