

东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资
产管理计划
2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 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 2021 年 10 月 20 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 2021 年 7 月 01 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东海海睿进取
基金主代码	970033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 7 日
报告期末基金份额总额	218,802,450.63 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×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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	海睿进取 A	海睿进取 B
下属分级基金的交易代码	970032	970033
报告期末下属分级基金的份额总额	45,228,990.64 份	173,573,459.99 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（2021年7月1日-2021年9月30日）	
	海睿进取 A	海睿进取 B
1. 本期已实现收益	774,458.38	2,029,150.17
2. 本期利润	-1,986,969.33	-4,386,144.23
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0410	-0.0178
4. 期末基金资产净值	48,663,995.29	163,912,496.39
5. 期末基金份额净值	1.0759	0.9443

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

海睿进取 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	-4.06%	1.35%	-3.20%	0.88%	-0.86%	0.47%
自基金合同生效起至今	-6.20%	1.25%	-3.56%	0.83%	-2.64%	0.42%

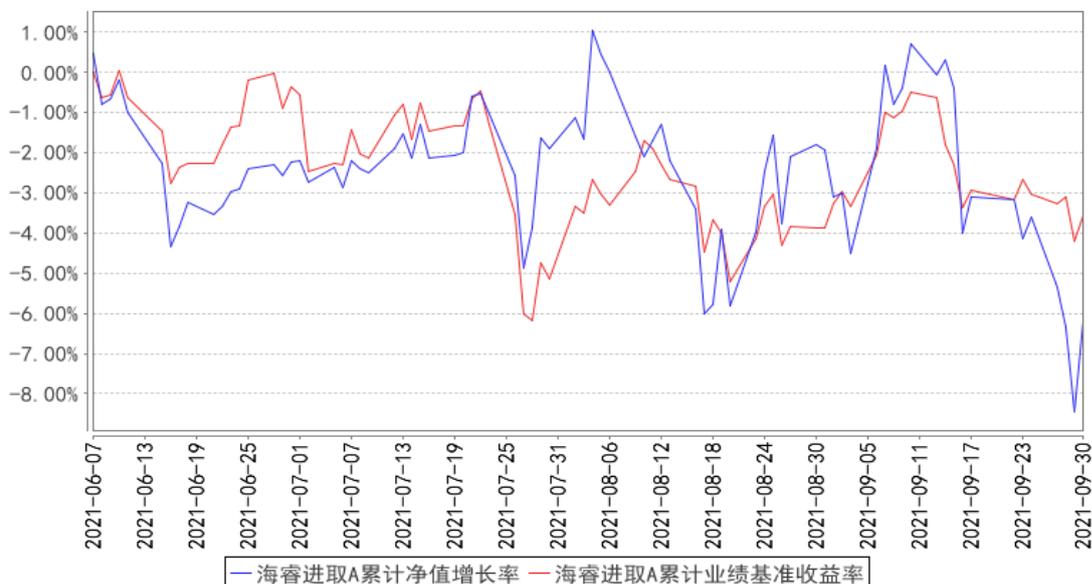
海睿进取 B

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	-4.05%	1.35%	-3.20%	0.88%	-0.85%	0.47%
自基金合同生效起至今	-5.57%	1.27%	-3.01%	0.85%	-2.56%	0.42%

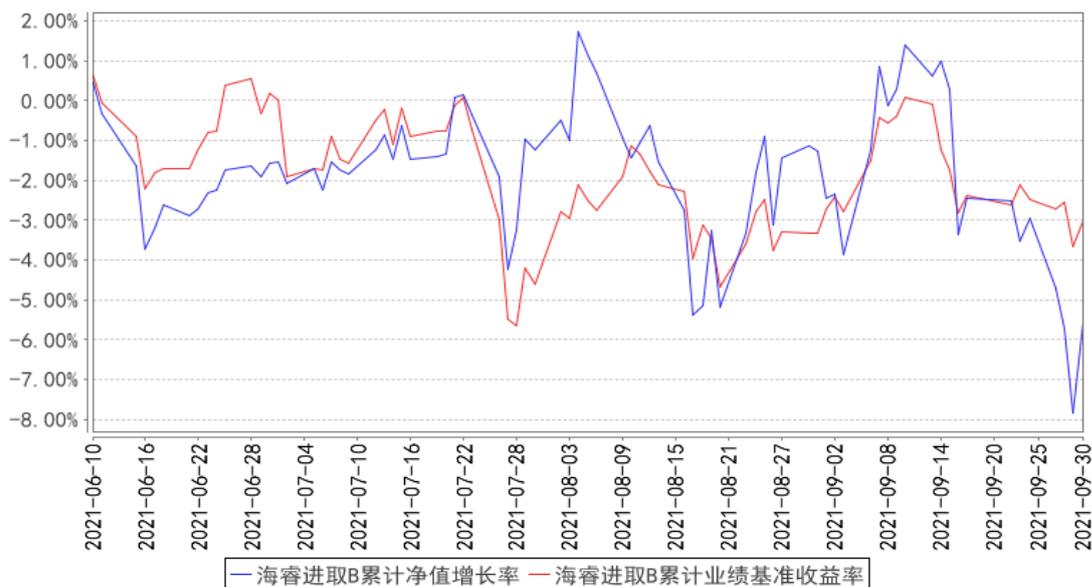
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

