

# 东海祥瑞债券型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 11        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                    | 19        |
| 6.4 报表附注 .....                              | 20        |
| <b>§7 投资组合报告 .....</b>                      | <b>45</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 45        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 45        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....     | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 45        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 46        |
| 7.6 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 .....    | 46        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 46        |
| 7.8 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贵金属投资明细 ..... | 46        |
| 7.9 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 .....    | 46        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 47        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 48        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 48        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....     | 48        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>49</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>50</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 50        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 50        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 50        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 50        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 50        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 50        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 50        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>54</b> |
| 11.1 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 .....    | 54        |

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 54        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 55        |
| 12.2 存放地点.....            | 55        |
| 12.3 查阅方式.....            | 55        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 东海祥瑞债券型证券投资基金    |                 |
| 基金简称            | 东海祥瑞             |                 |
| 场内简称            | -                |                 |
| 基金主代码           | 002381           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2016 年 3 月 24 日  |                 |
| 基金管理人           | 东海基金管理有限责任公司     |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 363,372,522.38 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 基金份额上市的证券交易所    | -                |                 |
| 上市日期            | -                |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 东海祥瑞 A 级         | 东海祥瑞 C 级        |
| 下属分级基金场内简称:     | -                | -               |
| 下属分级基金的交易代码:    | 002381           | 002382          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 302,376,542.50 份 | 60,995,979.88 份 |

### 2.2 基金产品说明

|               |                                                    |          |
|---------------|----------------------------------------------------|----------|
| 投资目标          | 在一定程度上有效控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。        |          |
| 投资策略          | 本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。      |          |
| 业绩比较基准        | 中债综合指数收益率 $\times$ 90%+1 年期定期存款利率(税后) $\times$ 10% |          |
| 风险收益特征        | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。        |          |
|               | 东海祥瑞 A 级                                           | 东海祥瑞 C 级 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | -                                                  | -        |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人               |
|---------|------|---------------------------|---------------------|
| 名称      |      | 东海基金管理有限责任公司              | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 王恒                        | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-60586966              | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | wangheng@donghaifunds.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-9595531               | 95588               |
| 传真      |      | 021-60586926              | 010-66105798        |

|       |                                |                   |
|-------|--------------------------------|-------------------|
| 注册地址  | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室      | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址  | 上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码  | 200122                         | 100140            |
| 法定代表人 | 赵俊                             | 陈四清               |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                      |
|---------------------|----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》              |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.donghaifunds.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人办公地址      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                  | 办公地址                           |
|--------|---------------------|--------------------------------|
| 注册登记机构 | 东海基金管理有限责任公司        | 上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼 |
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层    |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 东海祥瑞 A 级                              | 东海祥瑞 C 级                              |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日) | 报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 14,550,221.75                         | 1,910,190.98                          |
| 本期利润          | 13,139,559.84                         | 1,195,703.42                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0405                                | 0.0217                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.55%                                 | 1.94%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.66%                                 | 3.49%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | 27,553,811.18                         | 4,277,485.75                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0911                                | 0.0701                                |
| 期末基金资产净值      | 348,563,095.92                        | 68,990,752.57                         |
| 期末基金份额净值      | 1.1527                                | 1.1311                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 基金份额累计净值增长率   | 15.27%                                | 13.11%                                |

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、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；

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

(4)本基金基金合同生效日为 2016 年 03 月 24 日。

#### 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

东海祥瑞 A 级

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -0.37%   | 0.12%       | -0.83%     | 0.11%         | 0.46%  | 0.01% |
| 过去三个月 | 0.41%    | 0.14%       | -0.90%     | 0.11%         | 1.31%  | 0.03% |
| 过去六个月 | 3.66%    | 0.13%       | 0.79%      | 0.10%         | 2.87%  | 0.03% |
| 过去一年  | 9.26%    | 0.12%       | 1.84%      | 0.07%         | 7.42%  | 0.05% |
| 过去三年  | 15.73%   | 0.11%       | 5.49%      | 0.06%         | 10.24% | 0.05% |



|                |        |       |       |       |        |       |
|----------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 15.27% | 0.10% | 1.86% | 0.07% | 13.41% | 0.03% |
|----------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|

