

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  
2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 25 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 10 月 24 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 2023 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	12,386,921.25 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-909,151.79
2. 本期利润	-1,107,095.30
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0881
4. 期末基金资产净值	9,172,807.36
5. 期末基金份额净值	0.7405

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 本集合计划资产管理合同生效日为 2021 年 12 月 27 日（由证券公司大集合资产管理产品东风 3 号变更而来）。

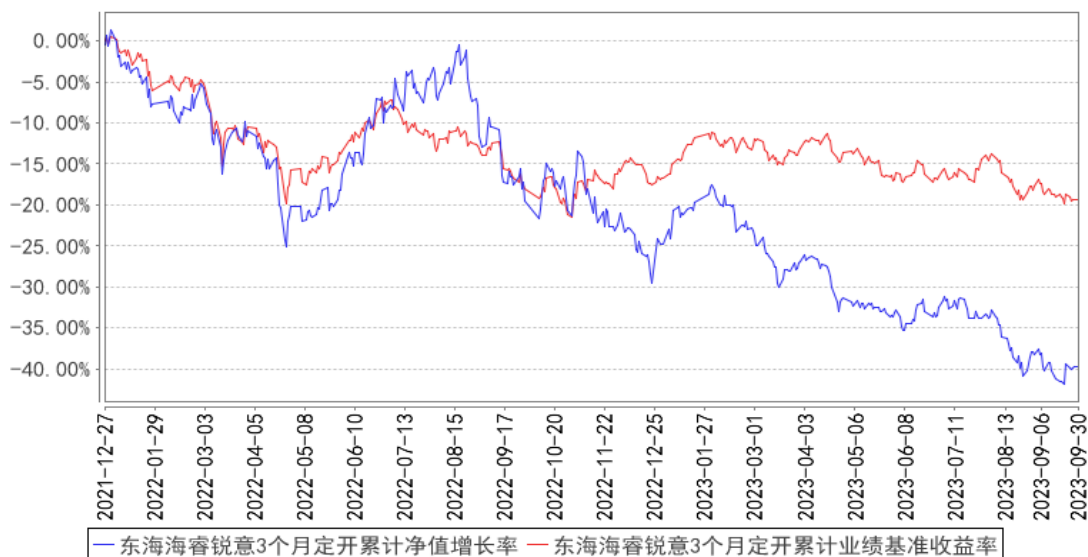
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-10.62%	1.24%	-3.41%	0.70%	-7.21%	0.54%
过去六个月	-17.58%	1.10%	-7.24%	0.67%	-10.34%	0.43%
过去一年	-25.07%	1.34%	-1.66%	0.74%	-23.41%	0.60%
自基金合同 生效起至今	-39.70%	1.45%	-19.36%	0.88%	-20.34%	0.57%

#### 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 2023 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	本集合计划的投资经理	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、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	本集合计划	2022 年 9 月 6 日	-	15 年	现任东海证券股份有限公司资产管理部

	划的投资 经理	日			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 月入东海证券。
--	------------	---	--	--	---

注：1、本集合计划的投资经理席红辉自 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。

2、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为资产管理合同生效日，其“离职日期”根据公司决议确定的解聘日期；

3、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

4、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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

从宏观层面来看，三季度国内经济总体呈现出弱复苏态势。投资、消费同比增速未出现明显

起色，出口仍然延续负增长。从流动性来看，三季度央行连续出台降息、降准政策，总体流动性相对宽松。从政策来看，7月24日中央政治局会议上提出“适时调整优化房地产政策”，“要活跃资本市场，提振投资者信心”、“制定实施一揽子化债方案”等下半年政策方向的重磅定调，体现了高层对稳经济增长的决心和对资本市场的大力支持。随后，财政部联合证监会宣布“证券交易印花税实施减半征收”、证监会“阶段收紧 IPO 融资节奏”等政策组合拳，大幅提振了市场情绪。海外方面，美国等发达国家通胀仍维持高位震荡，美国公布的8月CPI超预期上行至3.7%，尽管美联储维持9月利率不变，但鹰派表态“预计今年年底前仍将加息1次，并在更长时间内保持更高的利率水平”，由此影响，美元指数、美债收益率持续走高，10年期美债收益率三季度上升了73.8个BP，打压了全球金融市场的风险偏好。受外需走弱、中美利差扩大及美元指数走高、人民币贬值等影响，外资在三季度大幅流出超800亿。

