

东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资
产管理计划
2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。集合计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 10 月 25 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管管理计划资产，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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东海海睿健行	
基金主代码	970047	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 29 日	
报告期末基金份额总额	35,919,784.52 份	
投资目标	本集合计划在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求集合计划资产的长期增值。	
投资策略	本集合计划的主要投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%	
风险收益特征	本集合计划是一只混合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、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	海睿健行 A	海睿健行 B
下属分级基金的交易代码	970046	970047
报告期末下属分级基金的份额总额	22,108,332.31 份	13,811,452.21 份

§ 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 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	海睿健行 A	海睿健行 B
1. 本期已实现收益	109,183.94	89,894.62
2. 本期利润	-2,785,942.59	-1,814,085.99
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1246	-0.1262
4. 期末基金资产净值	15,629,580.13	10,101,072.54
5. 期末基金份额净值	0.7070	0.7314

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

海睿健行 A

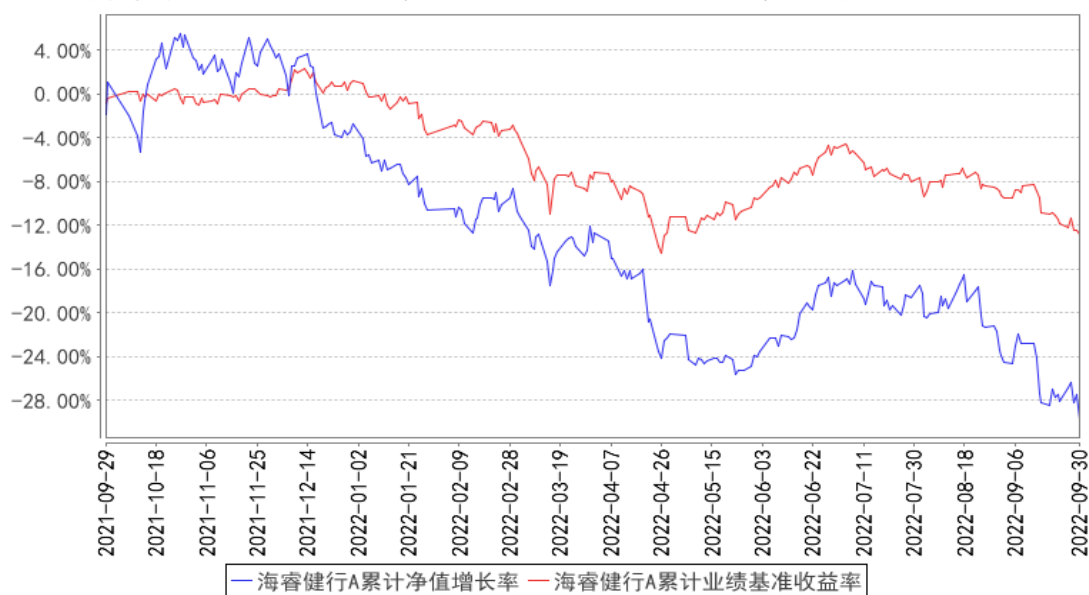
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.01%	1.38%	-8.45%	0.55%	-6.56%	0.83%
过去六个月	-18.68%	1.30%	-5.48%	0.73%	-13.20%	0.57%
过去一年	-30.41%	1.29%	-12.55%	0.71%	-17.86%	0.58%
自基金合同 生效起至今	-29.66%	1.31%	-12.83%	0.71%	-16.83%	0.60%

