

东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资
产管理计划
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：东海证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 7 月 18 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海海睿致远
基金主代码	970048
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 19 日
报告期末基金份额总额	41,117,894.78 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	本集合计划采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率× 80%+中国债券总指数收益率× 20%
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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	241,578.90

2. 本期利润	-1,368,913.12
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0327
4. 期末基金资产净值	26,096,825.97
5. 期末基金份额净值	0.6347

注：（1）所述集合计划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）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。

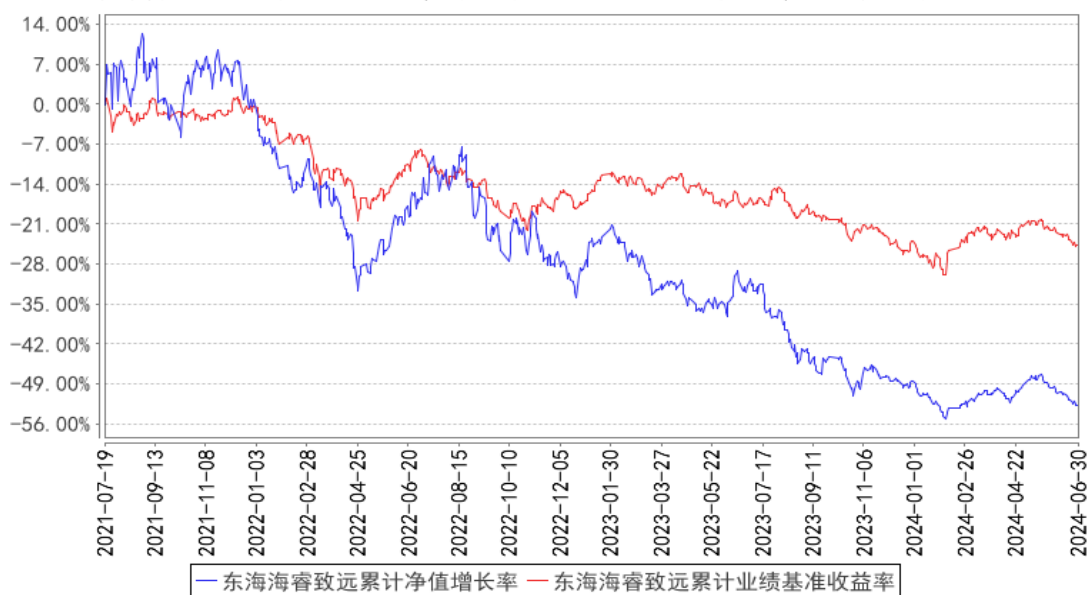
3.2 基金净值表现

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	-4.99%	0.79%	-2.40%	0.66%	-2.59%	0.13%
过去六个月	-7.99%	0.83%	-0.87%	0.82%	-7.12%	0.01%
过去一年	-30.72%	1.15%	-8.99%	0.74%	-21.73%	0.41%
自基金合同 生效起至今	-52.67%	1.62%	-24.70%	0.83%	-27.97%	0.79%

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

东海海睿致远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 7 月 19 日，图示日期为 2021 年 7 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日；

（2）本集合计划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集合计划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集合计划投资其他品种，集合计划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		
刘迟到	本基金的基金经理	2023 年 11 月 16 日	-	15 年	硕士研究生，2008 年 4 月-2018 年 3 月曾任天相投顾、浙商证券、申万宏源研究所家电行业分析师、2018 年 4 月-2022 年 3 月任海外大型 QFII 研究员和

					投资经理, 长期深耕于消费品领域投资和 研究, 集中和逆向投资相结合, 与公司长 期发展共同成长。
--	--	--	--	--	---

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

2024 年 6 月 30 日上证指数报收于 2967.4 点, 第二季度下跌 2.43%, 沪深 300 指数下跌 2.14%, 万得全 A 下跌 5.32%, 万得微盘、中证 2000 分别下跌 12.27% 和 13.75%, 本季度仅红利指数收红, 上涨 1.06%。按照申万 31 个行业指数划分银行、公用事业和电子板块涨幅前三, 分别上涨 5.81%、5.24% 和 1.55%, 其他红利板块如煤炭、交通运输和家用电器板块涨幅紧随其后, 跌幅前三的板块分别为综合、传媒和商贸零售, 分别下跌 25.66%、20.15% 和 19.26%, 社会服务、计算机、轻工制造、食品饮料和纺织服装等消费和 TMT 板块跌幅相对较大。