东海祥瑞 C 级

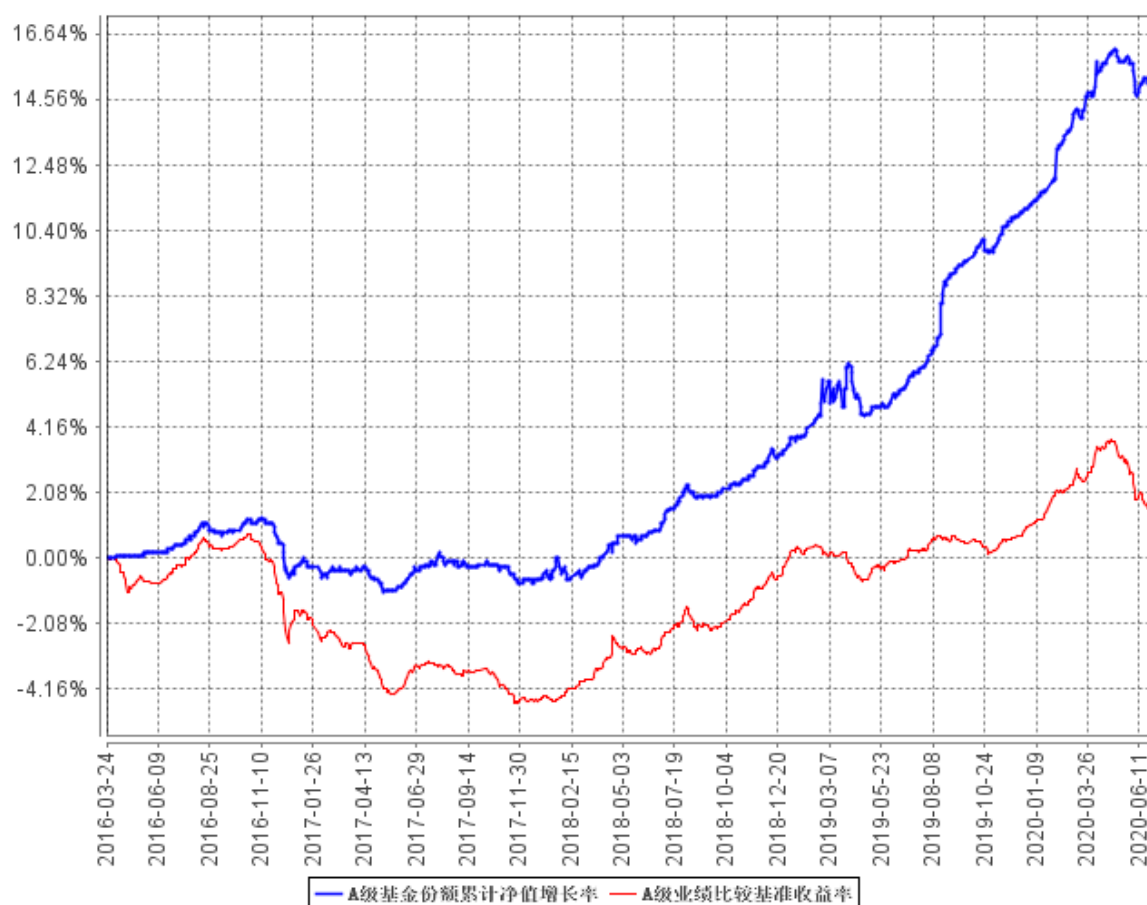
| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | -0.41%       | 0.12%               | -0.83%             | 0.11%                 | 0.42%  | 0.01% |
| 过去三个月          | 0.36%        | 0.13%               | -0.90%             | 0.11%                 | 1.26%  | 0.02% |
| 过去六个月          | 3.49%        | 0.13%               | 0.79%              | 0.10%                 | 2.70%  | 0.03% |
| 过去一年           | 8.86%        | 0.12%               | 1.84%              | 0.07%                 | 7.02%  | 0.05% |
| 过去三年           | 14.37%       | 0.11%               | 5.49%              | 0.06%                 | 8.88%  | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 13.11%       | 0.10%               | 1.86%              | 0.07%                 | 11.25% | 0.03% |

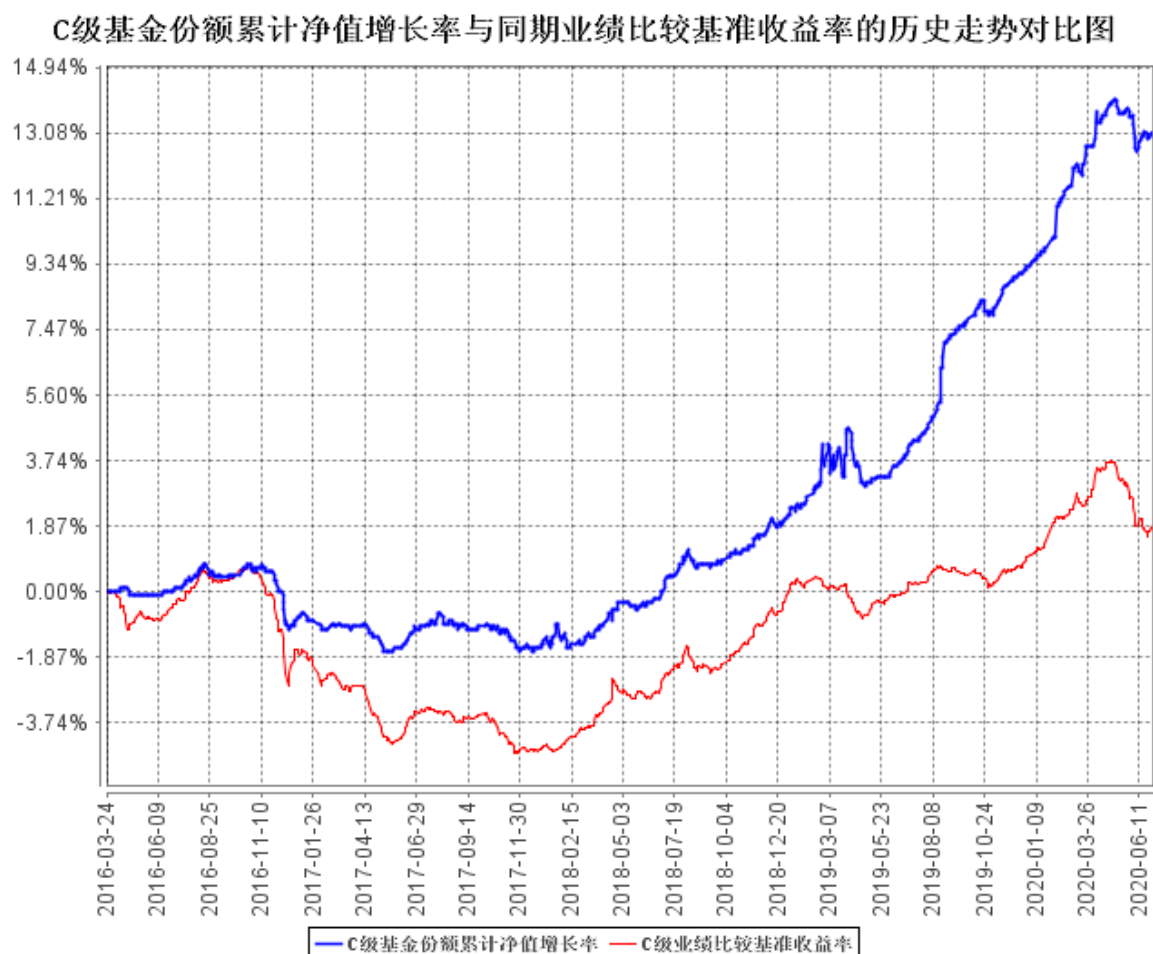
注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金的业绩基准为：中债综合指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级基金份额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）本基金基金合同生效日为 2016 年 3 月 24 日；

