

东海证券海盈 3 个月持有期混合型集合资  
产管理计划  
2024 年第 3 季度报告

2024 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024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2024年7月1日起至9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	东海证券海盈3个月持有期
基金主代码	970080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月3日
报告期末基金份额总额	982,724.04份
投资目标	本集合计划在严格控制风险的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划的主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略，包括普通债券投资策略、信用债券投资策略、可转换债券投资策略、可交换债券投资策略、债券回购杠杆策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票投资策略；5、新股申购策略；6、期货投资策略。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15% -
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，理论上其预期收益与预期风险高于货币市场基金、债券型基金和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	交通银行股份有限公司

## §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7月1日-2024年9月30日）
1. 本期已实现收益	3,267.98
2. 本期利润	9,446.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0096
4. 期末基金资产净值	932,108.50
5. 期末基金份额净值	0.9485

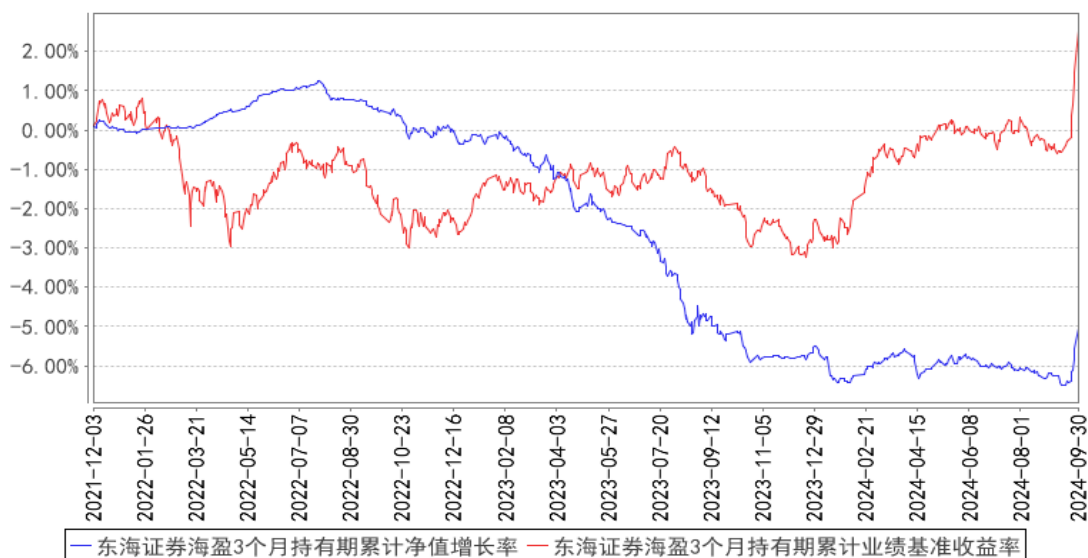
### 3.2 基金净值表现

#### 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	1.02%	0.10%	2.59%	0.20%	-1.57%	-0.10%
过去六个月	0.62%	0.09%	3.20%	0.16%	-2.58%	-0.07%
过去一年	0.14%	0.08%	4.52%	0.15%	-4.38%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	-5.07%	0.08%	2.52%	0.16%	-7.59%	-0.08%

#### 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

东海证券海盈3个月持有期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



## §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		
潘一菲	本基金的基金经理	2021年12月3日	-	8年	复旦大学经济学学士、经济学硕士，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM），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交易员、投资助理。擅长宏观经济分析，注重把控信用风险，投资风格稳健。

#### 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：期末未存在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。

### 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，未发现本集合计划存在异常交易的情况。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度资金面总体宽松，并伴随多轮次降息及降准。7月MLF利率从2.5%下调至2.3%，OMO

7D利率从1.8%调降至1.7%，银行存款利率也开启新一轮下调。9月OMO 14D逆回购两次下调利率共计30bp至1.65%，MLF利率下行30bp至2.0%，7D逆回购利率下行20bp至1.5%，下调常备借贷便利20bp，央行降准0.5个百分点，预计释放长期流动性约1万亿元。

