# 东海科技动力混合型证券投资基金
# 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 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。本年度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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录.....2**
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
**§2 基金简介.....5**
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....7
2.4 信息披露方式.....7
2.5 其他相关资料.....8
**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....9**
3.1 主要会计数据和财务指标.....9
3.2 基金净值表现.....12
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....14
**§4 管理人报告.....15**
4.1 基金管理人及基金经理情况.....15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....16
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.....17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....19
4.9 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.....19
**§5 托管人报告.....20**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....20
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.....20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....20
**§6 审计报告.....21**
6.1 审计报告基本信息.....21
6.2 审计报告的基本内容.....21
**§7 年度财务报表.....24**
7.1 资产负债表.....24
7.2 利润表.....25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....26
7.4 报表附注.....27
**§8 投资组合报告.....52**
8.1 期末基金资产组合情况.....52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....52
8.3 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.....53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....59
8.6 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.....59
8.7 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.....59

8.8 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 ..... 59
8.9 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 ..... 59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 60
8.12 投资组合报告附注 ..... 60
**§9 基金份额持有人信息 ..... 62**
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 62
9.3 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 ..... 62
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... 62
**§10 开放式基金份额变动 ..... 63**
**§11 重大事件揭示 ..... 64**
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 64
11.2 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 ..... 64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 64
11.4 基金投资策略的改变 ..... 64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 64
11.8 其他重大事件 ..... 65
**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 69**
12.1 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 ..... 69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 69
**§13 备查文件目录 ..... 70**
13.1 备查文件目录 ..... 70
13.2 存放地点 ..... 70
13.3 查阅方式 ..... 70

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 东海科技动力混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 东海科技动力 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 007439 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 6 月 26 日 | |
| 基金管理人 | 东海基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 江苏银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 18,168,366.49 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： | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C |
| 下属分级基金的场内简称： | - | - |
| 下属分级基金的交易代码： | 007439 | 007463 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,968,731.01 份 | 12,199,635.48 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金重点投资于具备以科技和创新为动力和支撑，具有核心科技优势或创新优势的优质上市公司，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 在历经多年的高速增长之后，中国经济的转型升级已成为必然。科技是第一生产力；从量变到质变，科技肩负的重任不言而喻。信息产业、新能源及新材料、生命科学及生物工程、高端及智能制造等，承载着新经济的发展动能，更可称之为未来国之竞争本源。因此，立足本土的科技动力型企业发展势必成为关键。本基金将挖掘这一主题机会，伴随中国经济迈上新台阶之余，为投资者带来长期稳定的价值增值。<br>1、大类资产配置策略<br>本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。<br><br>2、股票投资策略<br>（1）科技动力主题的界定<br>本基金所指的科技动力主题是指，主要包含以下两个层面：<br>1）以科学技术为核心，在主营业务架构和价值链中科技因素占主导地位的高 |

| | |
|---|---|
| | 新技术产业，如信息技术、通信技术、新能源、新材料、国防军工、智能家居、汽车、工业互联、高端制造、生物医药等及其他实现技术升级的先进制造业等。<br>2）传统行业中依靠科技驱动进行技术创新、专利发明、激励模式、设计流程、营销模式、产业链的整合优化带来对行业和公司的技术、制度、管理、服务、商业模式等方面的演进，达到降低生产成本并提高生产效率，开创新的产业领域、服务或者产品，增强企业盈利能力的目的，如新零售、文创旅游、金融科技、农业科技等。本基金将聚焦于有创新优势的行业和企业，分享创新带来的投资机会。<br>随着科技不断发展、创新持续涌现，在经济转型的大背景下，以科技为动力和支撑，掌握核心科技优势的科技创新型上市公司将迎来全新的发展机遇。<br>本基金将按照以上标准所确定的“科技动力”概念，适时对科技动力的涵盖范围进行动态调整，将相关上市公司纳入本基金主题的界定范围内。<br><br>（2）行业配置<br>科技动力主题项下，各细分行业领域之间在配置比例方面不设限制。<br>（3）个股选择<br>本基金将结合定量与定性分析，选择科技动力主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。<br>定量分析：<br>本基金将对反映上市公司价值和成长潜力的主要财务和估值指标进行定量分析，在对上市公司盈利增长前景进行分析时，本基金将充分利用上市公司的财务数据，通过上市公司的成长能力指标进行量化筛选，主要通过三个指标选择股票组合。<br>（a）成长指标：营业收入增长率、净利润增长率。<br>（b）估值指标：市盈率、市盈率/净利增长率。<br>（c）财务指标：净资产收益率、资产负债率、毛利率、净利率。<br>定性分析：<br>本基金在定量分析选取出的股票基础上，通过进一步定性分析，从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行进一步的精选。<br>（a）持续成长性的分析。通过对上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入研究，评估具有持续成长能力的上市公司。<br>（b）在市场前景方面，需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、开拓市场、进而创造利润增长的能力。<br>（c）公司治理结构的优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基金将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结构进行评价。<br><br>3、债券投资策略<br>基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。<br>本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。 |