（2）本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，但可持有因投资可转换债券转股所形成的股票包括因持有该股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

### 3.3 其他指标

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东海基金管理有限责任公司，2013 年 2 月 25 日正式成立。由东海证券股份有限公司、深圳鹏博实业集团有限公司和苏州市相城区江南化纤集团有限公司共同发起成立。注册地上海，注册资本 1.5 亿元人民币。

公司现有员工 100 人，业务骨干的平均从业年限在十年以上。公司秉承“基金份额持有人利益优先、管理创造价值、品质创造财富”的经营理念，在夯实基础上稳步推进创新发展步伐，努力建设成“运作稳健、专业精良、治理完善、诚信合规”在业内具有影响力的现代资产管理公司。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金、东海祥瑞债券型证券投资基金、东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东海核心价值精选混合型证券投资基金、东海祥利纯债债券型证券投资基金、东海科技动力混合型证券投资基金和东海祥苏短债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|----------|-----------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                      |
| 祝鸿玲 | 本基金的基金经理 | 2016 年 3 月 24 日 | —    | 7 年    | 国籍：中国。政府经济学博士，2008 年进入金融行业，曾任职于中国人民银行六安市中心支行、中国人民银行货币政策司、东海证券股份有限公司基金筹备组等。2013 年 2 月加入东海基金管理有限责任公司。历任东海基金管理有限责任公司研究开发部债券研究员、专户理财部投资经理等职。现任东海基金管理有限责任公司固定收益部负责人，担任东海祥瑞债券型证券投资基金、东海祥利纯债债券型证券投资基金和东海祥苏短债债券型证券投资基金的基金经理。 |

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起

即任职，则任职日期为基金合同生效日；

(2) 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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益的保护工作，建立了严格的投资决策流程和公平交易监控机制，从而保证旗下基金运作的公平。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分，基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况

通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，公司未发现任何违反公平交易的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

公司利用公平交易分析系统，对组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。基金管理人管理的所有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总成交量 5%的交易次数为 0 次。

本报告期内，各组合投资交易未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，新冠肺炎疫情突然爆发并在全球快速蔓延，对全球经济造成了较大的负面冲击，全球资本市场随之出现了大幅波动，我国债券市场也经历了一季度债券收益率快速大幅下行到二季度调整上行的过程。具体来看，宏观政策方面，根据疫情防控和金融形势的变化，我国政府科学部署、积极应对，灵活地把握了宏观政策的逆周期调节力度、节奏和重点，通过实施积极的财政政策和稳健的货币政策，有效地支持了疫情防控工作的开展、复工复产的推进以及金融市场的稳健运行。经济基本面方面，疫情对一季度国内经济造成明显负面影响，经济下行压力较大，但后期随着国内疫情得到有效控制，国内外复工复产加快，以及金融条件的持续改善，二季度国内经济实现了触底反弹。受上述因素影响，我国债券收益率在 1-4 月实现快速下行后，从 5 月开始进入上行阶段，利率债期限利差有所收窄，信用债期限利差涨跌不一，信用利差短端收窄、中长端走阔，其中 1 年、3 年、5 年、7 年和 10 年的国债收益率分别收于 2.18%、2.39%、2.55%、2.82%和 2.82%，较去年年末分别下行 19BP、34BP、34BP、22BP 和 31BP；1 年、3 年、5 年和 7 年的 2A+企业债收益率分别收于 2.91%、3.41%、3.98%和 4.28%，较去年年末分别下 36BP、12BP、2BP 和 9BP。

在上半年的基金运作过程中，我们通过对债券收益率及利差运行方向的专业分析和判断，以信用债的仓位配置为主，同时灵活调整了产品的组合久期和杠杆水平，为客户创造了稳健的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东海祥瑞 A 级基金份额净值为 1.1527 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.66%；截至本报告期末东海祥瑞 C 级基金份额净值为 1.1311 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.49%；同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国政府保持了强大的战略定力，坚持底线思维和改革开放的方向，对于国内外经济形势有着长远和客观的认知，对于国内经济发展有着长远的部署。我们认为后期国内经济将继续处于修复通道之中，宽信用仍是政策的着力点，且新增融资将更多地聚焦于制造业、中小微企业，在此过程中，稳定的货币政策环境非常重要和必要。在宽信用和稳货币的环境下，预计下阶段债市或将延续震荡格局。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由总经理、督察长、投资总监和运营总监及公司相关业务部门工作人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》的约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的 20%；

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未有连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东海祥瑞债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，东海祥瑞债券型证券投资基金的管理人——东海基金管理有限责任公司在东海祥瑞债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东海祥瑞债券型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东海基金管理有限责任公司编制和披露的东海祥瑞债券型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东海祥瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 17,724,785.56                  | 171,298,452.18                   |
| 结算备付金           |            | 16,595.40                      | -                                |
| 存出保证金           |            | 7,469.87                       | 5,706.29                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 524,765,222.98                 | 450,845,341.52                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 524,765,222.98                 | 450,845,341.52                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | 20,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | 50,013,487.67                    |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 10,643,184.86                  | 14,539,100.16                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 50,797.31                      | 111,207,765.02                   |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 553,208,055.98                 | 817,909,852.84                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 123,499,174.75                 | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 11,545,996.69                  | 736,155.29                       |
| 应付管理人报酬         |            | 174,321.13                     | 248,854.64                       |
| 应付托管费           |            | 69,728.47                      | 71,101.32                        |
| 应付销售服务费         |            | 24,918.82                      | 13,624.68                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 52,257.06                      | 28,707.47                        |
| 应交税费            |            | 117,463.29                     | 55,387.41                        |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | 108,998.45     | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 61,348.83      | 30,000.00      |
| 负债合计          |          | 135,654,207.49 | 1,183,830.81   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 363,372,522.38 | 739,131,645.02 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 54,181,326.11  | 77,594,377.01  |
| 所有者权益合计       |          | 417,553,848.49 | 816,726,022.03 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 553,208,055.98 | 817,909,852.84 |

