

# 东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划

## 2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：东海证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事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。

集合计划托管人兴业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 4 月 21 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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划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，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                       |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 东海证券海鑫尊利                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 970082                                                                                                                                                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                |
| 基金合同生效日    | 2021 年 12 月 6 日                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 11,622,485.65 份                                                                                                                                       |
| 投资目标       | 通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。                                                                                         |
| 投资策略       | 本集合计划的主要投资策略包括：<br>1、久期配置策略；<br>2、期限结构配置策略；<br>3、类属配置策略；<br>4、个券精选策略；<br>5、信用债券投资策略；<br>6、资产支持证券投资策略；<br>7、杠杆投资策略；<br>8、银行存款、同业存单投资策略；<br>9、国债期货投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中债新综合指数（全价）收益率×80%+一年期银行定期存款收益率（税后）×20%                                                                                                               |

|        |                                                                                |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本集合计划为债券型集合资产管理计划，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。 |
| 基金管理人  | 东海证券股份有限公司                                                                     |
| 基金托管人  | 兴业银行股份有限公司                                                                     |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 111,971.39                          |
| 2. 本期利润         | 99,559.23                           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0063                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 11,598,309.42                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9979                              |

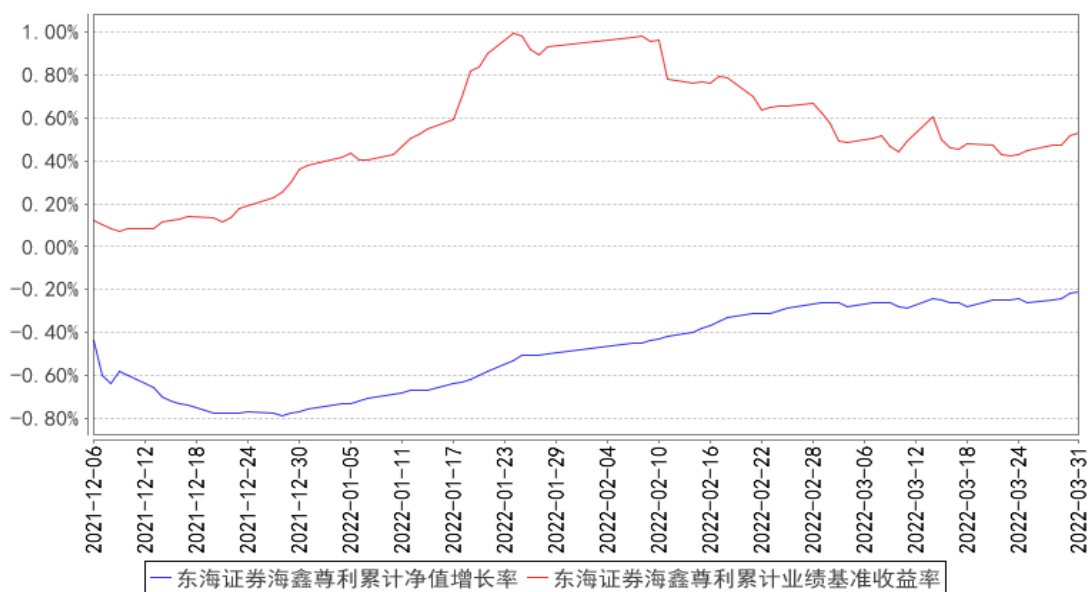
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.55%      | 0.02%         | 0.15%          | 0.05%                 | 0.40%  | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.21%     | 0.06%         | 0.53%          | 0.05%                 | -0.74% | 0.01%  |

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东海证券海鑫尊利累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：(1) 本集合计划合同生效日为 2021 年 12 月 6 日，图示日期为 2021 年 12 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日；

(2) 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本集合计划不直接买入股票，也不参与新股申购和新股增发，因所持可转换债券转股形成的股票、可交换债券换股形成的股票，本集合计划应在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### 3.3 其他指标

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                |
|-----|------|-------------|------|--------|-------------------|
|     |      | 任职日期        | 离任日期 |        |                   |
| 朱晨飞 | 本基金的 | 2019 年 1 月  | -    | 9 年    | 现任东海证券股份有限公司资产管理部 |

|  |      |      |  |  |                                        |
|--|------|------|--|--|----------------------------------------|
|  | 基金经理 | 22 日 |  |  | 基金经理；历任东海证券股份有限公司资产管理部运营经理、债券交易员、投资经理。 |
|--|------|------|--|--|----------------------------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同约定的行为，未有损害计划份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东海证券股份有限公司资产管理部公平交易实施细则》等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，债券收益率总体先下后上然后震荡。年初市场延续了 2021 年末对经济下行压力的担忧，在不及预期的 2021 年 12 月社融、社零数据以及央行公开市场操作降息等因素的带动下，债市买盘力量强劲，债券收益率不断下行，10 年国债收益率于 1 月下旬下探至 2.66 附近的低点。进入二月份，随着 2 月 10 日央行披露的 2022 年 1 月社融数据显著高于预期，对于宽信用的预期的升温带来债市转冷，后续国内多个城市放松房地产政策及俄乌战争带来的通胀预期升温等负面因素持续打压债市，收益率持续上升，10 年国债收益率回到 2.8 附近。随着 3 月中旬公布的 2 月份金融数据显著不及预期，以及国内疫情有所抬头，债市开始企稳，而 3 月 16 日国务院金融稳定发展委员会的表态“积极出台对市场有利的政策，慎重出台收缩性政策”更是提升了市场的宽松预期，同时，欧美各国通胀数据高企导致的海外主要央行紧缩预期升温对债市掣肘亦始