| | | |
|---|---|---|
| | 4、股指期货投资策略<br>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。<br>基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。<br>5、资产支持证券投资策略<br>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。 | |
| | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C |
| 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 | 江苏银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王恒 | 周宏 |
| | 联系电话 | 021-60586966 | 025-58588217 |
| | 电子邮箱 | wangheng@donghaifunds.com | Zhouhong1@jsbchina.cn |
| 客户服务电话 | | 400-9595531 | 95319 |
| 传真 | | 021-60586926 | 025-58588155 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室 | 江苏省南京市中华路 26 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 | 江苏省南京市中华路 26 号 |
| 邮政编码 | | 200122 | 210001 |
| 法定代表人 | | 严晓珺 | 夏平 |

## 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》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | https://www.donghaifunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
| --- | --- | --- |
| 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 |
| 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 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年 | | 2020 年 | | 2019 年 6 月 26 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C |
| 本期已实现收益 | 3,491,452.47 | 4,389,816.84 | 5,501,124.88 | 8,215,690.50 | 693,446.58 | 895,762.37 |
| 本期利润 | 1,088,700.02 | 3,143,797.73 | 6,355,728.30 | 10,880,605.80 | 1,826,255.83 | 2,534,317.51 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1420 | 0.3163 | 0.5499 | 0.6190 | 0.1282 | 0.0461 |
| 本期加权平均 | 7.10% | 15.97% | 35.13% | 41.14% | 12.38% | 4.55% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 净值利润率 | | | | | | |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.94% | 7.99% | 64.85% | 63.02% | 16.50% | 15.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 5,989,626.58 | 11,773,271.64 | 5,918,621.02 | 6,664,509.52 | 564,320.96 | 788,313.13 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0035 | 0.9651 | 0.6064 | 0.5742 | 0.0781 | 0.0700 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 期末基金资产净值 | 12,373,342.40 | 24,841,224.54 | 18,745,498.93 | 21,882,512.59 | 8,413,588.63 | 13,019,903.38 |
| 期末基金份额净值 | 2.0730 | 2.0362 | 1.9205 | 1.8855 | 1.1650 | 1.1566 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 107.30% | 103.62% | 92.05% | 88.55% | 16.50% | 15.66% |

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)本基金合同生效日为 2019 年 6 月 26 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

东海科技动力 A

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 7.43% | 1.57% | 1.85% | 0.54% | 5.58% | 1.03% |
| 过去六个月 | 4.73% | 1.79% | -1.01% | 0.70% | 5.74% | 1.09% |
| 过去一年 | 7.94% | 1.68% | 0.97% | 0.81% | 6.97% | 0.87% |
| 自基金合同生效起至今 | 107.30% | 1.65% | 29.01% | 0.90% | 78.29% | 0.75% |

东海科技动力 C

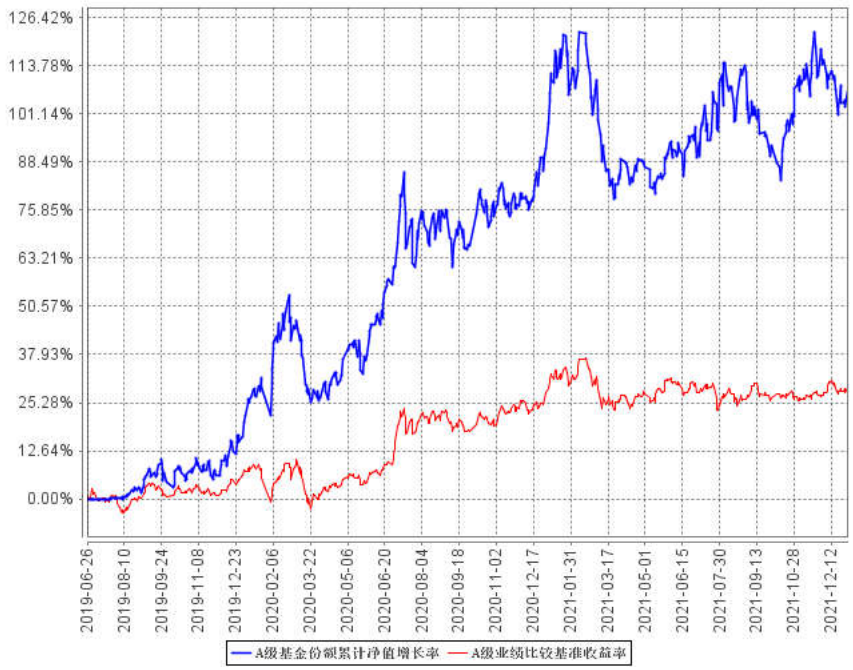
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 7.55% | 1.57% | 1.85% | 0.54% | 5.70% | 1.03% |
| 过去六个月 | 4.89% | 1.79% | -1.01% | 0.70% | 5.90% | 1.09% |
| 过去一年 | 7.99% | 1.68% | 0.97% | 0.81% | 7.02% | 0.87% |
| 自基金合同生效起至今 | 103.62% | 1.65% | 29.01% | 0.90% | 74.61% | 0.75% |