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，东海祥瑞 A 净值 1.1050 元，基金份额总额 302,376,542.50 份；东海祥瑞 C 净值 1.0930 元，基金份额总额 60,995,979.88 份。总份额合计为 363,372,522.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东海祥瑞债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 17,318,622.23                            | 2,551,698.17                                  |
| 1.利息收入                |            | 15,815,614.70                            | 1,699,628.97                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 163,184.47                               | 37,372.37                                     |
| 债券利息收入                |            | 15,526,432.35                            | 1,566,452.34                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | 125,997.88                               | 95,804.26                                     |
| 证券出借利息收入              |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 3,510,709.42                             | -335,652.40                                   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 3,510,709.42                             | -335,652.40                                   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -2,125,149.47                            | 1,186,085.86                                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18   | 117,447.58    | 1,635.74     |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,983,358.97  | 350,638.00   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,386,010.91  | 193,889.17   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 438,199.08    | 55,396.89    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 124,387.66    | 7,680.35     |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 36,843.51     | 5,720.39     |
| 5. 利息支出                    |            | 782,939.68    | 65,910.60    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | 65,910.60    |
| 6. 税金及附加                   |            | 53,916.83     | 5,280.21     |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 161,061.30    | 16,760.39    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 14,335,263.26 | 2,201,060.17 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 14,335,263.26 | 2,201,060.17 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海祥瑞债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                 |
|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|-----------------|
|                                   | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 739,131,645.02                        | 77,594,377.01  | 816,726,022.03  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | 14,335,263.26  | 14,335,263.26   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -375,759,122.64                       | -37,748,314.16 | -413,507,436.80 |
| 其中：1.基金申购款                        | 269,341,469.67                        | 35,166,180.74  | 304,507,650.41  |
| 2. 基金赎回款                          | -645,100,592.31                       | -72,914,494.90 | -718,015,087.21 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的               | -                                     | -              | -               |

|                                        |                                            |               |                |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|---------------|----------------|
| 基金净值变动(净值减少以“-”号填列)                    |                                            |               |                |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 363,372,522.38                             | 54,181,326.11 | 417,553,848.49 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |               |                |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 11,553,460.27                              | 289,124.74    | 11,842,585.01  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 2,201,060.17  | 2,201,060.17   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 287,522,523.53                             | 13,892,992.20 | 301,415,515.73 |
| 其中：1.基金申购款                             | 293,559,647.54                             | 14,055,340.03 | 307,614,987.57 |
| 2.基金赎回款                                | -6,037,124.01                              | -162,347.83   | -6,199,471.84  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                          | -             | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 299,075,983.80                             | 16,383,177.11 | 315,459,160.91 |

注：此财务报表已获东海基金管理有限责任公司批准。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| <u>赵俊</u> | <u>邓升军</u> | <u>刘宇</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东海祥瑞债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]18 号文准予注册募集，由基金管理人东海基金管理有限责任公司于 2016 年 02 月 22 日至 2016 年 03 月 21 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字第 61047315\_B03 号验资报告后，向中国证

监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 03 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。募集期间净认购金额为人民币 665,036,434.61 元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币 117,296.10 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 665,153,730.71 元，合计募集份额为 665,153,730.71 份。本基金的基金管理人为东海基金管理有限责任公司，注册登记机构为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，但可持有因投资可转换债券转股所形成的股票包括因持有该股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率 $\times$ 90%+1 年期定期存款利率（税后） $\times$ 10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 06 月 30 日的财务状况、2020 年半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴

纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 17,724,785.56          |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 17,724,785.56          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                |              |
|---------------|-------|------------------------|----------------|--------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                      | -              | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 100,597,816.12         | 103,635,222.98 | 3,037,406.86 |
|               | 银行间市场 | 417,060,813.32         | 421,130,000.00 | 4,069,186.68 |
|               | 合计    | 517,658,629.44         | 524,765,222.98 | 7,106,593.54 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -              | -            |
| 基金            |       | -                      | -              | -            |
| 其他            |       | -                      | -              | -            |
| 合计            |       | 517,658,629.44         | 524,765,222.98 | 7,106,593.54 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有任何衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,122.40               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 7.50                   |
| 应收债券利息     | 10,624,343.44          |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | 17,708.22              |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | 3.30                   |
| 合计         | 10,643,184.86          |



注：其他列示的是应收交易保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 45,116.63              |
| 银行间市场应付交易费用 | 7,140.43               |
| 合计          | 52,257.06              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 4.51                   |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 61,344.32              |
| 合计          | 61,348.83              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 东海祥瑞 A 级      |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 457,348,802.18                        | 457,348,802.18  |
| 本期申购          | 145,070,603.79                        | 145,070,603.79  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -300,042,863.47                       | -300,042,863.47 |
| — 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -               |
| 本期末           | 302,376,542.50                        | 302,376,542.50  |

金额单位：人民币元

| 东海祥瑞 C 级      |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 281,782,842.84                        | 281,782,842.84  |
| 本期申购          | 124,270,865.88                        | 124,270,865.88  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -345,057,728.84                       | -345,057,728.84 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -               |
| 本期末           | 60,995,979.88                         | 60,995,979.88   |