从目前公布的宏观经济指标来看, 第二季度国家经济形势不容乐观: 国家统计局公布的 5、6 月采购经理人指数均为 49.5, 连续两个月位于荣枯线以下, 今年上半年仅 3、4 月份该指数超过 50; 规模以上工业企业收入 5 月份累计同比增长 2.9%, 平均用工人数量累计同比下降 1.6%; 4、5 月社会消费品零售总额分别为 3.57 万亿、3.92 万亿, 同比仅增长 2.3% 和 3.7%。从中观和

微观层面的信息来看，今年 618 期间综合电商平台、直播平台累计销售额为 7428 亿元，其中综合电商平台销售总额达到 5717 亿元，同比下降 6.9%，8 年来第一次下滑，而消费板块白酒龙头飞天茅台散货的价格端午节前后跌破 2200 元/瓶，消费需求的持续疲软导致 5 月份后消费相关的板块调整幅度较大。从外部环境来看，经济上，美国 6 月 ISM 非制造业 PMI 为 2020 年 5 月以来新低，不及市场预期，降息预期升温，政治上，今年为美国大选年，对中国实行强硬政策已成为两党共识，中美经济政治之间的博弈加剧，由于上半年美元持续走强，人民币兑美元汇率跌破 7.3 元人民币/美元，截止 7 月 5 日，北上资金净流入合计为 246.31 亿元，其中沪股通净流入 697 亿元，深股通净流出 451 亿元。

1-5 月份我国商品房销售面积累计同比下降 20.3%，第二季度销售相对于第一季度更加萎靡，房地产板块相关产业链占中国 GDP 比重超过 25%，而同时房价的持续下跌，财富效应的负反馈等原因导致内需受挫。红利板块的持续受追捧，主要原因是在房地产销售以及价格、内需持续萎缩的情况下对确定性的过度追求，而目前部分红利板块公司的股息率已经跌破 3% 以下。

本季度，操作上小幅减持了部分涨幅相对较高的零食、新能源板块的公司，加仓了农业、医药板块的公司。展望第三季度，需要关注的以下几点：虽然市场已经对二季度大部分公司的业绩进行了向下修正，但是仍存在业绩不达预期的可能性；二十届三中全会即将召开，虽然市场对大幅刺激政策的预期较低，不排除个别领域存在超预期的可能性；目前整体 A 股相对于 10 年期国债的收益率风险溢价已经处于有吸引力的位置，权益市场的配置价值将逐步体现。

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致远灵活配置混合型集合资产管理计划份额净值为 0.6347 元，本报告期计划份额净值增长率为-4.99%，同期业绩比较基准收益率为-2.40%。

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，未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人的情形。

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，本集合计划管理人已将解决方案上报中国证券监督管理委员会。

§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	17,428,472.56	66.61

	其中：股票	17,428,472.56	66.61
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	3,939,768.90	15.06
	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	4,792,529.96	18.32
8	其他资产	5,833.31	0.02
9	合计	26,166,604.73	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	1,547,942.00	5.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,240,696.56	46.90
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	2,173,878.00	8.33
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	278,700.00	1.07
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	1,187,256.00	4.55
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,428,472.56	66.78

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

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	300783	三只松鼠	99,400	2,173,878.00	8.33
2	002179	中航光电	54,000	2,054,700.00	7.87
3	603998	方盛制药	175,800	1,805,466.00	6.92
4	300760	迈瑞医疗	5,500	1,600,005.00	6.13
5	300498	温氏股份	78,100	1,547,942.00	5.93
6	002557	洽洽食品	51,600	1,454,604.00	5.57
7	002582	好想你	253,800	1,362,906.00	5.22
8	000568	泸州老窖	8,800	1,262,712.00	4.84
9	301267	华夏眼科	57,300	1,187,256.00	4.55
10	603566	普莱柯	69,300	941,094.00	3.61

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

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

华夏眼科（301267）：2023 年 12 月 6 日收到通知，公司实际控制人、董事长苏庆灿先生因个人原因被上海市监察委员会实施留置。

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	4,734.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,098.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,833.31

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

报告期期初基金份额总额	42,460,768.61
报告期期间基金总申购份额	129,861.89
减：报告期期间基金总赎回份额	1,472,735.72
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	41,117,894.78

§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，本集合计划管理人未持有本集合计划份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内集合计划管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本集合计划份额。

§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 7 月 19 日变更生效。

本集合计划管理人于 2024 年 4 月 17 日披露了《关于东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划份额持有人大会会议情况的公告》，根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具有效表决意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额未达到在权益登记日集

合计划份额总数的二分之一，未达到法定的持有人会议召开条件。本次大会召集人东海证券股份有限公司已就本次会议情况报中国证券监督管理委员会备案。

§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致远灵活配置混合型集合资产管理计划设立的文件
- 2、东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划产品资料概要；
- 3、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照
- 8、报告期内披露的各项公告
- 9、法律法规及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

2024 年 7 月 19 日