
东海龙鼎55号集合资产管理计划

2023年度资产运作报告

报告期：2023年6月7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	5
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	7

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 6 月 7 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《东海龙鼎55号集合资产管理计划资产管理合同》，管理东海龙鼎55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、铧龙（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

本管理人委托招商证券股份有限公司办理本计划产品估值，公司与招商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。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。本计划于2023年9月15日触发巨额退出条款，管理人于触发当日发布《关于东海龙鼎55号集合资产管理计划触发巨额退出及部分顺延退出的公告》，并已通过网

站及公众号向投资者进行披露。

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

公司委托招商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	35,672,519.01
期末每份额净值	1.0270
期末每份额累计净值	1.0270

本报告期内，本计划产品单位净值较成立以来累计增长了2.70%，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	1,867.32	0.0052
存出保证金	64,261.91	0.1801
买入返售金融资产	35,668,179.91	99.9878

总资产合计	35,734,309.14	100.1732
应付管理人报酬	51,843.87	0.1453
应付托管费	1,468.31	0.0041
应付销售服务费	1,468.31	0.0041
应交税费	7,009.64	0.0196
总负债合计	61,790.13	0.1732
净资产	35,672,519.01	100.00

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 0.02%/年及运营服务费率为 0.02%/年。管理费、托管费及运营服务费自计划成立日起，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，本计划产生交易费用 391.02 元。

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。

第九节 中国证监会规定的其他事项

本报告期内，本计划于固定开放日 2023 年 9 月 15 日触发巨额退出，管理人依据合同约定，结合资产组合状况决定采取部分顺延退出的处理方式，首次顺延比例管理人指定为 45%。管理人在后续临时开放日 2023 年 9 月 22 日对委托人未能退出部分的退出申请进行延期办理，并于 2023 年 9 月 26 日确认巨额退出情形消失。

东海期货有限责任公司

二〇二四年四月二十四日



招商证券（托管部）

东海期货有限责任公司：

2023年度，本托管人——招商证券股份有限公司在对东海龙鼎55号集合资产管理计划（下称“本计划”）的托管过程中，严格遵守相关法律法规和托管协议的有关规定，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2023年度，本计划管理人在投资运作、资产净值计算、费用开支等问题上，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

本托管人依法对资产管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特此报告。



招商证券股份有限公司托管部

2024年04月15日