

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 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：中国建设银行股份有限公司

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 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	12,788,221.32 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 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	375,146.97
2. 本期利润	-1,767,378.80
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1418
4. 期末基金资产净值	12,636,752.69
5. 期末基金份额净值	0.9882

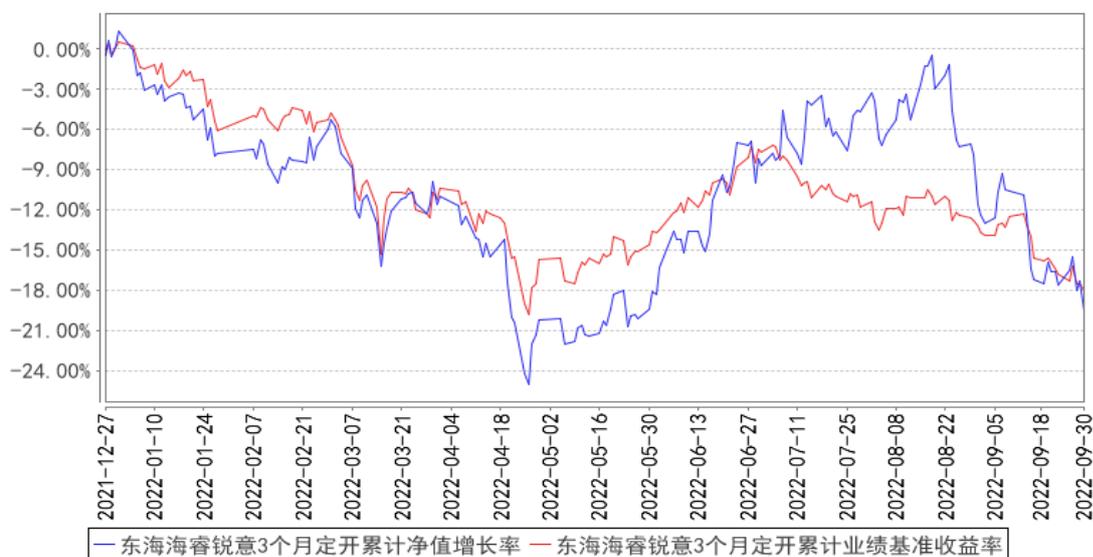
3.2 基金净值表现

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	-12.34%	1.69%	-11.40%	0.74%	-0.94%	0.95%
过去六个月	-9.00%	1.71%	-7.64%	0.98%	-1.36%	0.73%
自基金合同 生效起至今	-19.53%	1.58%	-18.00%	1.03%	-1.53%	0.55%

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 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。

§ 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	2021 年 12 月 27 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。
刘迟到	本基金的基金经理	2022 年 9 月 6 日	-	14 年	现任东海证券股份有限公司资产管理部投资经理，2008 年 4 月至 2018 年 3 月曾分别担任天相投资顾问有限公司、浙商证券研究所、申万宏源研究所家电行业分析师，2018 年 4 月至 2022 年 2 月，在毕盛投资管理有限公司担任分析师和投资经理，2022 年 3 月加入东海证券。

注：本集合计划的基金经理席红辉自 2020 年 6 月 10 日起担任原东风 3 号集合资产管理计划投资经理。

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 年三季度，受地缘冲突、欧美国家高通胀、美联储大幅加息、海外主要经济体流动性收紧的影响，加上 9 月中下旬国内疫情散发，人民币出现快速贬值的背景下，A 股市场在三季度明显承压，主要指数表现较弱。从国内经济看，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。从海外经济来看，除美国经济以外，全球其他主要经济体受地缘冲突、能源短缺及流动性收缩影响，出现明显下行趋势，主要国家货币相对美元出现大幅贬值。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；美国经济虽然韧性较强，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，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，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的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%。

在操作上，本产品在三季度适当做了减仓，选择在新能源反弹较高时兑现了一部分光伏、风电的持仓股票，但由于本产品成长股仓位较重，尤其是新能源车产业链三季度一直处于调整态势，拖累了本产品的表现。