债券市场三季度经历了一定波动。7月初央行宣布将通过借券方式进行收益率曲线控制，8月初央行通过借券卖出、监管调查等方式引导长端利率上行，长债和超长债单日出现较大幅度的上行，中短端利率也跟随明显调整，同时受到监管加强影响，8月中下旬债券交易明显清淡，债券市场活跃度有所下降，信用债与利率债走势出现分化。9月以来，信用债市场呈现结构性修复，中高等级品种修复情况较好，中低等级短期限品种有弱修复，长期品种利差仍在走高。国庆假期前，收到一系列旨在提振经济的政策组合拳影响，市场风险偏好迅速回升，债券市场出现较大调整，收益率快速上行，信用利差走阔。

权益市场出现V型反转。上证指数跌破3000点后持续下跌，9月18日最低跌至2700点下方。9月24日，国新办就金融支持经济高质量发展有关情况举行新闻发布会，除宣布降息、降准的决定性利好政策外，还新推出了针对证券公司和公募基金的互换便利工具，以及对上市公司增设股票回购、增持专项再贷款。9月26日中央政治局会议提出一系列针对性的经济政策，包括财政政策、房地产政策、资本市场政策等。受超预期的政策利好推动，最后一周快速反弹，9月30日收于3300点上方，三季度上证指数/沪深300/创业板指分别上涨12%/16%/29%。从行业看，申万一级行业指数各行业均录得正收益，非银金融、房地产、综合等直接受益于政策利好的行业表现突出，分别上涨42%/33%/31%。

9月美联储公布议息会议决议，降息50bp，受此影响，人民币汇率压力减轻，国内货币政策进一步宽松的政策打开。央行表态“坚持支持性的货币政策立场，加大调控力度，着手推出一些增量政策举措”，四季度宽货币政策可期。高频数据显示国内宏观经济仍然偏弱，需关注增量财政政策的落地力度及对基本面是否起到扭转作用。短期内，债券预计在区间偏上方运行，中期维度看，政策利率下行和经济修复斜率对债市仍然友好，债券市场调整后配置价值显现。权益市场信心恢复，在市场短期快速拉升后，有业绩支撑的板块和个股更具有持续性。

报告期内，本产品债券方面主要投资于流动性较好的短期限利率债，股票保持较低仓位，增配了部分消费板块个股。

#### 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盈3个月持有期混合型集合资产管理计划份额净值为0.9485元，

本报告期计划份额净值增长率为1.02%，同期业绩比较基准收益率为2.59%。

#### 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	66,643.00	6.84
	其中：股票	66,643.00	6.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,707.26	41.74
	其中：债券	406,707.26	41.74
	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	299,821.36	30.77
	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	200,933.30	20.62
8	其他资产	228.36	0.02
9	合计	974,333.28	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	35,007.00	3.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,040.00	2.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,596.00	0.81
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	66,643.00	7.15

### 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	600900	长江电力	800	24,040.00	2.58
2	000858	五粮液	100	16,251.00	1.74
3	002582	好想你	1,600	10,048.00	1.08
4	002179	中航光电	200	8,708.00	0.93
5	300783	三只松鼠	300	7,596.00	0.81

### 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	406,707.26	43.63
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	406,707.26	43.63

### 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	019727	23 国债 24	2,000	204,417.53	21.93
2	019733	24 国债 02	1,000	101,507.10	10.89
3	019740	24 国债 09	1,000	100,782.63	10.81

## 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

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

### 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

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。

### 5.11.2 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	24.20
2	应收证券清算款	204.16
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	228.36

#### 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	981,562.54
报告期期间基金总申购份额	1,278.60
减：报告期期间基金总赎回份额	117.10
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	982,724.04

### §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、买卖本基金份额。

### §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

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	20240701-20240930	618,392.92	0	0	618,392.92	63.00
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 03 日变更生效。

2024 年 8 月 26 日，本集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，计划托管人交通银行股份有限公司授权代表的监督下，本集合计划管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。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《关于准予东海证券东风 9 号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函（2021）2931 号）；
- 2、东海证券海盈 3 个月持有期混合型集合资产管理计划产品资料概要；
- 3、《东海证券海盈 3 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 4、《东海证券海盈 3 个月持有期混合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、报告期内在规定媒介上披露的各项公告
- 8、法律法规及中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

本集合计划管理人的办公场所（地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 7 楼）。

## 9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人的网站（<http://www.longone.com.cn>）查询，或在营业时间内至集合计划管理人办公场所免费查阅。

东海证券股份有限公司

2024 年 10 月 25 日