注：本期申购含转换入份额，本期赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 东海祥瑞 A 级       |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 20,778,441.92  | 30,501,380.98  | 51,279,822.90  |
| 本期利润           | 14,550,221.75  | -1,410,661.91  | 13,139,559.84  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -7,774,852.49  | -10,457,976.83 | -18,232,829.32 |
| 其中：基金申购款       | 8,577,180.67   | 10,796,758.17  | 19,373,938.84  |
| 基金赎回款          | -16,352,033.16 | -21,254,735.00 | -37,606,768.16 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 27,553,811.18  | 18,632,742.24  | 46,186,553.42  |

单位：人民币元

| 东海祥瑞 C 级       |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 7,749,496.83   | 18,565,057.28  | 26,314,554.11  |
| 本期利润           | 1,910,190.98   | -714,487.56    | 1,195,703.42   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,382,202.06  | -14,133,282.78 | -19,515,484.84 |
| 其中：基金申购款       | 6,462,679.84   | 9,329,562.06   | 15,792,241.90  |
| 基金赎回款          | -11,844,881.90 | -23,462,844.84 | -35,307,726.74 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 4,277,485.75   | 3,717,286.94   | 7,994,772.69   |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 158,228.87                            |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 4,903.04                              |
| 其他        | 52.56                                 |
| 合计        | 163,184.47                            |

注：其他列示的是交易保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,510,709.42               |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | 3,510,709.42               |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 407,005,987.97             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 392,040,501.04             |
| 减：应收利息总额                | 11,454,777.51              |
| 买卖债券差价收入                | 3,510,709.42               |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金报告期末债券投资收益—赎回价差收入为零。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金报告期末债券投资收益—申购差价收入为零。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无衍生工具—其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -2,125,149.47                         |

|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| ——股票投资                     | -             |
| ——债券投资                     | -2,125,149.47 |
| ——资产支持证券投资                 | -             |
| ——贵金属投资                    | -             |
| ——其他                       | -             |
| 2. 衍生工具                    | -             |
| ——权证投资                     | -             |
| 3. 其他                      | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -             |
| 合计                         | -2,125,149.47 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 117,447.58                            |
| 合计      | 117,447.58                            |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 28,556.01                             |
| 银行间市场交易费用 | 8,287.50                              |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 36,843.51                             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 31,671.98                             |
| 信息披露费 | 59,672.34                             |

|         |            |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | -          |
| 银行费用    | 10,716.98  |
| 律师费     | 40,000.00  |
| 持有人大会费用 | 10,000.00  |
| 银行间交易费用 | 4,500.00   |
| 其他费用    | 4,500.00   |
| 合计      | 161,061.30 |

#### 6.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称            | 与本基金的关系             |
|------------------|---------------------|
| 东海基金管理有限责任公司     | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 东海证券股份有限公司       | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 深圳鹏博实业集团有限公司     | 基金管理人的股东            |
| 苏州市相城区江南化纤集团有限公司 | 基金管理人的股东            |
| 中国工商银行股份有限公司     | 基金托管人、基金代销机构        |
| 东海瑞京资产管理（上海）有限公司 | 基金管理人的子公司           |

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方的交易单元进行过股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                  |
|------------|---------------------------------------|------------------|--------------------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东海证券股份有限公司 | 9,571,095.89                          | 5.44%            | 0.00                                       | 0.00%            |

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日      |                |          |                  |
|------------|--------------------------------------------|----------------|----------|------------------|
|            | 当期佣金                                       | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东海证券股份有限公司 | 1,961.24                                   | 7.17%          | 4,043.57 | 8.96%            |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                |          |                  |
|            | 当期佣金                                       | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东海证券股份有限公司 | 0.00                                       | 0.00%          | 187.85   | 4.29%            |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用东海证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从东海证券获得证券研究综合服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|--------------------------------------------|
|----|---------------------------------------|--------------------------------------------|

|                 |              |            |
|-----------------|--------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,386,010.91 | 193,889.17 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 56,632.91    | 9,207.42   |

注：（1）支付基金管理人东海基金管理有限责任公司的基金管理费自 2016 年 03 月 24 日至 2020 年 04 月 28 日，按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数；

（2）支付基金管理人东海基金管理有限责任公司的基金管理费自 2020 年 04 月 29 日起，按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数；

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 438,199.08                            | 55,396.89                                  |

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           |           |
|----------------|---------------------------------------|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                      |           |           |
|                | 东海祥瑞 A 级                              | 东海祥瑞 C 级  | 合计        |
| 中国工商银行股份有限公司   | -                                     | 8,642.77  | 8,642.77  |
| 东海证券股份有限公司     | -                                     | 115.75    | 115.75    |
| 东海基金管理有限责任公司   | -                                     | 74,175.82 | 74,175.82 |
| 合计             | -                                     | 82,934.34 | 82,934.34 |
| 获得销售服务费的       | 上年度可比期间                               |           |           |



| 各关联方名称       | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |          |          |
|--------------|---------------------------------|----------|----------|
|              | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |          |          |
|              | 东海祥瑞 A 级                        | 东海祥瑞 C 级 | 合计       |
| 中国工商银行股份有限公司 | -                               | 5,182.92 | 5,182.92 |
| 东海证券股份有限公司   | -                               | 514.78   | 514.78   |
| 东海基金管理有限责任公司 | -                               | 1,344.10 | 1,344.10 |
| 合计           | -                               | 7,041.80 | 7,041.80 |

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期                              |          |
|---------------------------------|---------------------------------|----------|
|                                 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |          |
|                                 | 东海祥瑞 A 级                        | 东海祥瑞 C 级 |
| 基金合同生效日（2016 年 3 月 24 日）持有的基金份额 | -                               | -        |
| 报告期初持有的基金份额                     | 1,945,307.67                    | -        |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                               | -        |

|                     |              |   |
|---------------------|--------------|---|
| 报告期间因拆分变动份额         | -            | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -            | - |
| 报告期末持有的基金份额         | 1,945,307.67 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.5353%      | - |

| 项目                              | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |          |
|---------------------------------|--------------------------------------------|----------|
|                                 | 东海祥瑞 A 级                                   | 东海祥瑞 C 级 |
| 基金合同生效日（2016 年 3 月 24 日）持有的基金份额 | -                                          | -        |
| 报告期初持有的基金份额                     | 1,945,307.67                               | -        |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                                          | -        |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                                          | -        |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -                                          | -        |
| 报告期末持有的基金份额                     | 1,945,307.67                               | -        |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.6504%                                    | -        |

