

东海证券添宁双月盈FOF1号集合资产管理计 划2022年第三季度资产管理报告

报告期：2022年7月1日-2022年9月30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



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于2022年10月28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2022年7月1日起，至2022年9月30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:	东海证券添宁双月盈FOF1号集合资产管理计划
代码	A0D329
类型:	固定收益类集合资产管理计划
成立日:	2022年05月18日
成立规模:	14,746,000.00份
报告期末份额总额:	42,244,045.10 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

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《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划托管协议》，自 2022 年 05 月 18 日起管理东海证券添宁双月盈 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 2022 年第三季度管理人报告。

2022 年第三季度，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

受海外市场大跌等因素冲击，三季度 A 股整体走弱，上证指数累计下跌 11.01%，深证成指下跌 16.42%，而创业板指表现最差，下跌 18.56%。回顾整个三季度，上证指数在 7 月初创下反弹的阶段高点，随后便开启调整之路，8 月份止跌反弹并一度逼近 3300 点，同时 A 股成交额也重回万亿元；9 月市场再度缩量磨底考验 3000 点。随着海内外不确定性因素交织共振，三季度北向资金增配 A 股的步伐放缓，期间共计净流出 196 亿元。一方面，美联储紧缩预期加速升温、人民币汇率承压、大国博弈担忧等因素反复扰动北向资金的风险偏好；另一方面，国内疫后复苏节奏趋缓、地产下行压力仍存等因素或在一定程度上压制了北向资金的增配意愿。板块方

面，三季度各行业普遍下跌，资金从高位赛道股撤出，转向了业绩强劲的煤炭等资源股，煤炭行业指数上涨 0.97% 涨幅居前，建筑材料、电力设备以及电子行业分别以 -23.98%、-18.01%、-17.58% 的跌幅居前。

债券市场方面，2022 年三季度，中债总全价指数上涨 0.8586%，中债银行间国债全价指数上涨 1.0431%，中债企业债总全价指数上涨 0.3342%。在收益率曲线上，中债 10 年期国债到期收益率从 2.8205% 下行至 2.7601%，中间振幅约 26BP。整个季度来看，利率在 7-8 月份受经济数据欠佳、房地产行业新闻的影响下行，8 月底之后，主要受美联储加息、美债利率上行、人民币汇率下跌的不利因素影响而快速上行。为降低实体经济融资成本，三季度央行在多方面做了支持，包括下调 MLF 利率。在贷款市场报价利率方面，8 月 22 日，LPR1 年期下降 5BP 至 3.65%，5 年期下降 15BP 至 4.3%。银行间市场资金较为充裕，资金价格稳定，除在季末时点外，R007\DR007 低于 OMO 政策利率约 40-50BP。

展望四季度，9 月份美联储加息落地，并且释放了更为鹰派的言论，大超市场预期。当前美国国债利率 10-2 年已倒挂，显示明年美国经济有可能进入衰退周期。在中美 10 年国债的利差倒挂超 100bp、人民币汇率一度破 7.2 的宏观条件下，境内资本市场对外盘变化的敏感度提升较多。此外，俄乌战争局势、欧洲能源危机的进展，有可能带来新的宏观变量。预计未来 A 股市场将呈现“上有盈利顶”和“下有估值底”的震荡格局，短期较难有指数级别行情，整体仍偏结构性机会。从市场估值看，今年市场经历了多轮回调之后，宽基指数估值重回中部偏下区间，市场短期快速调整和风险释放后，权益性价比很高，为市场提供了较好的底部支撑。

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。

东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划托管报告

(报告期: 2022 年 7 月 1 日- 2022 年 9 月 30 日)

报告期内, 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》及相关法律法规、本计划资产管理合同约定, 诚实信用、谨慎勤勉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, 托管人根据国家有关法律法规、本计划合同的规定, 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, 未发现其存在任何损害本计划委托人利益的行为。

托管人认真复核了本报告中的财务指标、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。

兴业银行股份有限公司南京分行

2022 年 10 月 28 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	40,587,078.59
红利再投资份额	0.00
报告期间净申购份额	1,656,966.51
报告期末份额总额	42,244,045.10

二、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	415,995.44
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	188,908.57
期末资产净值	42,760,002.75
期末每份额净值	1.0122
期末每份额累计净值	1.0122

三、业绩表现

截止到2022年9月30日，本集合计划单位净值为1.0122元，累计净值1.0122元，产品的本期净值增长率为0.95%。

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	1,014,179.62	2.36%
私募基金投资	38,068,232.03	88.66%
银行存款及清算备付金合计	2,352,938.44	5.48%
其他资产	1,500,128.84	3.49%
总资产合计	42,935,478.93	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100.4104%，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资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的集合计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）。

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估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在每个自然季初的前 5 个工作日内按照管理人指定的管理费账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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。

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资产净值的 0.02% 年费率计提，托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的集合计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）。

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估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在每个自然季初的前 5 个工作日内按照托管人指定的托管费账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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。

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资产管理计划成立日，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资产管理计划分红权益登记日、投资者退出日和资产管理计划终止日。

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：1,088,570.01份，占全部份额的2.58%。

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	东海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2022-09-07	管理人网站

第十一节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《东海证券添宁双月盈FOF1号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《东海证券添宁双月盈FOF1号集合资产管理计划说明书》；
- 3、报告期内东海证券添宁双月盈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。

