

# 东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东海美丽中国灵活配置混合
场内简称	-
交易代码	000822
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 14 日
报告期末基金份额总额	3,009,341.36 份
投资目标	本基金通过在股票、固定收益类资产、现金等资产的积极灵活配置，重点关注在建设美丽中国的主旋律下，受益经济结构转型和经济品质改善的个股，辅以衍生金融工具适度对冲系统风险，以获得中长期稳定且超越比较基准的投资回报。
投资策略	中国经济增长正处在从数量扩张向质量改善转变的过程中，中央政府提出的美丽中国概念不光重点关注生态文明建设，更是融入了经济建设、政治建设、文化建设、社会建设各方面和全过程。围绕美丽中国的概念，中国经济结构转型和经济品质的改善会在很长时期贯穿中国经济增长的主线，由此带来一系列的投资机遇，而与美丽中国相关联的行业及企业将蕴含极高的投资价值。同时，本基金通过对宏观环境和市场风险特征的分析研究，不断优化组合资产配置，控制仓位和采用衍生品套期保值等策略，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%

风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高预期收益的基金产品。
基金管理人	东海基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## § 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（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,178,692.03
2. 本期利润	25,414.78
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0077
4. 期末基金资产净值	4,786,574.93
5. 期末基金份额净值	1.5910

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

### 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	-0.50%	2.26%	-2.66%	0.60%	2.16%	1.66%
过去六个月	17.59%	1.97%	-0.49%	0.55%	18.08%	1.42%
过去一年	23.52%	1.99%	5.29%	0.61%	18.23%	1.38%
过去三年	89.40%	1.76%	28.96%	0.67%	60.44%	1.09%
过去五年	60.71%	1.52%	36.24%	0.60%	24.47%	0.92%
自基金合同 生效起至今	59.10%	1.64%	64.86%	0.76%	-5.76%	0.88%

### 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

基金份额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：本基金基金合同生效日为 2014 年 11 月 14 日。图示日期为 2014 年 11 月 14 日至 2021 年 9 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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		

李珂	本基金的 基金经理	2021 年 9 月 13 日	-	10 年	国籍：中国。产业经济学专业硕士，历任海通证券股份有限公司研究所分析师，中银国际证券股份有限公司资产管理板块研究与交易部研究员，2021 年 2 月加入东海基金，担任研发策略部总经理助理。现任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金和东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。
胡德军	本基金的 基金经理	2015 年 10 月 27 日	2021 年 9 月 13 日	11 年	国籍：中国。上海交通大学生物医学工程博士，曾任齐鲁证券有限公司研究所医药行业研究员，2013 年 6 月加入东海基金，历任公司研究开发部高级研究员、专户理财部投资经理等职。

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

（2）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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内，基金经理未兼任其他私募资产管理计划投资经理。

#### 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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金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

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策与执行、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。公司利用公平交易分析系统，对组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。本报告期内基金管理人管理的所有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总成交量 5%的交易次数为 0 次。

本报告期内，各组合投资交易未发现异常情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金采取了相对积极的投资策略，在投资方向更加聚焦碳中和和相关产业。2021 年三季度国内外商品价格大幅上升，A 股整体调整幅度较大，结构性特征显著：以钢铁、石化、煤炭为代表的黑色板块涨幅遥遥领先，同时以新能源发电为代表的公用事业板块表现优异；其他板块表现则相对平淡。本基金于三季度后半段开始更为聚焦于碳中和相关领域，展望四季度及更长时间周期，在“绿水青山”、“可持续发展”的原则指引下，实现碳达峰以及碳中和是自上而下的长期发展指引，产品将聚焦绿色产业链，深度发掘碳中和、新能源领域的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5910 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.50%，业绩比较基准收益率为-2.66%。

#### 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

### § 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	3,141,103.33	63.09
	其中：股票	3,141,103.33	63.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	1,830,085.94	36.76
8	其他资产	7,499.86	0.15
9	合计	4,978,689.13	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	363,260.00	7.59
C	制造业	1,891,848.33	39.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	733,085.00	15.32
E	建筑业	152,910.00	3.19
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,141,103.33	65.62

