

东海证券海盈 6 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：中信银行股份有限公司

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。

集合计划托管人中信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 6 个月持有期
基金主代码	970083
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额	14,423,687.14 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×80%+沪深 300 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	中信银行股份有限公司
-------	------------

§ 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	60,783.43
2. 本期利润	-644,677.96
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0424
4. 期末基金资产净值	12,223,901.26
5. 期末基金份额净值	0.8475

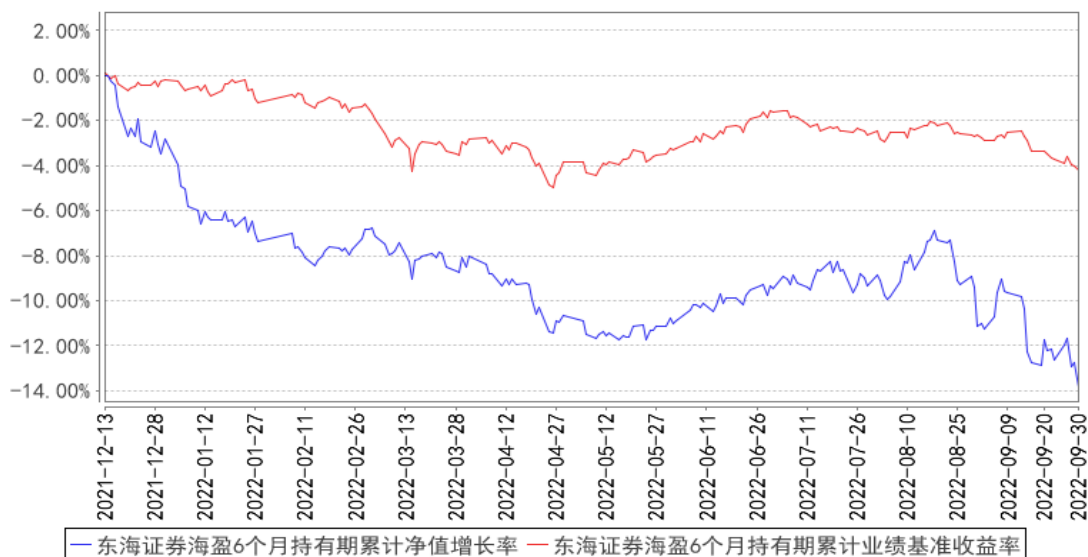
3.2 基金净值表现

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	-4.90%	0.68%	-2.63%	0.18%	-2.27%	0.50%
过去六个月	-5.78%	0.56%	-1.12%	0.24%	-4.66%	0.32%
自基金合同 生效起至今	-13.80%	0.53%	-4.17%	0.25%	-9.63%	0.28%

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6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



注：注：（1）本集合计划合同生效日为 2021 年 12 月 13 日，图示日期为 2021 年 12 月 13 日至 2022 年 9 月 30 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，包括国内依法发行上市的股票（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、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生品（包括股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。本集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的比例范围为 0%-40%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或者到期日在 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。证券衍生品及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

§ 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		
潘一菲	东海证券	2021 年 12 月	-	5 年	现任东海证券股份有限公司资产管理部

	股份有限公司资产管理部基金经理	13日			基金经理，历任东海证券东海证券股份有限公司资产管理部交易员、投资经理助理、投资经理。
郑军	东海证券股份有限公司资产管理部基金经理	2021年12月13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。证券基金从业逾10年，多次获评“新财富最佳分析师”、“金牛奖最佳分析师”。

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

进入2022年3季度，A股市场整体上先震荡上行、后单边大幅下行的趋势；美联储激进加息预期的边际变化基本主导了外部市场情绪，7月中上旬国际原油价格的持续回落缓和海外通胀压力，美联储激进加息预期降温推动了外部市场的一波强力反弹，A股市场面临的外部冲击有所缓和；而国内政策面总体偏暖，尤其是稳增长政策持续加码并注重细化落实；但同时国内疫情时

