

东海证券海睿致远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：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 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。

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 19 日起至 9 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	41,538,579.61 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	4,741,575.47
2. 本期利润	1,540,414.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0388
4. 期末基金资产净值	55,574,336.48
5. 期末基金份额净值	1.3379

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。

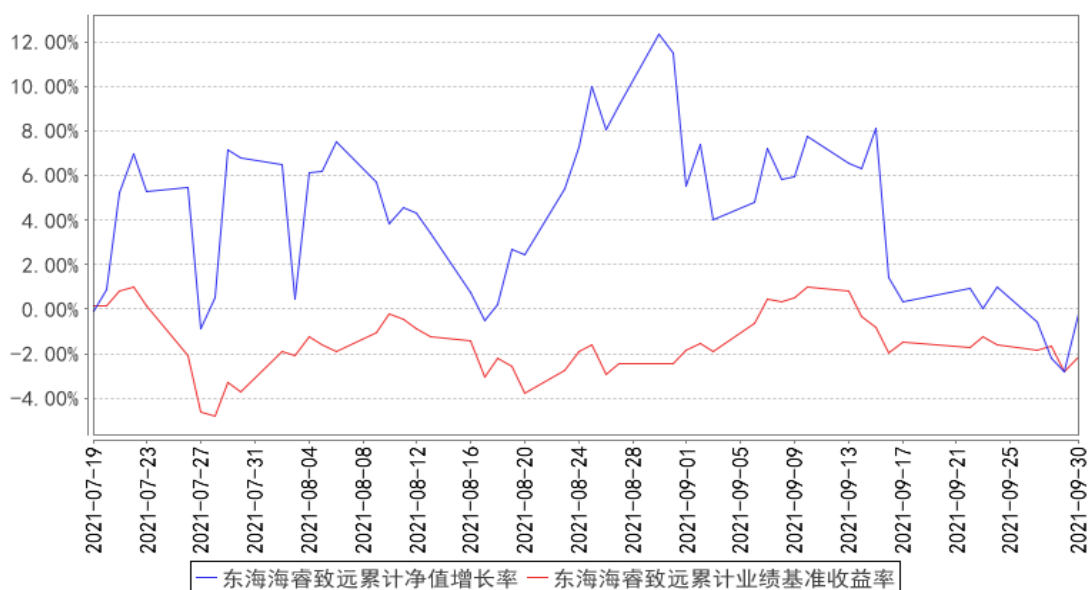
3.2 基金净值表现

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
自基金合同 生效起至今	-0.23%	2.56%	-2.13%	0.89%	1.90%	1.67%

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 2021 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。

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		
郑军	东海证券股份有限公司资产	2021年7月19日	-	14年	现任东海证券资产管理部基金投资部总监、投资经理；历任中国交建集团职员、中信建投证券8年行业研究员及新三板

	管理部基金经理				首席研究员、中信建投证券资本市场部高级副总裁、华商基金投资经理。
席红辉	东海证券股份有限公司资产管理部基金经理	2021 年 7 月 19 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。

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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本集合计划合同，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，为本集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害本集合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

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，投资经理严格遵守公平、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

随着美国应对疫情的经济刺激政策在 2021 年 6 至 7 月陆续退出、全球疫情的再次蔓延，美、欧的经济复苏势头受阻，同时全球主要经济体的 PPI 和/或 CPI 却一路走高，以及美联储 Taper 与加息预期，对 A 股形成了较大的外部压力；同时国内疫情零星复发、消费复苏疲软、基建与地产投资不振，国内经济的下行压力加大，而 9 月开始蔓延的能效双控、大范围拉闸限电更是进一步加剧了该担忧情绪；不过 7 月 15 日央行的全面降准 0.5 个百分点，对国内流动性边际改善甚至宽松周期启动的预期有所升温；总之，市场在上述多重因素影响下宽幅波动、震荡下行，2021 年三季度上证指数、深圳成指、沪深 300、创业板指数涨跌幅分别为-0.64%、-5.62%、-6.85%、-6.69%。此外，9 月对投资风格偏移基金、量化投资机构的监管也进一步强化，市场结构上也出现了剧烈调整，总体来看成长、周期等板块涨势强劲，其中受益于碳减排与碳中和、疫情导致供需错配的煤炭、有色、钢铁、石油石化等板块大幅上涨，另外电力设备与新能源、机械、国防军工等成长板块表现较好，而消费者服务、医药、食品饮料、家电、纺织服装等大消费板块领跌。

截至 2021 年 9 月 30 日，本产品净值为 1.3379，本报告期下跌 0.23%，跑赢了主要指数及业绩比较基准，主要原因我们维持了中性偏积极的权益仓位配置，并且前瞻性的重仓创新成长、阶段性减仓医药大消费，投资重点聚焦于新能源汽车/光伏风电/高端制造等创新成长板块，以及配置了部分估值低位的有色、化工、建材等周期板块龙头。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东海海睿致远集合计划份额净值为 1.3379 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.13%。同期业绩比较基准收益率为-2.13%。

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，本集合计划未有连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况出现。本集合计划资产净值于本报告期内未低于 5000 万元以下。本集合计划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集合计划进行监控和操作。

§ 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	44,472,809.05	79.75
	其中：股票	44,472,809.05	79.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	228,148.24	0.41
	其中：债券	228,148.24	0.41
	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	10,787,829.92	19.35
8	其他资产	275,625.68	0.49
9	合计	55,764,412.89	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	1,175,196.00	2.11
C	制造业	38,632,961.05	69.52
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	3,467,532.00	6.24
K	房地产业	1,197,120.00	2.15
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	44,472,809.05	80.02

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	688599	天合光能	71,726	3,841,644.56	6.91
2	688390	固德威	9,070	3,614,848.50	6.50
3	601995	中金公司	60,600	3,467,532.00	6.24
4	300274	阳光电源	23,000	3,412,740.00	6.14
5	002460	赣锋锂业	19,550	3,185,477.00	5.73
6	002466	天齐锂业	29,400	2,986,452.00	5.37
7	688005	容百科技	26,318	2,844,449.44	5.12
8	300763	锦浪科技	8,150	1,972,300.00	3.55
9	601877	正泰电器	30,500	1,726,300.00	3.11
10	002459	晶澳科技	25,500	1,681,725.00	3.03

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	-	-
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）	228,148.24	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	228,148.24	0.41

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	118002	天合转债	1,610	225,480.50	0.41
2	123115	捷捷转债	10	1,360.24	0.00
3	110081	闻泰转债	10	1,307.50	0.00

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

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	39,528.00
2	应收证券清算款	105,221.31
3	应收股利	-
4	应收利息	1,062.50
5	应收申购款	129,813.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	275,625.68

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

基金合同生效日(2021年7月19日)基金份额总额	41,098,039.41
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,661,311.99
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,220,771.79
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	41,538,579.61

§ 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

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资产管理合同》
- 3、《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》

- 4、《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》
- 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、报告期内披露的各项公告

9.2 存放地点

集合计划管理人、集合计划托管人处。

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。

东海证券股份有限公司

2021 年 10 月 27 日