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603659	璞泰来	1,000	172,000.00	3.59
2	600905	三峡能源	17,000	125,290.00	2.62
3	600438	通威股份	2,300	117,162.00	2.45
4	601012	隆基股份	1,400	115,472.00	2.41
5	600577	精达股份	15,500	110,515.00	2.31
6	600900	长江电力	5,000	110,000.00	2.30
7	600111	北方稀土	2,300	101,821.00	2.13
8	688598	金博股份	289	101,430.33	2.12



9	002460	赣锋锂业	600	97,764.00	2.04
10	002812	恩捷股份	300	84,036.00	1.76

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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：本基金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：本基金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：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金投资的精达股份于 2021 年 5 月 13 日收到中国证监会安徽监管局出具的《关于对铜陵精达特种电磁线股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2021]10 号），具体内容如下：“经查，发现你公司存在以下违规行为：

铜陵精达铜材（集团）有限责任公司（下称精达集团），最近 12 个月持有上市公司股份 5%以上，且其董事长兼任上市公司董事、总经理，为上市公司的关联法人。2020 年，上市公司累计向精达集团非经营性资金拆出 44,262 万元，占 2019 年上市公司经审计净资产的 10.75%，其中，2020 年 11 月 11 日-2020 年底，发生 3,560 万元，占 2019 年上市公司经审计净资产的 0.86%；2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 12 日，上市公司累计向精达集团非经营性资金拆出 4,550 万元，占 2019 年上市公司经审计净资产的 1.1%。上述资金拆出及相关利息均已在公司 2020 年年报披露前归还。

上述关联交易应履行董事会、股东大会审批程序及临时信息披露义务，而未履行。

公司上述行为，违反了《上市公司信息披露管理办法》（2007 年 1 月 30 日，证监会令第 40 号）第四十八条，《上海证券交易所股票上市规则》相关规定。

根据《上市公司信息披露管理办法》（2007 年 1 月 30 日，证监会令第 40 号）第五十九条规定，我局决定对你公司采取出具警示函的监管措施，并根据《证券期货市场诚信监督管理暂行办法》将相关情况记入诚信档案。你公司应深刻吸取经验教训，认真学习相关法律法规，严格规范内部审批程序及信息披露行为，杜绝类似违规行为再次发生。”

公司及相关责任人收到警示函后，高度重视警示函中指出的问题，充分吸取教训，切实加强相关法律法规、规范性文件及公司内部管理制度的学习，提高规范运作意识，遵循上市公司信息披露规范要求。同时为了杜绝此类事件再次发生，公司的整改措施如下：

1、相关本金和利息虽已全部收回，未给公司造成实质性损失，但事实上形成了资金占用以及可能损害中小股东利益的风险，暴露了对子公司管理细节方面的不足，有关制度和管理措施未能切实、严格的执行。针对上述事项，公司董事会、监事会要求财务部、内审部自查并将对相关责任人进行追责，并给予相应处罚。

2、组织制定《防范股东及关联方占用资金专项制度》，严格落实各项规定的执行，防止公司股东及其他关联方资金占用情况的再次发生。同时，根据《企业内部控制基本规范》及配套指引的有关要求进一步健全内部控制制度，完善内控管理体系，规范内控运行程序，强化资金使用的管理制度。

3、完善公司内部审计部门的职能，在董事会审计委员会的领导下行使监督权，加强内部审计部门对公司内部控制制度执行情况的监督力度，提高内部审计工作的深度和广度，对相关业务部门大额资金使用进行动态跟踪，督促公司严格履行相关审批程序、促进企业规范发展。

4、公司将要求公司及子公司全体管理人员及财务人员认真学习相关法律法规和各项证券监管规则的学习，提高公司员工法律及风险意识；定期和不定期地开展证券相关法律法规的培训，强化关键管理岗位的风险控制职责；组织公司主要股东、董事、监事、高级管理人员参加证券相关法律法规、最新监管政策，强化内部控制监督，保证公司持续、稳定、健康的发展。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。对于公司后续的经营情况，我们会持续关注。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,211.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	261.76
5	应收申购款	2,026.96

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,499.86

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

#### 5.11.6 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基金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	3,856,209.90
报告期期间基金总申购份额	417,726.53
减：报告期期间基金总赎回份额	1,264,595.07
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	3,009,341.36

## § 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

注：本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 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

注：本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

东海基金管理有限责任公司

2021 年 10 月 27 日