

# 东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计 划 2023 年第三季度资产管理报告

报告期：2023 年 7 月 1 日 - 2023 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2023年10月27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7月1日起，至2023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:	90,823,653.87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 2023 年第三季度管理人报告。

2023 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

2023 年三季度，A 股主要指数均调整，上证指数下跌 2.86%，深证成指下跌 8.32%，创业板指数下跌 9.53%。从季度数据来看，非银金融、煤炭与石油石化分别以 5.62%、5.26%、4.37% 的涨幅居前，电力设备、传媒与计算机分别以 -15.68%、-15.58% 和 -11.71% 的跌幅居前。

三季度的经济总体处于低位弱恢复的态势，反应价格指数的 CPI 从 7 月的 -0.3% 回升至 9 月的 0%，PPI 则从二季度的深度负增长缓慢修复，降幅缩窄。M2 与 M1 的裂口扩大，反应出当下社会资金的流动性不足，信用传导不畅通。制造业的 PMI 从 6 月开始缓慢修复，至 9 月份已经连续 4 个月环比增长，而出口的数据也呈现降幅



缩窄的趋势。房地产市场在三季度延续了二季度的低迷，金九银十并未出现。为了扭转经济下滑的预期，政策基调从七月的政治局会议开始发生实质变化。政治局会议提出“加强逆周期调节和政策储备”，特别对于房地产的表述去掉了“房住不炒”的基调，称“供需关系发生重大变化”“适时调整优化房地产政策”。随后以此为出发点，各部门开始紧锣密鼓出台各项托底政策。货币政策方面，央行在总量政策上推动了“存款利率下调”、“下调 MLF 及公开市场操作利率”、“降低存款准备金率”，在结构性政策上推动了“下调存量房贷利率”、“降低房贷首付比例”、“一城一策松绑限购”；根据央行的信息，存量房贷利率调整 9 月 25 日到 10 月 1 日实施首周，有 98.5% 符合条件的存量首套房贷利率完成下调，合计 4973 万笔、21.7 万亿元；调整后的加权平均利率为 4.27%，平均降幅 0.73 个百分点。财政政策方面，财政部推动了“小微企业和个体减半征收所得税”、“万亿再融资债券发行缓解隐债”、“减半征收印花税”等政策。7 月 24 日中央政治局会议首次提出“制定实施一揽子化债方案”后，财政系统牵头的特殊再融资债券置换工作提速，10 月以来在多省份陆续落地。截至 10 月 13 日，18 省份披露发行资金用途为“偿还存量债务”的特殊再融资债券超 7000 亿元。

海外方面，美联储在 9 月份维持利率不变，在长端收益率在 9 月份上升导致金融环境收紧之后，包括鹰派与鸽派在内的决策者在 10 月中旬均暗示倾向于放弃在 11 月的会议上加息。但是巴以冲突造成地区局势紧张，可能使得能源的价格居高不下，从而加剧通胀的压力，在劳动力市场和通胀等数据显示美国经济依旧火热的情况下，美联储可能将保持高利率的环境持续一段时间，目前市场隐含利率显示美联储将在 24 年 H2 降息。

整体而言，市场在三季度在管理层出台了众多利好背景下疲弱的程度超出了预期。创业板指自 2021 年 9 月高点以来，区间最大跌幅已经达到 45%，主要指标回到了估值合理略低的区间。9 月底，市场整体情绪在华为新品的带动下有所回暖，而经济数据也呈现了转暖的趋势，预计四季度投资者参与的积极性有所提升，海外投资者资金流出影响也在逐步减弱，流动性层面也有所好转。中美之间 9 月开启了一些缓和动作，巴以冲突之后世界需要大国之间协调确保不发生更大范围的冲突，四季度对中美双方都是难得的喘息期。

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: 2023 年 3 季度)

本托管人依据东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划的合同与托管协议,自计划成立日起托管“东海证券添宁双月盈 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。

本托管人认真复核了本报告期《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划》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。

兴业银行南京分行资产托管部

2023.10.27



## 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	38,961,031.36
红利再投资份额	0.00
报告期间净申购份额	51,862,622.51
报告期末份额总额	90,823,653.87

### 二、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	1,152,562.20
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	80,351.11
期末资产净值	98,335,773.78
期末每份额净值	1.0827
期末每份额累计净值	1.0827

### 三、业绩表现

截止到2023年9月30日，本集合计划单位净值为1.0827元，累计净值1.0827元，产品的本期净值增长率为1.79%。



## 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	6,386,859.38	6.48%
私募基金投资	82423831.59	83.67%
银行存款及清算备付金合计	3,341,001.05	3.39%
其他资产	6,360,654.87	6.46%
总资产合计	98,512,346.89	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100.1796%，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 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

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

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：6,643,527.38份，占全部份额的7.31%。

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	关于新增上海利得基金销售有限公司为东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划推广代理机构的公告	2023-07-25	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。

