

东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资
产管理计划
2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 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管管理计划资产，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的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海海睿健行	
基金主代码	970047	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 29 日	
报告期末基金份额总额	24,896,273.13 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。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%	
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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	海睿健行 A	海睿健行 B
下属分级基金的交易代码	970046	970047

报告期末下属分级基金的份额总额	18,280,752.74 份	6,615,520.39 份
-----------------	-----------------	----------------

§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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	海睿健行 A	海睿健行 B
1. 本期已实现收益	35,674.89	13,515.54
2. 本期利润	992,531.04	371,541.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0510	0.0527
4. 期末基金资产净值	9,288,779.44	3,477,389.60
5. 期末基金份额净值	0.5081	0.5256

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 9 月 29 日（由证券公司大集合资产管理产品东风 6 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

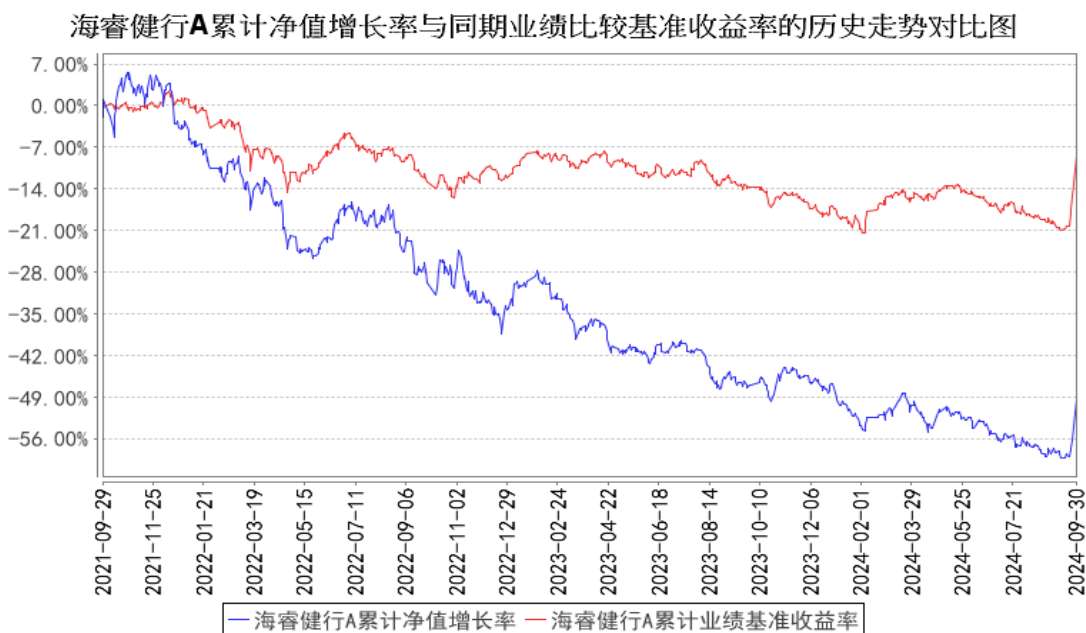
海睿健行 A

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	12.49%	1.80%	9.80%	0.98%	2.69%	0.82%
过去六个月	1.66%	1.56%	8.12%	0.78%	-6.46%	0.78%
过去一年	-4.65%	1.38%	5.92%	0.70%	-10.57%	0.68%
过去三年	-49.99%	1.32%	-8.30%	0.66%	-41.69%	0.66%
自基金合同 生效起至今	-49.45%	1.33%	-8.59%	0.66%	-40.86%	0.67%