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |           |
|--------------|---------------------------------------|------------|--------------------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                                  | 当期利息收入     | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 17,724,785.56                         | 158,228.87 | 31,453,245.23                              | 36,665.34 |

注：本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2020 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 16,595.4 元。（2019 年 06 月 30 日：人民币 414,690.34 元）

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称           | 回购到期日           | 期末估值单价 | 数量（张）      | 期末估值总额        |
|-----------|----------------|-----------------|--------|------------|---------------|
| 102000428 | 20 潞安 MTN001   | 2020 年 7 月 8 日  | 101.49 | 100,000.00 | 10,149,000.00 |
| 1980158   | 19 贾旅 02       | 2020 年 7 月 3 日  | 103.31 | 300,000.00 | 30,993,000.00 |
| 101801105 | 18 大同煤矿 MTN006 | 2020 年 7 月 8 日  | 104.00 | 300,000.00 | 31,200,000.00 |
| 101900760 | 19 平煤化 MTN004  | 2020 年 7 月 8 日  | 100.04 | 300,000.00 | 30,012,000.00 |
| 101900180 | 19 盐城交通 MTN001 | 2020 年 7 月 13 日 | 105.13 | 200,000.00 | 21,026,000.00 |
| 2080102   | 20 井开债         | 2020 年 7 月      | 98.06  | 300,000.00 | 29,418,000.00 |

|    |  |     |  |             |                   |
|----|--|-----|--|-------------|-------------------|
|    |  | 3 日 |  |             |                   |
| 合计 |  |     |  | 1, 500, 000 | 152, 798, 000. 00 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规与风险管理委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部对公司运作各环节的各类风险进行监控。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 22,868,400.00          | 50,015,000.00            |
| 合计     | 22,868,400.00          | 50,015,000.00            |

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 143,312,937.70         | 154,346,427.40           |
| AAA 以下 | 358,230,396.80         | 186,100,900.20           |
| 未评级    | 353,488.48             | 60,383,013.92            |
| 合计     | 501,896,822.98         | 400,830,341.52           |

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，建立流动性风险监控与预警机制，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金

通过预留一定现金头寸，并且可在需要通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持有的证券在证券交易所及银行间上市交易。本报告期末，除完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。本报告期末，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本<br>期<br>末<br>2020<br>年 6<br>月<br>30<br>日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------------------------|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|
| 资产                                         |        |        |          |       |       |     |    |

|           |                |               |                |                |                |                 |                |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|----------------|
| 银行存款      | 17,724,785.56  | -             | -              | -              | -              | -               | 17,724,785.56  |
| 结算备付金     | 16,595.40      | -             | -              | -              | -              | -               | 16,595.40      |
| 存出保证金     | 7,469.87       | -             | -              | -              | -              | -               | 7,469.87       |
| 交易性金融资产   | -9,013.50      | 53,983,776.60 | 284,828,932.88 | 185,943,500.00 | -              | -524,765,222.98 |                |
| 应收利息      | -              | -             | -              | -              | -10,643,184.86 | -               | 10,643,184.86  |
| 应收申购款     | -              | -             | -              | -              | -              | 50,797.31       | 50,797.31      |
| 资产总计      | 17,748,850.83  | 9,013.50      | 53,983,776.60  | 284,828,932.88 | 185,943,500.00 | 10,693,982.17   | 553,208,055.98 |
| 负债        |                |               |                |                |                |                 |                |
| 卖出回购金融资产款 | 123,499,174.75 | -             | -              | -              | -              | -               | 123,499,174.75 |
| 应付赎回款     | -              | -             | -              | -              | -              | -11,545,996.69  | 11,545,996.69  |
| 应付管理人报酬   | -              | -             | -              | -              | -              | 174,321.13      | 174,321.13     |
| 应付托管费     | -              | -             | -              | -              | -              | 69,728.47       | 69,728.47      |
| 应付销售服务费   | -              | -             | -              | -              | -              | 24,918.82       | 24,918.82      |
| 应付交易费用    | -              | -             | -              | -              | -              | 52,257.06       | 52,257.06      |
| 应付利息      | -              | -             | -              | -              | -              | 108,998.45      | 108,998.45     |



|                                |                 |          |               |                |                |               |                |
|--------------------------------|-----------------|----------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 应交税费                           | -               | -        | -             | -              | -              | 117,463.29    | 117,463.29     |
| 其他负债                           | -               | -        | -             | -              | -              | 61,348.83     | 61,348.83      |
| 负债总计                           | 123,499,174.75  | -        | -             | -              | -              | 12,155,032.74 | 135,654,207.49 |
| 利率敏感度缺口                        | -105,750,323.92 | 9,013.50 | 53,983,776.60 | 284,828,932.88 | 185,943,500.00 | -1,461,050.57 | 417,553,848.49 |
| 上年度末<br>2019 年<br>12 月<br>31 日 | 1 个月以内          | 1-3 个月   | 3 个月-1 年      | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息           | 合计             |
| 资产                             |                 |          |               |                |                |               |                |
| 银行存款                           | 171,298,452.18  | -        | -             | -              | -              | -             | 171,298,452.18 |
| 存出保证金                          | 5,706.29        | -        | -             | -              | -              | -             | 5,706.29       |
| 交易性金融资产                        | 60,025,000.00   | -        | 49,848,505.08 | 217,519,696.84 | 123,452,139.60 | -             | 450,845,341.52 |
| 买入返售金融资产                       | 20,000,000.00   | -        | -             | -              | -              | -             | 20,000,000.00  |
| 应收证券清算款                        | -               | -        | -             | -              | -              | 50,013,487.67 | 50,013,487.67  |
| 应收利息                           | -               | -        | -             | -              | -              | 14,539,100.16 | 14,539,100.16  |
| 应收申购款                          | 111,000,000.00  | -        | -             | -              | -              | 207,765.02    | 111,207,765.02 |
| 其他资产                           | -               | -        | -             | -              | -              | -             | -              |
| 资产                             | 362,329,158.47  | -        | 49,848,505.08 | 217,519,696.84 | 123,452,139.60 | 64,760,352.85 | 817,909,852.84 |

