

# 东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 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：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 24 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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	454,225.92 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： 1、久期配置策略； 2、期限结构配置策略； 3、类属配置策略； 4、个券精选策略； 5、信用债券投资策略； 6、资产支持证券投资策略； 7、杠杆投资策略； 8、银行存款、同业存单投资策略； 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-860.13
2. 本期利润	-1,606.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0033
4. 期末基金资产净值	457,891.76
5. 期末基金份额净值	1.0081

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 本集合计划资产管理合同生效日为 2021 年 12 月 6 日（由证券公司大集合资产管理产品“东风 2 号”变更而来）。

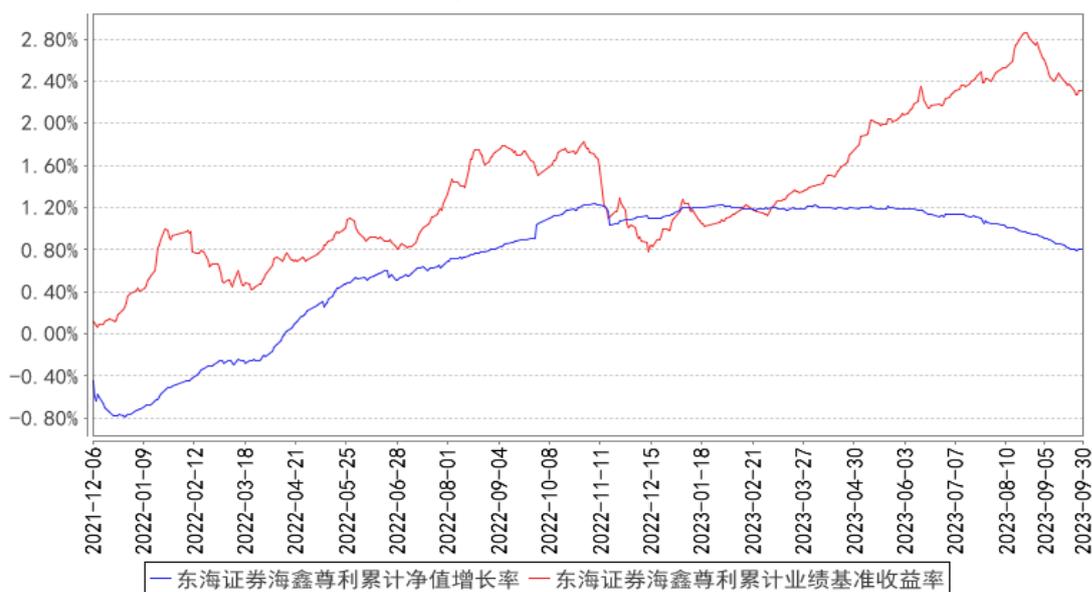
#### 3.2 基金净值表现

##### 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 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.33%	0.01%	0.08%	0.04%	-0.41%	-0.03%
过去六个月	-0.40%	0.01%	0.91%	0.03%	-1.31%	-0.02%
过去一年	-0.23%	0.01%	0.80%	0.04%	-1.03%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	0.81%	0.03%	2.32%	0.04%	-1.51%	-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 2023 年 9 月 30 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。

## §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	本集合计划的投资经理	2021 年 12 月 6 日	-	10 年	上海交通大学工商管理硕士，证券从业资格证书编号 S0630816100001，不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监

					管措施。2012 年进入东海证券，现任东海证券股份有限公司资产管理部投资经理；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。投资风格稳健，对于宏观、利率市场有很好的把握，严格控制流动性风险，注重信用研究。
--	--	--	--	--	---

注：1、本集合计划的投资经理朱晨飞自 2019 年 1 月 22 日起担任原东海证券“东风 2 号”集合资产管理计划投资经理。

2、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为资产管理合同生效日，其“离职日期”根据公司决议确定的解聘日期；

3、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

4、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

三季度利率总体处于震荡状态。进入 7 月份，尽管上旬央行发布的金融数据超市场预期，但

居民部门贷款持续性存疑，市场对此数据反应平淡，随着中旬国家统计局发布的二季度经济数据不及预期，利率迎来一轮下行，10 年期国债收益率一度跌破 2.6。7 月 24 日，中央政治局召开会议，释放了较多的积极政策信号，10 年期国债收益率迅速上行至 7 月末的 2.65 附近。由于 8 月中上旬披露的 7 月份通胀数据和金融、经济数据大幅不及预期，叠加央行对公开市场操作超预期降息，10 年期国债收益率再次快速走低，至 8 月 21 日跌破 2.55。之后，由于各类稳增长政策持续出台带来的经济企稳以及政府债发行提速造成的银行间资金面收敛，10 年期国债收益率开始持续上行，至 9 月末维持在 2.68 附近。从已经披露的 9 月份数据看，社融数据虽总量尚可但结构上较为依赖政府债券，经济自发活力略有不足，房地产优化政策对居民部门贷款的改善起到了一定作用但持续性依然存疑，CPI 数据显示居民消费能力和意愿较弱，进出口数据表明外需尚有一定韧性，经济总体仍处于低位运行，有待更多的逆周期调节政策。

报告期内，我们继续根据持仓债券的到期情况补充资产，整个组合久期保持在较低水平。

#### 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 1.0081 元，本报告期计划份额净值增长率为-0.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.08%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划曾出现连续六十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，本集合计划管理人已向中国证监会报告本集合计划的解决方案。

## §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	405,961.51	85.89
	其中：债券	405,961.51	85.89
	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	43,987.45	9.31
	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	22,627.24	4.79

8	其他资产	80.77	0.02
9	合计	472,656.97	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：本集合计划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	405,961.51	88.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	405,961.51	88.66

## 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	019663	21 国债 15	1,000	102,449.73	22.37
2	019688	22 国债 23	1,000	101,540.19	22.18
3	019694	23 国债 01	1,000	101,376.27	22.14
4	019678	22 国债 13	1,000	100,595.32	21.97

## 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	50.68
2	应收证券清算款	30.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	80.77

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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	455,725.60
报告期期间基金总申购份额	339,747.76
减：报告期期间基金总赎回份额	341,247.44
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	454,225.92

## §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	72,868.94
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	566.27
报告期期末管理人持有的本基金份额	72,302.67
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	15.92

### 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	赎回	2023-07-12	566.27	572.67	0.0000
合计			566.27	572.67	

## §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 (%)
个人	1	20230703-20230928	100363.30	0.00	0.00	100,363.30	22.10
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。							

### 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。

本集合计划管理人于 2023 年 8 月 22 日披露了《东海证券股份有限公司关于以通讯方式召开东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》，会议审议《关于持续运作东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的议案》。本次持有人会议投票表决起止时间：自 2023 年 8 月 28 日起至 2023 年 10 月 9 日 17:00，截至本报告期末，本集合计划处于持有人大会投票表决期。

## §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

2023 年 10 月 25 日