

东海证券海睿锐意 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：东海证券股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 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建设银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 4 月 21 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 2022 年 01 月 01 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东海海睿锐意 3 个月定开
基金主代码	970050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 27 日
报告期末基金份额总额	15,882,193.76 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； 5、开放期投资策略。
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	中国建设银行股份有限公司

§ 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（2022年1月1日-2022年3月31日）
1. 本期已实现收益	-1,812,529.90
2. 本期利润	-2,426,722.38
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1550
4. 期末基金资产净值	17,247,169.83
5. 期末基金份额净值	1.0859

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	-12.74%	1.33%	-11.67%	1.16%	-1.07%	0.17%
自基金合同 生效起至今	-11.57%	1.31%	-11.22%	1.12%	-0.35%	0.19%

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

东海海睿锐意3个月定开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12月27日，图示日期为2021年12月27日至2022年3月31日；

(2) 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括公司债、企业债、国债、金融债、央行票据、短期融资券、可转换债券)、资产支持证券、债券逆回购、银行存款及其他中国证监会允许投资的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种, 管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。集合计划的投资组合比例为: 股票资产占集合计划资产的比例为 30%-90%。在开放期内, 本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等, 封闭期内不受上述 5%的限制。

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		
席红辉	本基金的基金经理	2020 年 6 月 10 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遵规守信情况的说明

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 年一季度的市场行情让人感到愈发的艰难，不仅春季躁动行情没有“如期而至”，市场在海内外多重利空因素的冲击下，还经历了更大幅度的调整。从海外来看，俄乌战争叠加美联储加息周期开启成为全球资产的交易主线，俄乌作为全球能源和农业大国，其战争引发资本市场对能源、工业品和农产品短缺的担忧，大宗商品价格快速上涨。同时，美联储政策收紧、全球避险情绪升温以及通胀预期带来的贵金属等避险资产价格上行，美债利率进一步上升，进一步压制了股票等风险资产的表现。从国内来看，在金融数据不及预期，宽信用效果分歧加大、国内多地疫情扩散、公募基金发行规模骤降等种种利空因素叠加影响下，悲观情绪蔓延，虽然 3 月在“金稳会”政策拖底后市场有企稳迹象，但风险偏好短期内仍无法全面修复。

从指数上看，一季度除红利指数收红外，其他宽基指数全部下跌。其中，上证综指下跌 10.65%，沪深 300 指数下跌 14.53%，创业板指数下跌 19.96%。市场结构方面，资金涌入稳增长和高股息板块，煤炭、地产、银行、建筑和农林牧渔板块为一季度表现前五的行业，其中煤炭、地产、银行保持正收益；而科技成长持续调整，电子、国防军工、汽车、电力设备和家电板块跌为一季度表现后五的行业。

投资操作上，本产品仓位了做了一些动态调整，配置上主要以农业、能源等上游周期品、地产基建等稳增长产业链为主，加仓了农林牧渔、地产、建筑、银行、能源、有色等品种，减仓了新能源、部分医药、大众消费、取得了一定的正向效果。

展望未来一个季度，预计海外地缘战争影响因素开始减弱，国内宏观经济环境成为更重要的变量。从目前的情况来看，俄乌战争趋于缓解，在二季度彻底停战概率不小，但欧美制裁对全球经济的影响将会在二季度显现；美联储或维持鹰派态度，后期海外经济是否进入滞涨或衰退需持续跟踪。国内方面，虽然 2 月份经济数据出现短暂反弹，但后续的金融数据仍处于下行阶段。此外，今年疫情的严重程度远超市场预期，对经济的负面影响特别是对消费的冲击更为显著，所以为达到今年政府工作报告中提出的 5.5%GDP 增长目标，着力稳增长依然是未来主要方向。就市场而言，在经历了一个季度的调整后，政策托底已出现，只要经济基本面不出现超预期下滑导致微观流动性进一步恶化，A 股将迎来筑底修复，我们对二季度市场行情保持谨慎乐观态度。操作