海睿健行 B

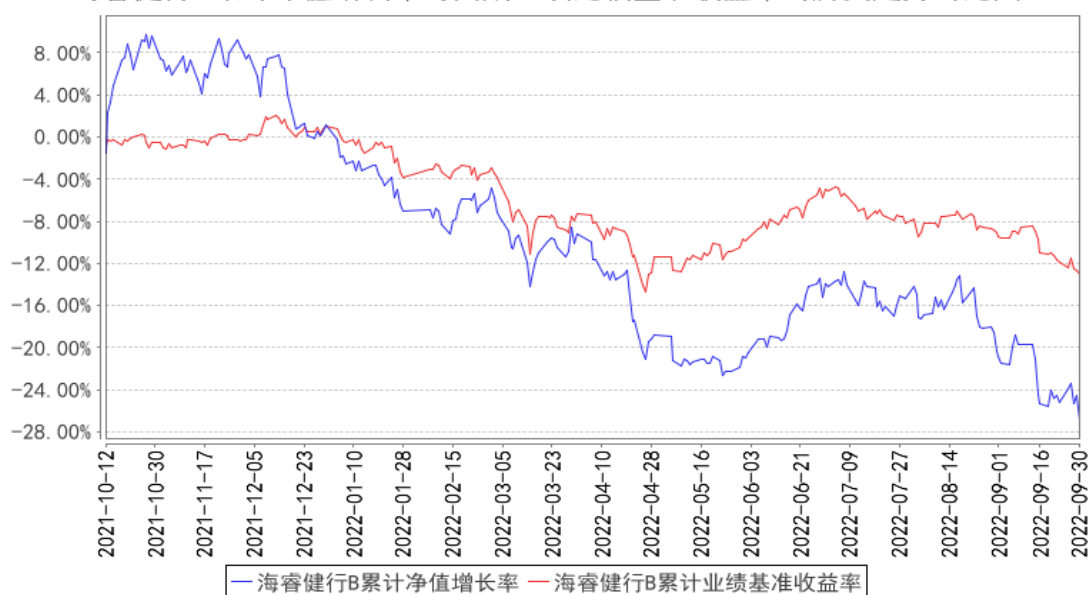
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.01%	1.38%	-8.45%	0.55%	-6.56%	0.83%
过去六个月	-18.69%	1.30%	-5.48%	0.73%	-13.21%	0.57%
自基金合同 生效起至今	-26.86%	1.28%	-13.01%	0.71%	-13.85%	0.57%

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

海睿健行A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



海睿健行B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 9 月 29 日，图示日期为 2021 年 9 月 29 日至 2022 年 9 月 30 日；

(2) 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

§ 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		
席红辉	东海证券股份有限公司资产管理部基金经理	2021年9月29日	-	10年	现任东海证券股份有限公司资产管理部执行总经理、投资经理，历任长江养老保险战略与产品研发部主管、华安基金创新业务事业部高级经理，华商基金第四投资事业部负责人兼执行投资总监、投资经理。
卓楸也	东海证券股份有限公司资产管理部基金经理	2021年10月20日	-	7年	澳洲国立大学商务硕士，证券从业资格证书编号 S0630819010003，不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。2015年进入东海证券，历任东海证券股份有限公司资产管理部助理研究员、研究员、投资经理。擅长熟悉中游制造行业的研究和投资，坚持持续价值投资的投资理念。

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

2022 年三季度，国内经济总体呈现缓慢修复态势，经济结构性分化持续。疫情后生产增速快速恢复，需求增速则修复较慢，基建增速再创新高，出口增速开始下行，地产维持负增长，大宗带动 PPI 加速回落但 CPI 保持平稳震荡。从具体宏观经济数据来看，稳增长政策的持续发力和较强的外需，共同构成了经济恢复的主要动力。投资端，基建投资托底经济，房地产投资持续下行；1-8 月全国固定资产投资（不含农户）同比增长 5.8%；8 月份环比增长 0.4%。分领域看，1-8 月份基础设施投资同比增长 8.3%，制造业投资增长 10.0%，房地产开发投资下降 7.4%。消费端受疫情影响，线上需求修复好于线下；1-8 月社会消费品零售总额同比增长 0.5%，全国网上零售额增长 3.7%，实物商品网上零售额增长 5.8%。出口数据增速中枢受海外需求回落开始下行，但仍有韧性；1-8 月我国出口总值同比增长 13.5%，8 月同比增长 7.1%。

海外依旧处于地缘冲突、能源短缺、高通胀背景下紧缩的乱局之中。进入 9 月末，俄乌战争有再度恶化迹象，此举或进一步加剧欧洲的能源及经济衰退；美国经济韧性较强，但在高通胀背景下，美联储今年已累计加息 5 次，幅度达 300 个基点，其工业数据和信贷数据都面临巨大压力。