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；

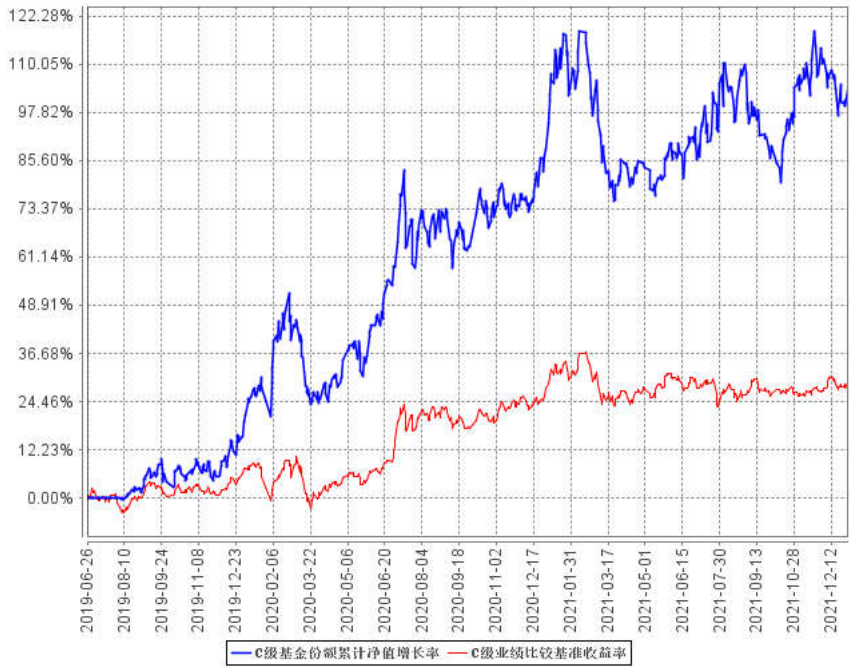
(2)本基金的业绩基准为：中证 800 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%。