上，本产品将保持灵活主动，坚持稳增长为主线、适时关注科技成长的配置思路，坚持结构化配置，优中选优。行业方面，重点关注：稳增长力度加码的基建、地产、银行等相关产业链；有望困境反转及周期向上的农业板块；具有通胀预期的能源、有色等上游资源板块；政策加码催化、高景气度有望持续且超跌的新能源、电子半导体等板块细分龙头；在个股的选择方面侧重拥有较低估值水平、公司经营环境好转、交易结构不拥挤的标的。

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锐意 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划份额净值为 1.0859 元，本报告期计划份额净值增长率为-12.74%，同期业绩比较基准收益率为-11.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自本集合计划合同生效日至报告期末，曾出现连续二十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	13,525,418.05	78.02
	其中：股票	13,525,418.05	78.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	924,112.99	5.33
	其中：债券	924,112.99	5.33
	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	2,872,433.72	16.57
8	其他资产	13,956.10	0.08
9	合计	17,335,920.86	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	2,284,072.00	13.24
B	采矿业	323,472.00	1.88
C	制造业	7,506,051.05	43.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	457,780.00	2.65
E	建筑业	1,095,282.00	6.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	334,800.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	330,645.00	1.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,193,316.00	6.92
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	13,525,418.05	78.42

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	002714	牧原股份	13,600	773,296.00	4.48
2	688330	宏力达	5,161	661,898.25	3.84
3	600048	保利发展	36,600	647,820.00	3.76
4	601669	中国电建	88,800	647,352.00	3.75
5	300498	温氏股份	25,000	551,250.00	3.20
6	300181	佐力药业	50,500	549,945.00	3.19
7	600383	金地集团	38,200	545,496.00	3.16
8	603477	巨星农牧	20,700	531,162.00	3.08
9	600367	红星发展	22,400	528,864.00	3.07
10	300343	联创股份	34,500	463,335.00	2.69

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	908,951.11	5.27
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）	15,161.88	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	924,112.99	5.36

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	019654	21 国债 06	8,890	908,951.11	5.27
2	118002	天合转债	130	15,161.88	0.09

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

注：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

注：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

(1) 温氏股份：

因未依法履行其他职责，公司高管黄松德被深圳证券交易所于 2021 年 10 月 27 日依据相关法规给予监管关注处分决定。

因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，公司高管温鹏程被中国证券监督管理委员会广东监管局于 2021 年 08 月 05 日依据相关法规给予出具警示函处分决定。

(2) 牧原股份：

因未依法履行其他职责，公司高管秦英林被深圳证券交易所于 2022 年 04 月 08 日依据相关法规给予监管关注处分决定。

因未及时披露公司重大事项，公司高管项振华被中国证券监督管理委员会浙江监管局于 2021 年 07 月 03 日依据相关法规给予公开处罚，其他处分决定。

因未依法履行其他职责，公司高管秦英林被中国证券监督管理委员会于 2021 年 05 月 12 日依据相关法规给予约见谈话处分决定。

(3) 佐力药业：

因未依法履行其他职责，公司高管谈欣被中国证券监督管理委员会浙江监管局于 2022 年 03 月 04 日依据相关法规给予出具警示函处分决定。

(4) 联创股份：

因违规行为公告，员工违规，业绩预测结果不准确或不及时，未依法履行其他职责等，公司及公司高管李洪国、王宪东、郝志健，被深圳证券交易所于 2021 年 11 月 23 日依据相关法规给予公开批评处分决定。

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	13,956.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,956.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118002	天合转债	15,161.88	0.09

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	13,976,747.20
报告期期间基金总申购份额	2,006,664.77
减：报告期期间基金总赎回份额	101,218.21
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	15,882,193.76

§ 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

报告期期初管理人持有的本	384,931.86
--------------	------------

基金份额	
报告期期间买入/申购总份 额	
报告期期间卖出/赎回总份 额	
报告期期末管理人持有的本 基金份额	384,931.86
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例 (%)	2.42

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 27 日变更生效。

本报告期内，自 2022 年 3 月 16 日起，本集合计划基金经理由席红辉、刘俊共同担任，变更为由席红辉单独担任基金经理。管理人已在两日内编制临时公告，登载在指定报刊和网站上，并及时向中国证监会的派出机构报告。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予东风 3 号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《东海证券海睿锐意 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东海证券海睿锐意 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《东海证券海睿锐意 3 个月定期开放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、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 4 月 22 日