从市场表现来看，A 股整体呈现出震荡下跌的趋势。三季度，上证指数、沪深 300、创业板指数分别下跌了 11.01%、15.16%、18.56%；分行业来看，三季度 31 个申万一级行业中仅煤炭行业微涨，而二季度反弹急先锋汽车和电力设备板块在三季度表现垫底。具体而言，三季度煤炭、综合和公用事业三个行业表现最好，涨幅分别为 0.97%、-1.12%和-4.54%；电子、电力设备和建筑材料三个行业表现最差，跌幅分别为 17.58%、18.01%和 23.98%。

展望四季度，我们认为海外主要国家经济体仍然面临下行压力，高通胀难以短期缓解，货币政策预计依然处于继续收紧状态。与此同时，海外经济的进一步下行将拖累我国的出口，而国内的疫情依然会对内需消费产生一定压制，靠基建投资托底维持增速的状态很难在今年内发生改观，经济结构性分化将延续。在这种弱经济的全球大背景下，有独立逻辑的产业更具增长潜力。从产业升级的角度来看，随着全球传统能源的紧缺和低碳理念逐渐深入人心，能源结构持续向新能源转型，新能源发电和新能源汽车的渗透率在逐渐提升，新能源的生产、存储、使用等环节的行业增长空间仍然较大。中国作为全球的制造业中心，在新能源产业链上已经涌现了越来越多具备长期优质成长潜力的公司，这些公司的竞争力日益加强，市占率还在持续提升，未来几年有望实现较快的复合增速。因此，本产品在三季度进一步提升了锂电、光伏、风电等板块的仓位，未

来也将继续重点配置新能源相关板块，同时关注其他有独立成长性的高端制造领域。具体操作上，我们将保持适当灵活性，在个股的选择方面侧重中长期拥有高成长性且估值相对合理的标的。

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睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划 A 份额净值为 0.7070 元，B 份额净值为 0.7314 元，本报告期计划 A、B 份额净值增长率均为-15.01%，同期业绩比较基准收益率为-8.45%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，曾出现连续六十个工作日计划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	21,256,291.48	81.55
	其中：股票	21,256,291.48	81.55
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	-1,547.04	-0.01
	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	3,003,191.81	11.52
8	其他资产	1,807,215.80	6.93
9	合计	26,065,152.05	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	-	-
C	制造业	21,256,291.48	82.61

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		-	-
E	建筑业		-	-
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		21,256,291.48	82.61

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	300750	宁德时代	3,700	1,483,293.00	5.76
2	300014	亿纬锂能	13,100	1,108,260.00	4.31
3	688223	晶科能源	57,258	954,490.86	3.71
4	300274	阳光电源	7,900	873,898.00	3.40
5	688599	天合光能	13,127	841,571.97	3.27
6	002508	老板电器	36,100	827,773.00	3.22
7	002459	晶澳科技	12,500	800,500.00	3.11
8	601012	隆基绿能	16,440	787,640.40	3.06
9	688559	海目星	10,647	775,421.01	3.01
10	600519	贵州茅台	400	749,000.00	2.91

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划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：本集合计划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：本集合计划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

注：本集合计划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

注：本集合计划投资范围不包含国债期货。

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：本集合计划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

本集合计划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

海目星：

因信息披露、财务会计和开立募集资金账户问题，公司及高管赵盛宇、钱智龙、高菁被中国证券监督管理委员会深圳监管局于 20211228 日依据相关法规给予出具警示函处分决定。

对上述证券的投资决策程序的说明：本集合计划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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,524.63
2	应收证券清算款	1,782,691.17
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	1,807,215.80

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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

项目	海睿健行 A	海睿健行 B
报告期期初基金份额总额	22,496,548.06	15,590,658.27
报告期期间基金总申购份额	-	9,770.58
减：报告期期间基金总赎回份额	388,215.75	1,788,976.64
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	22,108,332.31	13,811,452.21

§ 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

项目	海睿健行 A	海睿健行 B
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	1,492,247.48
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	394,500.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	1,097,747.48
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	3.06

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	2022-7-26	10,500.00	8,783.21	0.0000
2	赎回	2022-7-27	5,000.00	4,223.77	0.0000
3	赎回	2022-8-3	379,000.00	312,620.04	0.0000
合计			394,500.00	325,627.02	

§ 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集合计划份额比例达到或者超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划设立的文件；
- 2、《东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 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 10 月 26 日