|                     |                |                |                |                |               |                |              |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|--------------|
| 总计                  |                |                |                |                |               |                |              |
| 负债                  |                |                |                |                |               |                |              |
| 应付<br>赎回<br>款       | -              | -              | -              | -              | -             | 736,155.29     | 736,155.29   |
| 应付<br>管理人报<br>酬     | -              | -              | -              | -              | -             | 248,854.64     | 248,854.64   |
| 应付<br>托管费           | -              | -              | -              | -              | -             | 71,101.32      | 71,101.32    |
| 应付<br>销售服<br>务费     | -              | -              | -              | -              | -             | 13,624.68      | 13,624.68    |
| 应付<br>交易<br>费用      | -              | -              | -              | -              | -             | 28,707.47      | 28,707.47    |
| 应交<br>税费            | -              | -              | -              | -              | -             | 55,387.41      | 55,387.41    |
| 其他<br>负债            | -              | -              | -              | -              | -             | 30,000.00      | 30,000.00    |
| 负债<br>总计            | -              | -              | -              | -              | -             | 1,183,830.81   | 1,183,830.81 |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口 | 362,329,158.47 | -49,848,505.08 | 217,519,696.84 | 123,452,139.60 | 63,576,522.04 | 816,726,022.03 |              |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                                        |                                 |                        |
|----|------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                                           |                                 |                        |
|    | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；                     |                                 |                        |
|    | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                                    |                                 |                        |
|    | 银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。 |                                 |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                                              | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                                                        | 本期末（2020 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |

|  |               |                  |                  |
|--|---------------|------------------|------------------|
|  | 市场利率减少 25 个基点 | 3, 002, 086. 59  | 2, 073, 892. 02  |
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -2, 971, 251. 74 | -2, 053, 194. 66 |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | -                      | -                        | -                        | -                     |

|               |                |        |                |       |
|---------------|----------------|--------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—基金投资  | -              | -      | -              | -     |
| 交易性金融资产—债券投资  | 524,765,222.98 | 125.68 | 450,845,341.52 | 55.20 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -              | -      | -              | -     |
| 衍生金融资产—权证投资   | -              | -      | -              | -     |
| 其他            | -              | -      | -              | -     |
| 合计            | 524,765,222.98 | 125.68 | 450,845,341.52 | 55.20 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -             |
|    | 其中：股票             | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 524,765,222.98 | 94.86         |
|    | 其中：债券             | 524,765,222.98 | 94.86         |
|    | 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      | 17,741,380.96  | 3.21          |
| 8  | 其他各项资产            | 10,701,452.04  | 1.93          |
| 9  | 合计                | 553,208,055.98 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均无股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均无股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无股票投资。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 18,205,874.98  | 4.36         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 9,013.50       | 0.00         |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,013.50       | 0.00         |
| 4  | 企业债券      | 225,970,334.50 | 54.12        |
| 5  | 企业短期融资券   | 5,007,000.00   | 1.20         |
| 6  | 中期票据      | 275,573,000.00 | 66.00        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 524,765,222.98 | 125.68       |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101900180 | 19 盐城交通 MTN001 | 300,000 | 31,539,000.00 | 7.55         |
| 2  | 101801105 | 18 大同煤矿 MTN006 | 300,000 | 31,200,000.00 | 7.47         |
| 3  | 101900587 | 19 德阳经开 MTN001 | 300,000 | 31,101,000.00 | 7.45         |
| 4  | 1980158   | 19 贾旅 02       | 300,000 | 30,993,000.00 | 7.42         |
| 5  | 1980161   | 19 鞍山旺通债       | 300,000 | 30,765,000.00 | 7.37         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金暂不投资国债期货。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 7,469.87      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,643,184.86 |
| 5  | 应收申购款   | 50,797.31     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 10,701,452.04 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.11.6 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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别         | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构             |            |                  |            |
|------------------|------------------|---------------|-------------------|------------|------------------|------------|
|                  |                  |               | 机构投资者             |            | 个人投资者            |            |
|                  |                  |               | 持有份额              | 占总份额比<br>例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 东 海<br>祥瑞 A<br>级 | 368              | 821, 675. 39  | 290, 543, 843. 78 | 96. 09%    | 11, 832, 698. 72 | 3. 91%     |
| 东 海<br>祥瑞 C<br>级 | 445              | 137, 069. 62  | 45, 603, 811. 72  | 74. 77%    | 15, 392, 168. 16 | 25. 23%    |
| 合计               | 813              | 446, 952. 67  | 336, 147, 655. 50 | 92. 51%    | 27, 224, 866. 88 | 7. 49%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别        | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额<br>比例 |
|----------------------|-------------|--------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 东海祥瑞<br>A 级 | 246, 980. 87 | 0. 0817%     |
|                      | 东海祥瑞<br>C 级 | 65, 209. 61  | 0. 1069%     |
|                      | 合计          | 312, 190. 48 | 0. 0859%     |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                     | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|----------------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金<br>投资和研究部门负责人持<br>有本开放式基金 | 东海祥瑞 A 级 | 10~50             |
|                                        | 东海祥瑞 C 级 | 0                 |
|                                        | 合计       | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开<br>放式基金                    | 东海祥瑞 A 级 | 10~50             |
|                                        | 东海祥瑞 C 级 | 0                 |
|                                        | 合计       | 10~50             |