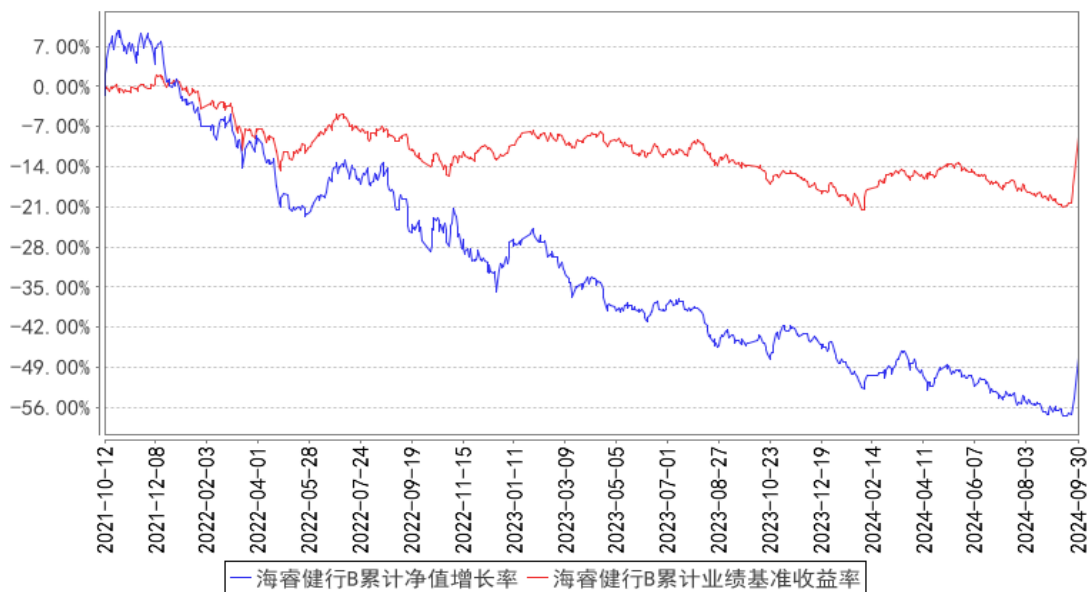
海睿健行 B

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	12.48%	1.80%	9.80%	0.98%	2.68%	0.82%
过去六个月	1.66%	1.56%	8.12%	0.78%	-6.46%	0.78%
过去一年	-4.66%	1.38%	5.92%	0.70%	-10.58%	0.68%
自基金合同 生效起至今	-47.44%	1.32%	-8.78%	0.66%	-38.66%	0.66%

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



海睿健行B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 9 月 29 日，图示日期为 2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 30 日；

(2) 本集合计划的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、次级债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

§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		
刘迟到	本集合计划的投资经理	2023 年 11 月 16 日	-	15 年	硕士研究生，2008 年 4 月-2018 年 3 月曾任天相投顾、浙商证券、申万宏源研究所家电行业分析师、2018 年 4 月-2022 年 2 月任海外大型 QFII 研究员和投资经理，长期深耕于消费品领域投资和研究，集中和逆向投资相结合，与公司长

					期发展共同成长。
--	--	--	--	--	----------

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，未发现本集合计划存在异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

截至 9 月 30 日，上证指数收盘于 3336.50 点，第三季度上涨 12.44%，沪深 300 指数收于 4017.85 点，第三季度上涨 16.07%，中证 2000 指数、万得全 A 指数，分别上涨 17.67%、17.68%。按照申万 31 个行业指数划分，第三季度非银金融、房地产和综合板块涨幅前三，分别上涨 41.67%、33.05%和 31.2%，商贸零售、社会服务板块紧随其后，涨幅榜排名相对靠后的三个板块分别为煤炭、石油石化、公用事业，分别上涨 1.24%、2%和 2.95%。9 月 18 日，上证指数跌破 2700 点，最低下探到 2689.7 点，如果剔除银行、公用事业等红利板块，多数行业指数创近两年来新低。

第三季度，A 股低迷行情终结于 9 月下旬，9 月 18 日，美联储将联邦基金利率区间下调 50 个基点，降至 4.75%至 5%之间的水平，此次为 2020 年 3 月以来首次降息，标志美国货币政策开启新一轮宽松周期。美国利率下调为中国货币政策宽松提供了一定的操作空间，9 月 24 日，中国人民银行、国家金融监督管理总局、中国证监会三个部门领导联合召开发布会，重点从货币、地产、金融和市场四个方面的具体政策展开，货币政策包括降准、降息、降低存量房贷利率三

方面，地产政策从首付比例、保障房再贷款支持比例、收购房企存量土地，金融政策增加六家大型商业银行核心一级资本，市场方面包括央行创设“证券、基金与保险公司互换便利”、“股票回购、增持再贷款”两项结构性工具两方面着手。中国经济目前面临内需不足、房地产销售大幅下滑等多方面的困难和问题，7-9 月份中国 CIP 当月同比分别增加 0.5%、0.6%和 0.4%，剔除食品和能源后的核心 CPI 当月同比分别增加 0.4%、0.3%和 0.1%，PPI 同比分别下降 0.8%、1.8%和 2.8%，经济持续通缩，1-8 月商品房销售面积累计下跌 18%，此次政策彻底转向标志国家开始向解决困扰中国经济困难的各个方面问题开战。