展望四季度，我们认为 A 股有望迎来一波修复行情。首先，国内经济将面临较强的韧性并且在宏观政策加持的背景下有望持续恢复向上，影响经济下行最大因素的房地产投资降幅有望迎来拐点；其次，从最近公布的 9 月份金融数据来看，总量和结构都有明显改善，流动性总体偏宽松。更为重要的是，A 股市场经过三季度大幅下跌，整体估值水平处于历史低位、而股权风险溢价都处于历史高位，从中长期看，目前市场 A 股具备较高的投资价值。从海外经济来看，尽快主要经济体受俄乌冲突持续等因素影响仍然面临不确定性，但美联储加息对全球流动性的边际冲击有望在未来削弱，并且美联储紧缩的货币政策有望最快在明年年初迎来拐点。

在操作上，本产品将保持中性偏高的仓位，并保持一定的灵活机动。从行业选择来看，我们仍然看好全球政策支持、行业景气度向上、国内具有配套优势的光伏、风电、储能、新能源车等产业链龙头。随着全球传统能源的紧缺和低碳理念逐渐深入人心，能源结构持续向新能源转型，新能源发电和新能源汽车的渗透率在逐渐提升。中国作为全球的制造业中心，在新能源产业链上已经涌现了越来越多、具备长期优质成长潜力的公司，这些公司的竞争力日益加强，市占率还在持续提升，未来几年有望实现较快的复合增速。此外，我们也会重点关注：估值与成长性匹配性强、涉及国家安全、自主可控需求空间大、政策重点扶持的军工、电子半导体；以及政策边际改善、需求持续恢复且板块超跌与估值低位的医疗健康、必需消费等板块。

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 0.9882 元，本报告期计划份额净值增长率为-12.34%，同期业绩比较基准收益率为-11.40%。

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，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	10,273,383.81	80.07
	其中：股票	10,273,383.81	80.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,550,304.32	19.88
8	其他资产	6,229.71	0.05
9	合计	12,829,917.84	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	-	-
C	制造业	10,023,223.81	79.32
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	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	250,160.00	1.98
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	10,273,383.81	81.30

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	300750	宁德时代	1,700	681,513.00	5.39
2	688408	中信博	5,713	548,448.00	4.34
3	300568	星源材质	26,900	538,538.00	4.26
4	300373	扬杰科技	10,000	493,900.00	3.91
5	300450	先导智能	9,800	463,638.00	3.67
6	688390	固德威	1,606	454,546.18	3.60
7	688116	天奈科技	3,924	451,927.08	3.58
8	688599	天合光能	6,864	440,051.04	3.48
9	300014	亿纬锂能	4,900	414,540.00	3.28
10	300850	新强联	4,700	414,070.00	3.28

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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) 中信博：

因业绩预测结果不准确或不及时，未依法履行其他职责，公司本身及公司高管蔡浩、王程、王怀明、刘义君被上海证券交易所于 2022 年 07 月 04 日依据相关法规给予监管关注处分决定。

(2) 天奈科技：

因补充流动资金实际用途与公司公告不符，公司本身被中国证券监督管理委员会江苏监管局于 2021 年 12 月 7 日依据相关法规给予责令改正处分决定。

对上述证券的投资决策程序的说明：本集合计划投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	6,229.71
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	其他	-
8	合计	6,229.71

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

报告期期初基金份额总额	12,398,363.94
报告期期间基金总申购份额	456,178.81
减：报告期期间基金总赎回份额	66,321.43
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	12,788,221.32

§ 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基金份额	384,931.86
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（%）	3.01

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 9 月 6 日起，本集合计划基金经理由席红辉单独担任，变更为由席红辉、刘迟到共同担任基金经理。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。

本集合计划管理人于 2022 年 9 月 13 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持有人大会的公告》，会议审议《关于持续运作东海证券海睿锐意 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划的议案》。

§ 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 10 月 26 日