

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 4 季度报告

2022 年 12 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：2023 年 1 月 20 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 2023 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 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	12,777,100.36 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-1,212,523.85
2. 本期利润	-830,208.01
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0649
4. 期末基金资产净值	11,796,182.17
5. 期末基金份额净值	0.9232

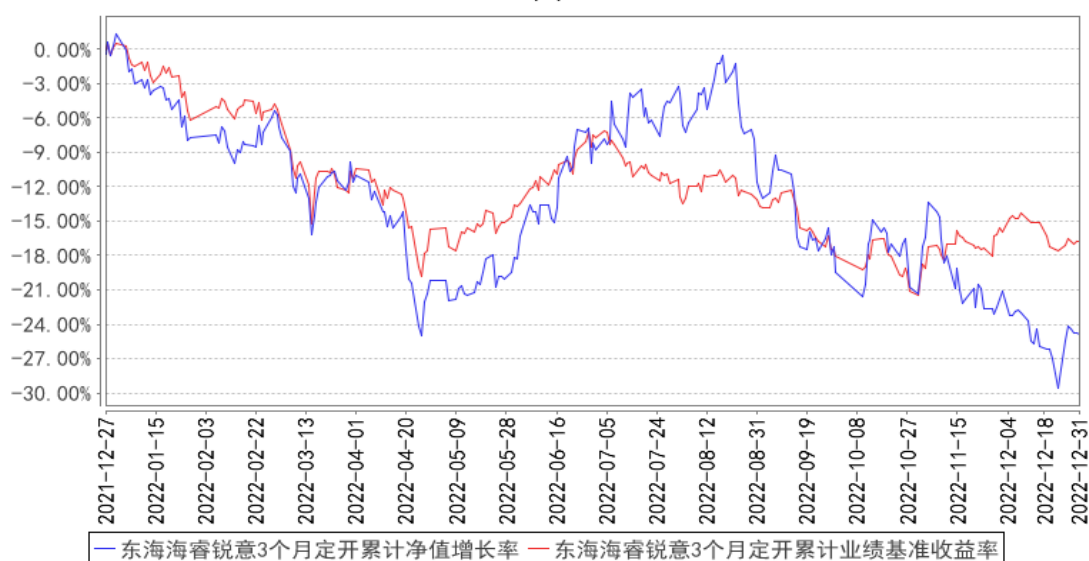
3.2 基金净值表现

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	-6.58%	1.89%	1.56%	0.94%	-8.14%	0.95%
过去六个月	-18.11%	1.78%	-10.02%	0.85%	-8.09%	0.93%
过去一年	-25.82%	1.67%	-17.15%	1.01%	-8.67%	0.66%
自基金合同 生效起至今	-24.82%	1.66%	-16.73%	1.01%	-8.09%	0.65%

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 12 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。

§ 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	本集合计划的基金经理	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副总经理、基金经理，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	本集合计划的基金经理	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基金经理，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

从宏观层面来看，四季度国内经济整体受疫情扰动有所回落。基建增速小幅回落，出口受海外衰退预期影响增速转负，消费受疫情冲击依然低迷，地产维持负增长，经济总体处于二次探底状态。但国内二十大成功召开、经济与社会生活各方面的维稳预期，提振了市场信心。尽管国内疫情时有反复，但 11 月中旬国内优化防控工作的二十条措施正式出台，并在 12 月上旬全面放开疫情防控，持续了三年的疫情对国内经济与社会生活各方面的冲击将逐渐结束；中央经济工作会议将 2023 年目标定为“实现质的有效提升和量的合理增长，保持经济运行在合理区间”，提升了市场对 2023 年中国经济复苏的信心；此外，四季度地产政策持续加持，叠加《扩大内需战略规划纲要（2022-2035 年）》政策出台，国内政策面总体偏暖，进一步强化了国内经济复苏的预期。

从市场表现来看，A 股整体呈现修复趋势。四季度，上证指数、沪深 300、创业板指数分别上涨了 2.14%、1.75%、2.53%；分行业来看，疫后复苏主线领涨，成长板块下跌。申万一级行业指数涨跌幅居前 5 位的行业依次为社服、计算机、传媒、综合和医药生物，涨幅分别为 21.84%、14.18%、14.08%、13.48%和 10.56%；煤炭、石油石化、电力设备、有色金属和房地产跌幅居前，跌幅分别为-16.37%、-5.12%、-3.89%、-2.44%、-0.90%。