操作上，本季度基本无操作。展望第四季度，10 月 12 日，国务院新闻发布会上，财政部负责人分别从化债+银行注资+地产+民生四个方面推出一系列逆周期财政增量政策，虽然没有明确具体规模，但是给出较高的预期空间。相对货币政策，财政政策在流程和程序上相对较为复杂，但是此次财政和货币政策配合同时调转方向，将有助于中国经济走出通缩预期，从受益板块来讲，此次货币和财政宽松，短期来讲，将有助于改善今年大幅调整的高 β 成长板块如计算机等，刺激地产需求、化债和银行注资将直接利于银行和地产板块，由于政策传导以及消费者收入提高预期的改善需要的周期较长，内需的恢复性增长回到正常轨道尚需时日。

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健行灵活配置混合型集合资产管理计划 A 份额净值为 0.5081 元，B 份额净值为 0.5256 元，本报告期计划 A 份额净值增长率为 12.49%，B 份额净值增长率为 12.48%，本报告期计划 A、B 份额同期业绩比较基准收益率均为 9.80%。

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，未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人的情形。

截至本报告期末，曾出现连续六十个工作日计划资产净值低于五千万元的情形，本集合计划管理人已将解决方案上报中国证券监督管理委员会。

§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	10,117,677.21	77.80
	其中：股票	10,117,677.21	77.80
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	2,177,560.64	16.74
	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	708,317.18	5.45
8	其他资产	1,405.25	0.01
9	合计	13,004,960.28	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	6,836,325.11	53.55
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	271,036.00	2.12
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	1,901,515.10	14.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	326,656.00	2.56
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	488,545.00	3.83
R	文化、体育和娱乐业	293,600.00	2.30
S	综合	-	-
	合计	10,117,677.21	79.25

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	688008	澜起科技	9,362	626,130.56	4.90
2	002582	好想你	83,900	526,892.00	4.13
3	603501	韦尔股份	4,800	514,560.00	4.03
4	301267	华夏眼科	19,900	488,545.00	3.83
5	002653	海思科	10,000	369,600.00	2.90
6	002624	完美世界	35,100	336,960.00	2.64
7	002111	威海广泰	31,000	336,660.00	2.64
8	688062	迈威生物	11,959	330,427.17	2.59
9	300058	蓝色光标	46,400	326,656.00	2.56
10	600633	浙数文化	30,300	315,726.00	2.47

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**

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

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，在报告编制日前一年内，华夏眼科医院集团股份有限公司、北京蓝色光标数据科技股份有限公司存在被监管处罚的情形。

华夏眼科：2023 年 12 月 6 日收到通知，公司实际控制人、董事长苏庆灿先生因个人原因被上海市监察委员会实施留置。

蓝色光标：2023 年 12 月 15 日，商誉减值测试中未考虑研发费用税前加计扣除政策调整影响，导致 2022 年度部分商誉减值计提不准确，以及其他无形资产等会计处理不当等问题收到证监会北京监管局警示函。

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	1,405.25
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	1,405.25

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

项目	海睿健行 A	海睿健行 B
报告期期初基金份额总额	20,020,868.70	7,302,338.25
报告期期间基金总申购份额	-	43,710.96
减：报告期期间基金总赎回份额	1,740,115.96	730,528.82
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	18,280,752.74	6,615,520.39

§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

项目	海睿健行 A	海睿健行 B
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	1,090,506.17
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	97,144.85
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	993,361.32
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	3.99

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2024-07-02	6,415.00	2994.52	0.0000
2	赎回	2024-07-12	8738.88	4074.07	0.0000

3	赎回	2024-07-30	4094.33	1826.07	0.0000
4	赎回	2024-08-07	4028.77	1823.02	0.0000
5	赎回	2024-08-12	8200.96	3660.09	0.0000
6	赎回	2024-09-02	4,703.00	2072.61	0.0000
7	赎回	2024-09-04	8506.52	3725.86	0.0000
8	赎回	2024-09-05	12374.71	5404.04	0.0000
9	赎回	2024-09-11	9052.85	3954.28	0.0000
10	赎回	2024-09-18	6,128.00	2611.75	0.0000
11	赎回	2024-09-19	4286.86	1,823.20	0.0000
12	赎回	2024-09-20	4124.12	1,777.50	0.0000
13	赎回	2024-09-23	8,760.00	3758.92	0.0000
14	赎回	2024-09-30	7730.85	3703.85	0.0000
合计			97,144.85	43209.78	

§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 9 月 29 日变更生效。

§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 6 号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《东海证券海睿健行灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；

- 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

2024 年 10 月 25 日