海睿进取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



海睿进取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



3.3 其他指标

§ 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		
刘俊	东海证券股份有限公司资产	2021年6月7日	-	15	现任东海证券资产管理部投资经理、基金投资团队负责人。历任东海证券研究所高级研究员，资产管理部投资助理、投资经

管理部投资经理				理、权益投资部负责人。
---------	--	--	--	-------------

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
-	公募基金	1	212,576,491.68	2021年6月7日
	私募资产管理计划	1	24,141,617.21	2019年10月28日
	其他组合	-	-	-
	合计	2	236,718,108.89	-

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

本报告期内，产品完成了建仓。2021 年三季度，随着流动性的持续改善，结构行情进一步演绎极致，新能源车、储能、光伏、半导体等硬科技板块持续拉升。但随着上游周期品集体走强，消费、医药持续调整，前期强势的强势板块也出现了分化。季末随着“限产限电”政策的发酵，叠加投资者对美联储政策偏鹰预期的增强，市场出现了大幅调整。本产品主要布局在消费医药白马以及新能源科技等成长行业，受到季末市场大幅调整的影响，产品净值也出现了调整。

展望 2021 年四季度，国内，疫情扰动缓解和财政货币政策微调积累下，以及“双限”政策的纠偏，预计国内经济运行在三季度见底后将逐月修复；四季度投资者将重新审视细分领域的景气程度，评估明年行业的景气程度，市场对成长和价值的增速预期将收敛。政策误读和信用风险对市场压制的高峰已过，随着舆情规范和风险有序释放，市场风险偏好也有望在第四季度探底回升。海外，美联储年底前 Taper 已经是市场的一致预期，对市场的影响已经一定程度的 price in，海外风险已逐步释放。

配置方面，我们将在成长制造和价值消费间保持均衡，且重心逐步向后者转移。

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进取灵活配置混合型集合资产管理计划 A 份额净值为 1.0759 元，本报告期计划份额净值增长率为-4.06%，同期业绩比较基准收益率为-3.20%；截至本报告期末东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划 B 份额净值为 0.9443 元，本报告期计划份额净值增长率为-4.05%，同期业绩比较基准收益率为-3.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划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或者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	162,828,581.68	76.35
	其中：股票	162,828,581.68	76.35
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	39,330,526.22	18.44
8	其他资产	11,116,565.45	5.21
9	合计	213,275,673.35	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	8,667,489.00	4.08
C	制造业	130,754,068.68	61.51
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	5,966,976.00	2.81
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	17,440,048.00	8.20
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	162,828,581.68	76.60

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	002675	东诚药业	781,823	11,305,160.58	5.32
2	300274	阳光电源	73,700	10,935,606.00	5.14
3	603259	药明康德	71,280	10,891,584.00	5.12
4	000661	长春高新	37,100	10,189,886.00	4.79
5	002466	天齐锂业	93,300	9,477,414.00	4.46
6	002371	北方华创	23,900	8,739,991.00	4.11
7	000301	东方盛虹	285,600	8,031,072.00	3.78

8	600587	新华医疗	293,000	7,785,010.00	3.66
9	300759	康龙化成	30,400	6,548,464.00	3.08
10	600519	贵州茅台	3,500	6,405,000.00	3.01

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

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

-

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

-本报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

-本报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	133,380.89
2	应收证券清算款	10,879,886.90
3	应收股利	-
4	应收利息	5,482.76
5	应收申购款	97,814.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,116,565.45

注：本集合计划本报告期末未持有其他资产。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

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：本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海睿进取 A	海睿进取 B
报告期期初基金份额总额	51,164,927.39	183,679,648.30
报告期期间基金总申购份额	-	170,261,432.87
减：报告期期间基金总赎回份额	5,935,936.75	180,367,621.18
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	45,228,990.64	173,573,459.99

§ 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	海睿进取 A	海睿进取 B
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	10,185,392.69
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	10,185,392.69
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	5.57

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，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，本基金管理人持有本基金份额为 10,185,392.69 份。

§ 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 6 月 07 日变更生效。

§ 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风 5 号集合资产管理计划合同变更的回函（机构部函（2021）957 号）；
- 2、东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划产品资料概要；
- 3、《东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

- 4、《东海证券海睿进取灵活配置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

2021 年 10 月 27 日