

---

# 东海期货龙鼎3号集合资产管理计划 2024年第二季度资产运作报告



报告期：2024年4月1日-2024年6月30日

资产管理人：东海期货有限责任公司

---

## 目录

第一节 重要提示 .....	3
第二节 管理人履职报告 .....	3
一、产品运作情况 .....	4
二、产品估值情况 .....	4
三、收益分配情况 .....	4
四、风险控制情况 .....	4
五、信息披露情况 .....	4
六、档案管理情况 .....	4
第三节 托管人履职报告 .....	4
第四节 资产管理计划投资表现 .....	5
第五节 资产管理计划投资组合报告 .....	5
一、期末资产组合情况 .....	5
二、交易费用情况 .....	6
第六节 资产管理计划投资收益分配情况 .....	6
第七节 投资经理变更、重大关联交易等重大事项 .....	6
第八节 中国证监会规定的其他事项 .....	6

## 第一节 重要提示

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。

本资产管理计划主要投资标的为债券协议逆回购。

本计划通过限定投资范围、投资比例，以及根据净值和估值表控制投资仓位等方式进行风险控制。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期由 2024 年 4 月 1 日起，至 2024 年 6 月 30 日止。

本报告中的内容由资产管理人负责解释。

## 第二节 管理人履职报告

本管理人按照《东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同》，管理东海期货龙鼎3号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）资产。

本计划投资经理：苏振军（基金从业资格编号：A20201111001385），吉林大学经济学和管理学双学士、吉林大学高级管理工商管理硕士，上海立信会计金融学院兼职教授，历任东海期货有限责任公司总经理助理、东海资本管理有限公司总经理、副董事长，具有多年投资研究管理工作经验，现于东海期货有限责任公司担任总经理助理兼资产管理部总经理，且未在其他公司兼职。苏振军先生已取得基金从业资格、期货从业资格和证券从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

孙明喆（基金从业资格编号：P1061466100001），金融专业本科，现任东海期货有限责任公司资产管理部投资经理，且未在其他公司兼职。曾就职于东海期货有限责任公司经纪业务部、铨龙（上海）投资管理有限公司，具有多年投资研究、投资管理等相关业务经验，取得基金从业资格、期货从业资格、证券从业资格。

---

格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### 一、产品运作情况

本报告期内，本管理人严格按照合同约定投资范围及投资策略管理本计划委托资产，严格遵守产品风控要求，未出现超出投资范围及比例限制、变更投资策略的情形。

本管理人按要求对本计划单独管理、单独建账、单独核算。

### 二、产品估值情况

本管理人委托华泰证券股份有限公司办理本计划产品估值，公司与华泰证券建立了对接机制，明确了双方权利义务要求。本季度，委托服务机构按照资管合同规定估值程序、估值方法计算资产管理计划净值。

### 三、收益分配情况

本报告期内，本计划未进行收益分配。

### 四、风险控制情况

本报告期内，本计划投资运作正常，未发生风险事件，未触及预警、止损线，未发现不公平交易或利益输送情形。

### 五、信息披露情况

本报告期内，本管理人按要求做好信息披露工作，每周通过网站、短信、微信公众号形式向投资者披露产品净值。按照规定通过网站向投资者披露，管理人从业人员参与本计划情况。

### 六、档案管理情况

本报告期内，本管理人已妥善保管本计划有关客户档案、记录、报表、账册和其他相关材料。

## 第三节 托管人履职报告

公司委托华泰证券股份有限公司担任本计划托管机构。托管人具有基金托管资格、具有健全的内部控制制度，公司与托管人签署了书面协议，明确了双方的

权利义务、风险承担等内容。

本季度，托管人能按要求履行托管职责，托管人具体履职报告详见附件。

#### 第四节 资产管理计划投资表现

项目	金额（单位：人民币）
期末资产净值	145,358,450.31
期末每份额净值	1.2412
期末每份额累计净值	1.2412

本报告期内，本计划产品单位净值较成立以来累计增长了24.12%，目前持仓主要包括买入返售金融资产，所持资产单个流动性均符合资产管理计划合同规定。

#### 第五节 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）	占净资产比例（%）
银行存款	39,751.20	0.0273
结算备付金	1,000.00	0.0007
存出保证金	271,734.26	0.1869
买入返售金融资产	145,347,181.97	99.9922
<b>总资产合计</b>	<b>145,659,667.43</b>	<b>100.2072</b>
应付管理人报酬	276,552.21	0.1903
应付托管费	3,841.44	0.0026
应付销售服务费	3,841.44	0.0026
应交税费	16,982.03	0.0117
<b>总负债合计</b>	<b>301,217.12</b>	<b>0.2072</b>

净资产	145,358,450.31	100.0000
-----	----------------	----------

本资产管理计划需支付管理费、托管费、运营服务费等费用，管理费费率为0.7%/年，托管费率为0.01%/年及运营服务费率为0.01%/年。管理费、托管费及运营服务费自计划成立日次日起，每日计提，按季支付。本季度产生管理费、托管费及运营服务费明细见上表，费用将于下季度进行划付。

## 二、交易费用情况

本报告期内，本计划未产生交易费用。

## 第六节 资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内，本计划没有进行收益分配。

## 第七节 投资经理变更、重大关联交易等重大事项

本报告期内，本计划没有投资经理变更、没有重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

## 第八节 中国证监会规定的其他事项

本报告期内，本计划没有需要披露的证监会规定其他事项。

东海期货有限责任公司

二〇二四年七月十九日



# 东海期货龙鼎 3 号集合资产管理计划

## 2024 年第 2 季度托管报告

### 1、报告期内本资产管理计划托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本资产管理计划托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了资产管理计划合同和各项法律法规的相关规定，履行了资产管理计划托管人应尽的义务，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

### 2、托管人对报告期内本资产管理计划投资运作遵规守信、净值计算、利润分配的说明

本报告期内，华泰证券对资产管理计划管理人的投资运作行为依资产管理计划合同约定进行了监督，对本资产管理计划资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现资产管理计划管理人存在损害本资产管理计划份额持有人利益的行为。

### 3、托管人对本季度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为资产管理计划托管人，复核了本资产管理计划 2024 年第 2 季度报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

华泰证券股份有限公司资产托管部

2024 年 07 月 19 日

资产托管业务专用章