有反复、国内经济复苏节奏也有波动，使得 A 股市场宽幅波动、震荡上行至 8 月中上旬；但之后美国通胀读数快速走高、美联储激进加息及海外衰退的预期明显升温、美元指数及美 10 年期国债利率大幅飙升、欧美股市大幅调整，外部冲击压力大增，叠加人民币汇率的一波快速贬值，北上资金及海外短线资金流出压力陡然增加，叠加国内疫情再次零星扩散、消费与地产数据低迷、国内经济复苏乏力的担忧情绪升温，导致 8 月中下旬起 A 股出现了单边大幅下跌并持续到 9 月底。最终本报告期上证指数、深圳成指、创业板指数分别大跌 11.01%、16.42%、18.56%。在市场结构上，总体来看成长、消费、周期轮番杀跌，其中建材/钢铁/有色金属/基础化工/建筑等周期板块、汽车/社会服务/医药生物/传媒/商贸零售等消费板块、电力设备/计算机/电子等成长板块跌幅较大，仅煤炭、通讯等两个板块上涨。

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。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。进入 9 月后，市场表现受到了一定程度海外因素的影响，主要为美联储紧缩下造成人民币汇率贬值压力，引发市场对于货币政策宽松持续性的担忧，市场出现一定幅度调整，十年国债收益率上行幅度约 10bp。

本报告期内，本产品债券投资上维持中高评级、中短久期债券为主的投资策略；股票方面减少了稳增长板块的仓位配置，进一步聚焦成长、消费，在市场低点的时候小幅加仓了风光储电，以及股价超跌、估值低位、受益疫情好转的医药龙头。

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 6 个月持有期混合型集合资产管理计划份额净值为 0.8475 元，本报告期计划份额净值增长率为-4.90%，同期业绩比较基准收益率为-2.63%。

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	4,445,867.93	35.28
	其中：股票	4,445,867.93	35.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,703,593.08	53.20
	其中：债券	6,703,593.08	53.20
	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	-935.76	-0.01
	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	445,949.56	3.54
8	其他资产	1,005,583.87	7.98
9	合计	12,600,058.68	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	78,792.00	0.64
C	制造业	3,675,776.93	30.07
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	242,575.00	1.98
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	312,513.00	2.56
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	136,211.00	1.11
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	4,445,867.93	36.37
----	--------------	-------

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	605117	德业股份	1,000	420,210.00	3.44
2	300750	宁德时代	800	320,712.00	2.62
3	000776	广发证券	21,900	312,513.00	2.56
4	301155	海力风电	3,600	304,560.00	2.49
5	003022	联泓新科	7,600	303,848.00	2.49
6	300763	锦浪科技	1,200	265,140.00	2.17
7	688599	天合光能	3,857	247,272.27	2.02
8	002120	韵达股份	15,500	242,575.00	1.98
9	002056	横店东磁	11,900	235,501.00	1.93
10	002487	大金重工	5,300	212,477.00	1.74

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	1,072,110.70	8.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,044,637.53	8.55
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,164,131.97	34.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	422,712.88	3.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,703,593.08	54.84

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	019664	21 国债 16	10,500	1,072,110.70	8.77
2	136050	15 景德 01	10,000	1,048,884.93	8.58
3	163975	19 青控 Y1	9,990	1,047,793.62	8.57
4	175197	20 国都 G1	10,000	1,044,637.53	8.55
5	163054	19 兴投 01	10,000	1,034,454.79	8.46

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

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	4,544.14
2	应收证券清算款	1,001,039.73
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	1,005,583.87

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	422,712.88	3.46

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	15,376,065.84
报告期期间基金总申购份额	1,115.49
减：报告期期间基金总赎回份额	953,494.19
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	14,423,687.14

§ 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 13 日变更生效。

本集合计划管理人于 2022 年 9 月 5 日披露了《东海证券股份有限公司关于以通讯方式召开东海证券海盈 6 个月持有期混合型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》，会议审议《关于持续运作东海证券海盈 6 个月持有期混合型集合资产管理计划的议案》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予东海证券东风 8 号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《东海证券海盈 6 个月持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东海证券海盈 6 个月持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《东海证券海盈 6 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、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

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