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 东海祥瑞 A 级       | 东海祥瑞 C 级       |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 3 月 24 日）基金份额总额 | 84,938,991.87  | 580,214,738.84 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 457,348,802.18 | 281,782,842.84 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 145,070,603.79 | 124,270,865.88 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 300,042,863.47 | 345,057,728.84 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 302,376,542.50 | 60,995,979.88  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，表决期限为自 2020 年 3 月 30 日起，至 2020 年 4 月 27 日 17:00 止。根据基金份额持有人大会于 2020 年 4 月 28 日表决通过的《关于修改东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金管理人东海基金管理有限责任公司于 2020 年 4 月 29 日发布了《东海基金管理有限责任公司关于东海祥瑞债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。根据《关于修改东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，经与基金托管人协商一致，基金管理人修订了《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》、《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》，并据此更新了《东海祥瑞债券型证券投资基金招募说明书》。修订后的上述文件于 2020 年 4 月 29 日起生效。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人 2020 年 4 月 20 日发布公告，自 2020 年 4 月 17 日起新任苏尚才先生为基金管理人副总经理。
- 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 广发证券 | 2      | -    | -            | 2,559.49  | 9.36%      | -  |
| 长江证券 | 1      | -    | -            | 8,839.63  | 32.33%     | -  |
| 银河证券 | 1      | -    | -            | 8,478.17  | 31.01%     | -  |

|      |   |   |   |          |        |   |
|------|---|---|---|----------|--------|---|
| 恒泰证券 | 2 | - | - | 5,094.01 | 18.63% | - |
| 东海证券 | 2 | - | - | 1,961.24 | 7.17%  | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | -        | -      | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | -        | -      | - |
| 中航证券 | 2 | - | - | -        | -      | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | -        | -      | - |
| 华鑫证券 | 2 | - | - | -        | -      | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | -        | -      | - |
| 宏源证券 | 2 | - | - | 410.33   | 1.50%  | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2) 中央交易室与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3) 基金业务部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 广发证券 | 24,770,684.93 | 14.08%       | 34,000,000.00  | 8.52%          | -    | -            |
| 长江证券 | 43,656,451.07 | 24.82%       | 5,000,000.00   | 1.25%          | -    | -            |
| 银河证券 | 45,383,665.80 | 25.81%       | -              | -              | -    | -            |
| 恒泰证券 | 25,200,700.00 | 14.33%       | 330,000,000.00 | 82.71%         | -    | -            |
| 东海证券 | 9,571,095.89  | 5.44%        | -              | -              | -    | -            |
| 德邦证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

|      |                  |         |                  |        |   |   |
|------|------------------|---------|------------------|--------|---|---|
| 中航证券 | -                | -       | -                | -      | - | - |
| 海通证券 | -                | -       | -                | -      | - | - |
| 华鑫证券 | -                | -       | -                | -      | - | - |
| 华创证券 | -                | -       | -                | -      | - | - |
| 宏源证券 | 27, 287, 327. 67 | 15. 52% | 30, 000, 000. 00 | 7. 52% | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                                    | 法定披露方式       | 法定披露日期          |
|----|-------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
| 1  | 《关于提高东海祥瑞债券型证券投资基金净值精度的公告》                                              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 1 月 7 日  |
| 2  | 《东海基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》、《东海祥瑞债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 1 月 17 日 |
| 3  | 《东海基金管理有限责任公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修订旗下基金基金合同的公告》                     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 1 月 22 日 |
| 4  | 《关于提高东海祥瑞债券型证券投资基金净值精度的公告》                                              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 2 月 5 日  |
| 5  | 《东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司开通基金定投业务及开展费率优惠活动的公告》               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 2 月 22 日 |
| 6  | 《东海基金管理有限责任公司关于不法分子冒用我司名义的澄清公告》                                         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 3 月 6 日  |
| 7  | 《东海基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》                                  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 3 月 25 日 |
| 8  | 《东海基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开东海祥瑞债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》                        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 3 月 26 日 |
| 9  | 《东海基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开东海祥瑞债券型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提                        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 3 月 27 日 |

|    |                                                                                                                                                                         |              |                 |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
|    | 示性公告》                                                                                                                                                                   |              |                 |
| 10 | 《东海基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开东海祥瑞债券型证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性公告》                                                                                                                   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 3 月 28 日 |
| 11 | 《东海基金管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》                                                                                                                       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 4 月 4 日  |
| 12 | 《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增大连网金基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告》                                                                                                                       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 4 月 14 日 |
| 13 | 《东海基金管理有限责任公司副总经理任职的公告》                                                                                                                                                 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 4 月 20 日 |
| 14 | 《东海基金管理有限责任公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》、《东海祥瑞债券型证券投资基金 2019 年年度报告》                                                                                                         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 15 | 《东海基金管理有限责任公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》、《东海祥瑞债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》                                                                                                 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 4 月 22 日 |
| 16 | 《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》、《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》、《东海祥瑞债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 1 号）》、《东海祥瑞债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 1 号）》、《东海基金管理有限责任公司关于东海祥瑞债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2020 年 4 月 29 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

| 投资者类别                                                                       | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                 |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|                                                                             | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间         | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构                                                                          | 1              | 2020 年 2 月 5 日至 2020 年 6 月 30 日 | 85,875,954.20 | 0.00 | 0.00 | 85,875,954.20 | 23.63% |
| 个人                                                                          | —              | —                               | —             | —    | —    | —             | —      |
| 产品特有风险                                                                      |                |                                 |               |      |      |               |        |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                                 |               |      |      |               |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海祥瑞债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东海祥瑞债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

东海基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 29 日