### 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

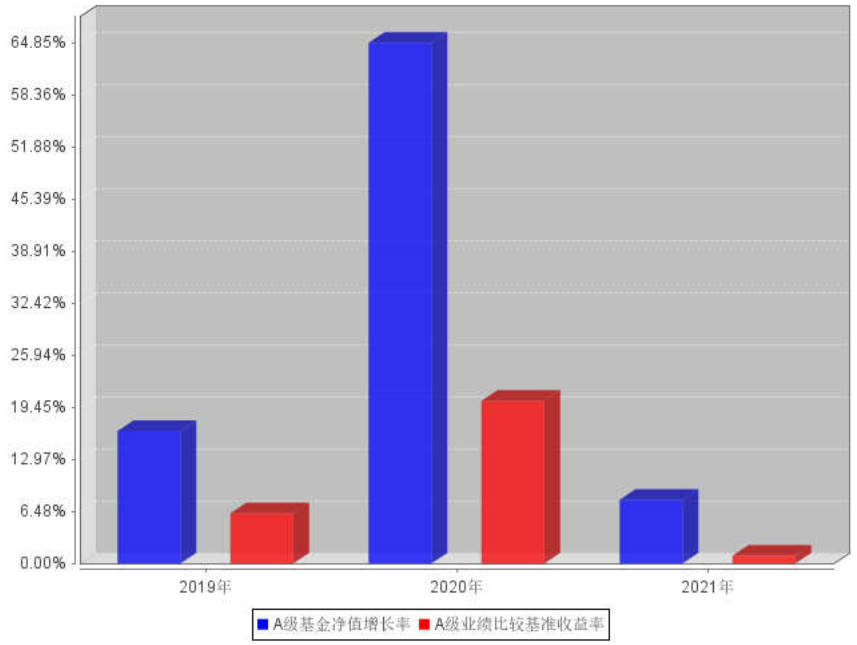



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

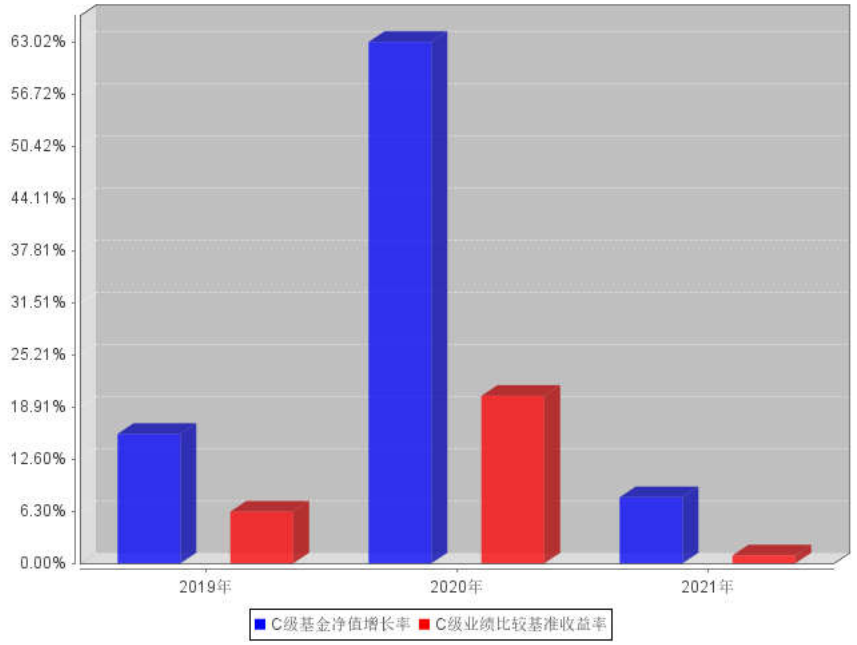


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图




C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图




## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自生效日（2019 年 6 月 26 日）至本报告期末成立不满三年且未发生利润分配。

# §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。

公司秉承"基金份额持有人利益优先、管理创造价值、质量创造财富"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、东海祥苏短债债券型证券投资基金、东海祥泰三年定期开放债券型发起式证券投资基金、东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金和东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金。

### 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 | | |
| 杨红 | 本基金的基金经理 | 2019 年 6 月 26 日 | - | 10 年 | 国籍：中国。工学硕士，历任齐鲁证券有限公司研究所行业研究员，创金合信基金管理有限公司行业研究员，东海基金管理有限责任公司研究开发部高级研究员、专户理财部投资经理、研究开发部负责人等职务，现担任基金权益投资副总监，担任东海科技动力混合型证券投资基金和东海核心价值精选混合型证券投资基金的基金经理。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 李昂 | 本基金的基金经理 | 2021 年 1 月 4 日 | 2021 年 5 月 11 日 | 5 年 | 国籍：中国。硕士，2015 年 10 月加入东海基金管理有限责任公司，历任公司 TMT 行业研究员、基金经理助理等职。 |

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。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内，基金经理未兼任其他私募资产管理计划投资经理。

### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，基金经理未兼任其他私募资产管理计划投资经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无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 公平交易制度和控制方法

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。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

注：本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.3.3 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

本报告期内，本基金采取了相对积极的投资策略，全年仓位整体控制在偏高水平，在投资方向上聚焦科技、新能源两大方向。2021 年 A 股市场受新冠影响，导致权益市场在 2-3 月份经历了大幅波动，但随着国内疫情得到控制，海外疫情蔓延，全球货币政策保持相对宽松状态，全年权益市场表现好于债券。2021 年本基金全年表现良好。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东海科技动力 A 基金份额净值为 2.0730 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.94%；截至本报告期末东海科技动力 C 基金份额净值为 2.0362 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.99%；同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，我们认为权益市场的机会与风险并存，海外方面，美国加息将至对权益类资产有所压制，但另一方面海外疫情反复增加了海外经济修复的不确定性。我国经济整体处于增速切换的时期，而当前时点经济下行压力加大，政府提出“稳增长”政策对于经济形成一定托底效应，能源结构转型背景下必将孕育投资机会。从行业配置方面来讲，我们仍然确信“新能源+科技”板块的成长属性将带来很好的投资机会。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司监察稽核部门在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全风险管理体系，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 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。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同规定。

