

东海证券海盈 3 个月持有期混合型集合资
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：交通银行股份有限公司

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2022年1月1日起至3月31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	50,077,094.51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（2022年1月1日-2022年3月31日）
1. 本期已实现收益	146,268.90
2. 本期利润	94,915.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0031
4. 期末基金资产净值	50,147,270.96
5. 期末基金份额净值	1.0014

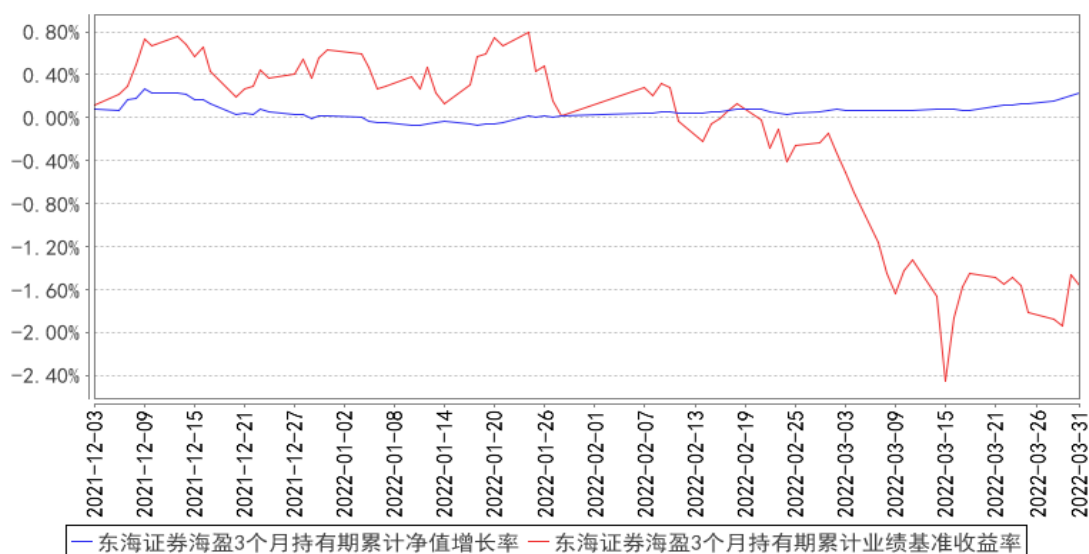
3.2 基金净值表现

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	0.21%	0.02%	-2.17%	0.23%	2.38%	-0.21%
自基金合同 生效起至今	0.23%	0.03%	-1.56%	0.21%	1.79%	-0.18%

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



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		
卓楸也	本基金的基金经理	2021年12月3日	-	6年	澳洲国立大学商务硕士，证券从业资格编号 S0630819010003，不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。2015年进入东海证券，历任东海证券股份有限公司资产管理部助理研究员、研究员、投资经理。擅长熟悉中游制造行业的研究和投资，坚持持续价值投资的投资理念。
潘一菲	本基金的基金经理	2021年12月3日	-	4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。

4.2 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

2022年一季度的股票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。

债券市场也出现显著调整。1月在降息催化下，债券市场收益率迅速走低，十年国债活跃券向下触及2.67%，为一年多以来的新低；2月受宽信用政策见效及进一步强化的影响利率反弹，本轮市场下跌还出现了一定程度的下跌-赎回-下跌负反馈现象，受权益市场调整的影响，部分固收+基金遭遇赎回，也强化了负反馈效果；3月在宽货币支撑下利率企稳，多地爆发的疫情也让债市做多情绪升温。

本报告期内，本产品完成了债券部分的建仓，并保持低股票仓位运作，配置方向以白马大盘股为主。从一季度来看，取得了较好的效果。后续在仓位上我们依然持谨慎态度，个股的选择方面则侧重拥有较低估值水平和公司经营环境好转的标的。

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盈3个月持有期混合型集合资产管理计划份额净值为1.0014元，本报告期计划份额净值增长率为0.21%，同期业绩比较基准收益率为-2.17%。

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。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	164,838.00	0.31
	其中：股票	164,838.00	0.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,099,002.36	91.65
	其中：债券	48,099,002.36	91.65
	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	2,500,511.64	4.76
	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	1,714,628.05	3.27
8	其他资产	1,545.03	0.00
9	合计	52,480,525.08	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	35,280.00	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,509.00	0.04
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	4,092.00	0.01
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	86,487.00	0.17
K	房地产业	19,470.00	0.04
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	164,838.00	0.33

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	601288	农业银行	21,900	67,452.00	0.13
2	300498	温氏股份	1,600	35,280.00	0.07
3	600048	保利发展	1,100	19,470.00	0.04
4	600919	江苏银行	2,700	19,035.00	0.04
5	000999	华润三九	200	9,072.00	0.02
6	603363	傲农生物	300	7,140.00	0.01
7	000501	鄂武商A	400	4,092.00	0.01
8	603755	日辰股份	100	3,297.00	0.01

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	4,277,313.37	8.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	34,571,275.31	68.94

5	企业短期融资券	2,038,823.01	4.07
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,058,012.59	6.10
8	同业存单	-	-
9	其他	4,153,578.08	8.28
10	合计	48,099,002.36	95.92

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	019641	20 国债 11	42,000	4,277,313.37	8.53
2	143106	17 洋河 01	40,000	4,195,353.42	8.37
3	155296	19 西南 01	40,000	4,153,578.08	8.28
4	122660	12 石油 07	31,000	3,244,071.01	6.47
5	132008	17 山高 EB	28,430	3,058,012.59	6.10

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

本集合计划本报告期内未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	1,545.03
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	1,545.03

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	132008	17山高EB	3,058,012.59	6.10

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	5,562,226.89
报告期期间基金总申购份额	46,795,556.67
减：报告期期间基金总赎回份额	2,280,689.05
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	50,077,094.51

§ 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 (%)
机构	1	20220208	0.00	8,040,004.02	8,040,004.02	0.00	0.00
个人	2	20220107-20220112	0.00	2,215,667.58	0.00	2,215,667.58	4.42
产品	3	20220126-20220128	0.00	12,563,071.67	12,563,071.67	0.00	0.00
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。							

注：自本集合计划生效起至报告期末，单一投资者持有基金份额比例曾在 2021 年 12 月 3 日至 1 月 14 日期间有超过 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 3 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

2022年4月22日