终存在，直至 3 月底，10 年国债收益率始终围绕 2.8 波动。

展望未来，考虑到国内部分城市的疫情仍处于高位，其对经济造成的影响仍在显现，我们认为短期内宏观环境或对债市相对友好，随着疫情逐步得到控制、国内宽信用政策的效果逐步体现以及海外通胀压力的传导，债市或将面临一定压力。

报告期内，本组合在部分债券到期兑付的情况下，在严格甄别信用风险的前提下，买入了部分短久期中高等级信用债，总体维持了较短的组合久期和适度的仓位，以获取票息收益为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额净值为 0.9979 元，本报告期计划份额净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.15%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自本集合计划合同生效日至报告期末，曾出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人和资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 11,660,368.65 | 96.84        |
|    | 其中：债券             | 11,660,368.65 | 96.84        |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 110.46        | 0.00         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 379,046.18    | 3.15         |
| 8  | 其他资产              | 1,144.33      | 0.01         |
| 9  | 合计                | 12,040,669.62 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 356,522.89    | 3.07         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 9,243,415.71  | 79.70        |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,022,730.41  | 8.82         |
| 6  | 中期票据      | 1,003,595.75  | 8.65         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 34,103.89     | 0.29         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 11,660,368.65 | 100.54       |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 143636    | 18 国联 G1      | 10,000 | 1,065,619.45 | 9.19         |
| 2  | 012103539 | 21 津城建 SCP051 | 10,000 | 1,022,730.41 | 8.82         |
| 3  | 175235    | 20 金地 01      | 10,000 | 1,018,605.48 | 8.78         |
| 4  | 175240    | 20 远东八        | 10,000 | 1,017,201.37 | 8.77         |
| 5  | 163054    | 19 兴投 01      | 10,000 | 1,016,301.37 | 8.76         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体中本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本集合计划投资的前十名股票中，没有超出集合计划合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 1,144.33 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 1,144.33 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|---------|--------------|
|----|------|------|---------|--------------|



|   |        |      |           |      |
|---|--------|------|-----------|------|
| 1 | 127005 | 中证转债 | 34,103.89 | 0.29 |
|---|--------|------|-----------|------|

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末前十名股票中未存在流通受限的股票。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因公允价值占集合计划资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 7,254,000.36  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 49,172,906.36 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 44,804,421.07 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 11,622,485.65 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |              |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 57,980.31    |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 1,804,327.32 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 156,871.30   |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 1,705,436.33 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 14.67        |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期      | 交易份额(份)      | 交易金额(元)      | 适用费率(%) |
|----|------|-----------|--------------|--------------|---------|
| 1  | 申购   | 2022-1-25 | 1,003,119.90 | 1,000,000.00 | 0.2000  |
| 2  | 申购   | 2022-2-17 | 801,207.42   | 800,000.00   | 0.2000  |
| 3  | 赎回   | 2022-3-4  | 29,215.30    | 29,133.50    | 0.0000  |
| 4  | 赎回   | 2022-3-10 | 68,645.00    | 68,452.79    | 0.0000  |

|    |    |           |              |              |        |
|----|----|-----------|--------------|--------------|--------|
| 5  | 赎回 | 2022-3-24 | 59,011.00    | 58,869.37    | 0.0000 |
| 合计 |    |           | 1,961,198.62 | 1,956,455.66 |        |

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                        | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |               |               | 报告期末持有基金情况 |          |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|------|---------------|---------------|------------|----------|
|                                                                                                                                              | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额       | 份额占比 (%) |
| 产品                                                                                                                                           | 1              | 20220126-20220207       | 0.00 | 12,563,071.67 | 12,563,071.67 | 0.00       | 0        |
| 机构                                                                                                                                           | 2              | 20220208                | 0.00 | 8,040,004.02  | 8,040,004.02  | 0.00       | 0        |
| 产品特有风险                                                                                                                                       |                |                         |      |               |               |            |          |
| 本集合计划在报告期内存在单一投资者持有集合计划份额比例达到或者超过集合计划总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，集合计划管理人可能无法以合理的价格及时变现集合计划资产，有可能对集合计划净值产生一定的影响，甚至可能引发集合计划的流动性风险。 |                |                         |      |               |               |            |          |

注：自本集合计划合同生效日至报告期初（20211206-20211231），存在单一个人投资者持有的集合计划份额比例达到或者超过集合计划总份额 20%的情形。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对照公募基金对本集合计划进行了规范改造，并在收到中国证监会准予本集合计划合同变更生效的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。改造后的集合计划合同已于 2021 年 12 月 6 日变更生效。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予东海证券“东风 2 号”集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划招募说明书》；

- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站 <http://www.longone.com.cn/>。

## 9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所免费查阅。

东海证券股份有限公司

2022 年 4 月 22 日