在操作上，本产品三季度主要以风电、光伏、储能、电动车等高景气板块为主，而这些板块在四季度出现明显下跌，导致本产品在此期间也出现了较大回撤。但从中长期视角来看，考虑到全球主要国家“双碳”战略方向和目标不会改变，相关的支持政策继续加码的概率较大，“风

电、光伏、储能、电动车”等领域的行业高景气度有望持续，再加上四季度大幅度调整后，上述领域的主要龙头公司估值已经回到历史低位，具备较强的投资价值，因此我们选择了继续坚守，并小幅调仓了白酒、军工、电子半导体等品种。

展望 2023 年，我们认为随着国内经济逐步复苏，A 股市场有望平稳向上。首先，压制 A 股的三大因素（疫情管控、房地产恶化、美联储加息）有望得到全面缓解。其次，随着 2023 年经济逐步复苏，A 股上市公司盈利有望明显改善；预计全年全 A（剔除金融石化）归母净利润将实现两位数增长；再次，A 股市场估值有望提升。随着美联储加息到顶，包括 A 股在内的全球风险资产估值有抬升的空间；此外，2023 年国内经济持续复苏，而海外主要经济体面临较大衰退压力，国内经济基本面的比较优势有望支持人民币汇率企稳向上，从而推动海外资本加大对国内 A 股市场的配置。同时，随时市场风险偏好提升，国内公募基金、银行理财资金、保险资金及两融资金也会接力外资形成持续流入。展望一季度，我们对 A 股市场谨慎乐观。主要原因在于疫情放开后，此起彼伏的感染高峰将会对市场的供给和需求造成较大的冲击，经济基本面短期承压。但随着疫情感染达峰之后平稳下降，叠加稳增长政策持续加码，我们认为国内经济将逐步走出低谷，A 股市场也有望震荡向上。

在操作上，本产品仍将保持中性偏高的仓位，并保持一定的灵活机动。在行业选择上，我们坚定看好受益于国内产业升级、工程师红利、供应链齐全等因素驱动的高端制造业，尤其是看好全球政策支持、行业景气度向上、具有明显比较优势的的风电、光伏、储能、电动车等产业链；受益于疫情放松、经济复苏、场景恢复等因素驱动的食品饮料、医药生物等大消费行业；以及国家安全需求刚性、国产替代空间大、估值与成长性匹配的军工、电子半导体、信创可控等科技创新行业。

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 0.9232 元，本报告期计划份额净值增长率为-6.58%，同期业绩比较基准收益率为 1.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划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，本集合计划管理人已向中国证监会报告本集合计划的解决方案。

§ 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	10,212,779.48	85.52
	其中：股票	10,212,779.48	85.52
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	1,665,887.32	13.95
8	其他资产	63,828.14	0.53
9	合计	11,942,494.94	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	10,212,779.48	86.58
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	-	-
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	10,212,779.48	86.58
----	---------------	-------

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	300750	宁德时代	2,100	826,182.00	7.00
2	688408	中信博	7,814	768,897.60	6.52
3	002531	天顺风能	48,100	727,753.00	6.17
4	300014	亿纬锂能	7,500	659,250.00	5.59
5	300274	阳光电源	5,700	637,260.00	5.40
6	300724	捷佳伟创	5,400	615,708.00	5.22
7	688599	天合光能	8,934	569,631.84	4.83
8	300373	扬杰科技	10,000	526,000.00	4.46
9	600096	云天化	23,700	498,648.00	4.23
10	300443	金雷股份	12,100	487,388.00	4.13

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

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。

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	4,689.99
2	应收证券清算款	59,138.15
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	63,828.14

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	12,788,221.32
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	11,120.96
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	12,777,100.36

§ 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	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
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、买卖本集合计划份额。

§ 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》，本次大会决议自 2022 年 10 月 25 日起生效，本集合计划管理人已向中国证券监督管理委员会备案。

§ 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

2023 年 1 月 20 日