在三季度国内经济复苏低于预期和外资大幅流出的双重压力下，A股延续了二季度的调整行情。上证指数、沪深300、创业板指数分别下跌了-2.86%、-3.98%和-9.53%。分行业来看，以低估值、高分红并受益原油涨价的周期板块相对占优，申万一级行业指数涨跌幅居前5位依次为非银金融、煤炭、石油、钢铁和银行，涨跌幅分别为5.62%、5.26%、4.37%、2.14%和1.5%；在美债利率走高和市场风险偏好持续降低的背景下，以TMT为代表的科技成长板块出现了较大幅度调整。电力设备、传媒、计算机、通信、国防军工跌幅居前5位，涨跌幅分别为-15.68%、-15.58%、-11.71%、-10.65%、-9.40%。

操作上，本产品在三季度维持中性偏高的仓位，并进行了调仓操作。基于对人工智能中长期高景气的看好，以及存储为代表的电子半导体周期拐点临近且估值在持续调整后具备较强性价比，本产品逢低持续增持了光通信为代表的算力板块，以存储为代表的电子半导体，减仓了光伏、锂电等新能源板块。

展望四季度，我们认为A股走势有望震荡向上。从经济基本面看，随着稳增长政策持续落地，宏观经济出现了改善向好趋势。据国家统计局公布数据，8月社消零售总额同比为4.6%，较7月边际改善。8月全国规模以上工业企业利润同比增长17.2%，为去年下半年以来首次实现正增长。9月制造业PMI数据超预期升至50.2%，连续4个月回升并重回扩张区间；从估值来看，经过持续调整，主要指数估值仍处于历史较低分位。从股债性价比来看，目前Wind全A股权风险溢价处于历史较高分位。从流动性来看，稳增长政策持续推进，宏观流动性有望维持边际宽松。随着证监会“活跃资本市场”组合拳落地见效，9月以来杠杆资金净流入已由负转正，A股融资节奏放缓，大股东减持力度减弱并且上市公司增持回购力度加大，股市微观流动性有望明显改善。海外方面，近期中美双方已商定成立经济领域工作组，包括“经济工作组”和“金融工作

组”，中美关系边际改善有望提振市场信心。投资策略上，我们重点关注：一是受 AIGC 人工智能催化、中长期产业具有高景气度、业绩确定性强，并有持续政策和事件催化的算力板块，以及处于周期底部，科技自立自强，以存储为代表的电子半导体板块；二是受益于经济基本面修复的食品饮料、生物医药以及周期有望向上的农业养殖等大消费板块。

#### 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 0.7405 元，本报告期计划份额净值增长率为-10.62%，同期业绩比较基准收益率为-3.41%。

#### 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	8,031,929.87	86.55
	其中：股票	8,031,929.87	86.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	471,808.39	5.08
	其中：债券	471,808.39	5.08
	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	701,578.44	7.56
8	其他资产	74,364.75	0.80
9	合计	9,279,681.45	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	410,168.00	4.47
B	采矿业	-	-

C	制造业	7,012,210.35	76.45
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	503,980.00	5.49
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	105,571.52	1.15
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	8,031,929.87	87.56

### 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	300308	中际旭创	5,400	625,320.00	6.82
2	002409	雅克科技	8,600	555,560.00	6.06
3	002463	沪电股份	23,900	537,989.00	5.87
4	300750	宁德时代	2,580	523,817.40	5.71
5	000063	中兴通讯	15,700	513,076.00	5.59
6	603986	兆易创新	4,400	433,840.00	4.73
7	688008	澜起科技	8,447	419,815.90	4.58
8	300498	温氏股份	23,600	410,168.00	4.47
9	002475	立讯精密	11,400	339,948.00	3.71
10	603566	普莱柯	13,900	296,209.00	3.23

### 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	-	-



2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	471,808.39	5.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	471,808.39	5.14

### 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	113616	韦尔转债	3,220	363,941.60	3.97
2	128136	立讯转债	970	107,866.79	1.18

### 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) 雅克科技：

因违反“三同时”制度,违反现场检查制度,违反固体废物管理制度,未依法履行职责,公司本身被无锡市生态环境局于 2023 年 9 月 19 日依据相关法规给予罚款 19.3 万元处分决定。

##### (2) 韦尔转债：

因未按规定披露定期报告,公司本身被上海证券交易所于 2023 年 5 月 20 日依据相关法规给予监管工作函。

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	3,042.10
2	应收证券清算款	71,322.65
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	74,364.75

#### 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	113616	韦尔转债	363,941.60	3.97
2	128136	立讯转债	107,866.79	1.18

#### 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	12,622,820.39
报告期期间基金总申购份额	1,208.27
减：报告期期间基金总赎回份额	237,107.41
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	12,386,921.25

## §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（%）	3.11

### 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 2023 年 6 月 26 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 2023 年 8 月 7 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 10 月 25 日