
东海期货龙鼎3号集合资产管理计划

2023年度资产运作报告

报告期：2023年1月1日-2023年12月31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	5
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、期末持仓明细	5
三、交易费用情况	6
第六节 资产管理计划财务会计报告	6
第七节 资产管理计划投资收益分配情况	6
第八节 投资经理变更、重大关联交易等重大事项	6
第九节 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。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划说明书。

本资产管理计划投资标的为以沪深交易所或银行间市场发行及交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的债券。

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

本报告中期末资产组合情况采用的是经审计后的财务数据，其他数据均采用期末已核对的估值表数据。

本报告期由 2023 年 1 月 1 日起，至 2023 年 12 月 31 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、吉林大学高级管理人员工商管理硕士，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、铎龙（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，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。本年度，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、短信形式向投资者披露产品净值，按照合同约定期限向投资者披露资产管理计划的定期资产管理报告；本报告期内，未发生需向投资者披露的重大事项。

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。

本年度，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	172,479,123.49
期末每份额净值	1.2169
期末每份额累计净值	1.2169

本报告期内，本计划产品单位净值较成立以来累计增长了21.69%，目前持仓主要包括买入返售金融资产、交易性基金投资，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	69,260.70	0.0402
结算备付金	1,000.00	0.0006
存出保证金	7,151,581.53	4.1463
交易性基金投资	5,005,945.38	2.9023
买入返售金融资产	160,766,121.64	93.2090
总资产合计	172,993,909.25	100.2985
应付管理人报酬	463,498.36	0.2687
应付托管费	9,278.37	0.0054

应付销售服务费	9,278.37	0.0054
应交税费	32,730.66	0.0190
总负债合计	514,785.76	0.2985
净资产	172,479,123.49	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。2023年第四季度产生管理费、托管费及运营服务费明细见上表，每季度产生费用于下一季度进行划付。

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 资产管理计划财务会计报告

公司委托中兴财光华会计师事务所（特殊普通合伙）担任本计划的外部审计机构。审计机构具有执行证券、期货相关业务的资质，公司与审计机构签署了书面协议，并由审计机构根据本计划的运作情况，对相应财务会计报告出具了审计报告，详细请见附件。

第七节 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。

第八节 投资经理变更、重大关联交易等重大事项

本报告期内，本计划投资经理发生变更，公司已在官网向投资者披露了《东海期货龙鼎3号集合资产管理计划投资经理变更公告》并已报送中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。

第九节 中国证监会规定的其他事项

本报告期内，因中国证券监督管理委员会修订《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，东海期货龙鼎3号集合资产管理计划根据修订内容变更合同部分内容。变更事项事先经托管人同意后，拟定《关于东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理

合同变更的征询意见函及临时开放期设置公告》，通过管理人网站及管理人公众号于2023年3月2日发布公告，以供不同意变更的投资者退出本计划。计划截止临时开放日2023年3月10日收到4位投资者退出申请，根据公告约定，其余未提出退出申请的投资者视为同意该项变更。变更内容于2023年3月13日生效。

因业务开展需要，调整了自有资金参与及关联交易处理方式。变更事项先经托管人同意后，拟定《关于东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询意见函及临时开放期设置公告》，通过管理人网站及管理人公众号于2023年3月29日发布公告，以供不同意变更的投资者退出本计划。计划截止临时开放日未收到投资者退出申请，根据公告约定，视为全体投资者同意该项变更，变更内容于2023年4月7日生效。

本计划因业务开展需要，发生了产品降低托管费和外包费的合同变更。该项变更先经托管人同意后，拟定《东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同补充协议（一）》，并通过管理人网站及管理人公众号于2023年10月11日发布《关于东海期货龙鼎3号集合资产管理计划合同变更事项意见征询公告》。公告中明确，设立2023年11月8日为临时开放日以供不同意变更的投资者退出本计划。本计划截止临时开放日未收到投资者退出申请，1名投资者提交退出申请，182名投资者同意变更，且已与管理人、托管人签署了《东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同补充协议（一）》。变更内容于2023年11月10日生效。

东海期货有限责任公司

二〇二四年四月二十四日



东海期货龙鼎3号集合资产管理计划

2023年年度托管报告

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、托管人对本年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2023年年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04月22日

资产托管业务专用章