

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 3 季度报告

2022 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：2022 年 10 月 26 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2022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。

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	3,789,732.70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7月1日-2022年9月30日）
1. 本期已实现收益	-56,377.94
2. 本期利润	-28,322.55
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0034
4. 期末基金资产净值	3,805,617.55
5. 期末基金份额净值	1.0042

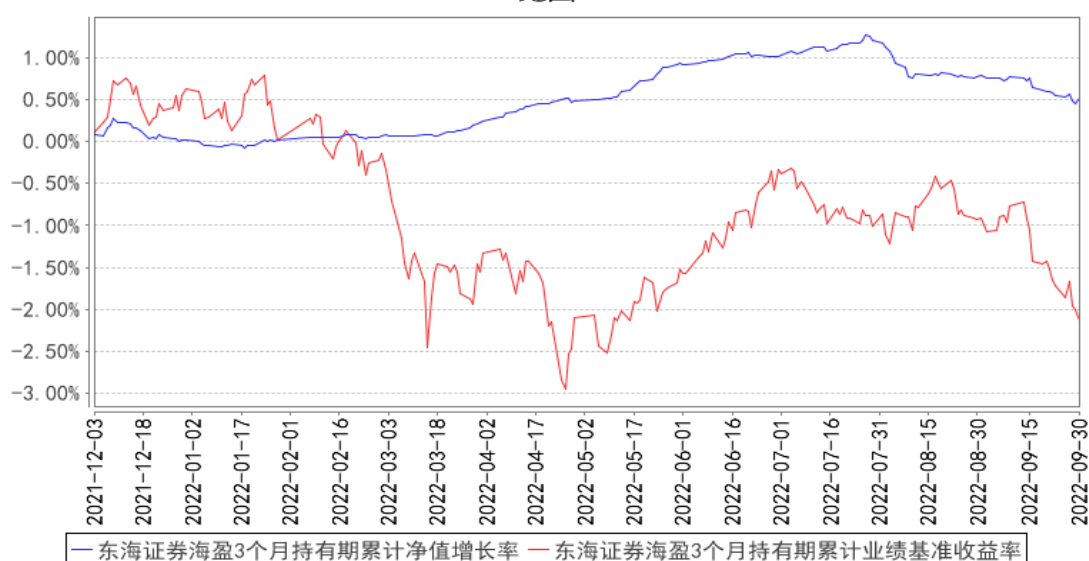
3.2 基金净值表现

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	-0.50%	0.03%	-1.80%	0.14%	1.30%	-0.11%
过去六个月	0.28%	0.03%	-0.58%	0.18%	0.86%	-0.15%
自基金合同 生效起至今	0.51%	0.03%	-2.13%	0.19%	2.64%	-0.16%

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		
卓楸也	本基金的基金经理	2021年12月3日	-	7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	-	5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：期末本集合计划的投资经理无兼任私募资产管理计划投资经的情况。

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 年三季度，国内经济总体呈现缓慢修复态势，经济结构性分化持续。疫情后生产增速快速恢复，需求增速则修复较慢，基建增速再创新高，出口增速开始下行，地产维持负增长，大宗带动 PPI 加速回落但 CPI 保持平稳震荡。从具体宏观经济数据来看，稳增长政策的持续发力和较强的外需，共同构成了经济恢复的主要动力。

从资金面上看，三季度仍处于宽松环境。尽管 7 月初央行在公开市场持续缩量投放，引发市场对于流动性紧缩的担忧，但实际上无论是量还是价，资金面都保持非常宽裕，银行间隔夜加权利率一度位于 1.0%附近，央行操作并未对市场形成显著扰动。8 月 15 日，央行对公开市场利率及 MLF 同步调降 10bp，超出市场预期，短期内流动性维持宽松的局面得到确认，债券收益率快速下行。

海外依旧处于地缘冲突、能源短缺、高通胀背景下紧缩的乱局之中。进入 9 月末，俄乌战争有再度恶化迹象，此举或进一步加剧欧洲的能源及经济衰退；美国经济韧性较强，但在高通胀背景下，美联储今年已累计加息 5 次，幅度达 300 个基点，其工业数据和信贷数据都面临巨大压力。

从市场表现来看，三季度债券市场波动明显，具体来看，7-8 月份利率有一轮显著下行，十年国债收益率最低点较高点下行约 20bp，进入 9 月后，市场出现一定幅度调整，十年国债收益率上行幅度约 10bp。A 股整体呈现出震荡下跌的趋势。三季度，上证指数、沪深 300、创业板指数分别下跌了 11.01%、15.16%、18.56%；分行业来看，三季度 31 个申万一级行业中仅煤炭行业微涨，而二季度反弹急先锋汽车和电力设备板块在三季度表现垫底。具体而言，三季度煤炭、综合和公用事业三个行业表现最好，涨幅分别为 0.97%、-1.12%和-4.54%；电子、电力设备和建筑材料三个行业表现最差，跌幅分别为 17.58%、18.01%和 23.98%。

本报告期内，产品规模有一定程度下降，产品净值发生小幅波动。债券投资集中于利率债及高等级信用债，股票仓位维持低位运作，配置方向为白马大盘股，风格均衡。

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 1.0042 元，本报告期计划份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准收益率为-1.80%。

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	175,424.00	4.47
	其中：股票	175,424.00	4.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,849,561.59	47.11
	其中：债券	1,849,561.59	47.11
	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	1,299,216.83	33.10
	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	497,820.80	12.68
8	其他资产	103,709.41	2.64
9	合计	3,925,732.63	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	3,603.00	0.09
C	制造业	61,903.00	1.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,104.00	0.48
E	建筑业	17,892.00	0.47
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	54,122.00	1.42
K	房地产业	19,800.00	0.52
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	175,424.00	4.61

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	11,900	34,034.00	0.89
2	002508	老板电器	900	20,637.00	0.54
3	600919	江苏银行	2,700	20,088.00	0.53
4	600048	保利发展	1,100	19,800.00	0.52
5	300982	苏文电能	400	17,892.00	0.47
6	002960	青鸟消防	700	17,010.00	0.45
7	603517	绝味食品	300	15,030.00	0.39
8	002032	苏泊尔	200	9,226.00	0.24
9	600900	长江电力	400	9,096.00	0.24
10	600905	三峡能源	1,600	9,008.00	0.24

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	1,013,432.63	26.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	314,872.93	8.27
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	309,899.59	8.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	211,356.44	5.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,849,561.59	48.60

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	155804	19华创04	3,000	314,872.93	8.27

2	175240	20 远东八	3,000	309,899.59	8.14
3	019664	21 国债 16	3,000	306,317.34	8.05
4	019666	22 国债 01	3,000	304,864.93	8.01
5	019679	22 国债 14	3,000	301,325.26	7.92

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

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	2,761.24
2	应收证券清算款	100,948.17
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	103,709.41

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	132015	18中油EB	211,356.44	5.55

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	12,936,856.68
报告期期间基金总申购份额	3,851.11
减：报告期期间基金总赎回份额	9,150,975.09
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	3,789,732.70

§ 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自有资金申购、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 03 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 10 月 26 日