## 4.9 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

报告期内，本基金未有连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况出现；本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金资产净值于 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 9 月 28 日均低于 5000 万元以下。基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

# §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，在托管"东海科技动力混合型证券投资基金"的过程中，本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《东海科技动力混合型证券投资基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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，本基金托管人—江苏银行股份有限公司未发现东海基金管理有限责任公司在"东海科技动力混合型证券投资基金"的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的"东海科技动力混合型证券投资基金"年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# §6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 毕马威华振审字第 2202573 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|---|---|
| 审计报告收件人 | 东海科技动力混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了后附的东海科技动力混合型证券投资基金（以下简称“东海科技动力基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了东海科技动力基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果及基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东海科技动力基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | 东海科技动力基金管理人东海基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括东海科技动力基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。<br>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。<br>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。<br>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |

| | |
|---|---|
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东海科技动力基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非东海科技动力基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督东海科技动力基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东海科技动力基金持续经 |

| | |
|---|---|
| | 营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东海科技动力基金不能持续经营。<br>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 张楠　　刘叶君 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层 |
| 审计报告日期 | 2022 年 3 月 28 日 |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东海科技动力混合型证券投资基金

报告截止日： 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 4,945,216.01 | 4,853,620.49 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 32,537,921.33 | 36,195,337.91 |
| 其中：股票投资 | | 32,537,921.33 | 36,195,337.91 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 684.24 | 521.46 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 54,971.78 | 73,033.35 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 37,538,793.36 | 41,122,513.21 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2021 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2020 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 186,470.79 | 411,914.79 |
| 应付管理人报酬 | | 37,399.15 | 41,561.39 |
| 应付托管费 | | 6,233.20 | 6,926.89 |
| 应付销售服务费 | | 4,109.15 | 3,732.61 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 90,014.13 | 30,366.01 |
| 负债合计 | | 324,226.42 | 494,501.69 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 18,168,366.49 | 21,366,529.65 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 19,046,200.45 | 19,261,481.87 |
| 所有者权益合计 | | 37,214,566.94 | 40,628,011.52 |
| 负债和所有者权益总计 | | 37,538,793.36 | 41,122,513.21 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，东海科技动力 A 基金份额净值 2.0730 元，基金份额总额 5,968,731.01 份；东海科技动力 C 基金份额净值 2.0362 元，基金份额总额 12,199,635.48 份。东海科技动力份额总额合计为 18,168,366.49 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东海科技动力混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | 5,376,889.06 | 19,030,769.22 |
| 1.利息收入 | | 23,109.31 | 23,215.79 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 23,109.31 | 23,215.79 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 8,756,137.19 | 15,029,637.61 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 8,636,184.82 | 14,788,850.02 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 119,952.37 | 240,787.59 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -3,648,771.56 | 3,519,518.72 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填 | 7.4.7.18 | 246,414.12 | 458,397.10 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 列） | | | |
| **减：二、费用** | | 1,144,391.31 | 1,794,435.12 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 425,444.02 | 531,454.06 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 70,907.33 | 88,575.55 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 40,020.82 | 52,624.31 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.19 | 518,019.14 | 1,131,781.20 |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．税金及附加 | | - | - |
| 7．其他费用 | 7.4.7.20 | 90,000.00 | -10,000.00 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 4,232,497.75 | 17,236,334.10 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 4,232,497.75 | 17,236,334.10 |

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海科技动力混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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） | 21,366,529.65 | 19,261,481.87 | 40,628,011.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 4,232,497.75 | 4,232,497.75 |
| 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） | -3,198,163.16 | -4,447,779.17 | -7,645,942.33 |
| 其中：1.基金申购款 | 48,327,885.03 | 48,089,600.12 | 96,417,485.15 |
| 2.基金赎回款 | -51,526,048.19 | -52,537,379.29 | -104,063,427.48 |
| 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 | 18,168,366.49 | 19,046,200.45 | 37,214,566.94 |

| 金净值） | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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） | 18,479,362.21 | 2,954,129.80 | 21,433,492.01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 17,236,334.10 | 17,236,334.10 |
| 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） | 2,887,167.44 | -928,982.03 | 1,958,185.41 |
| 其中：1.基金申购款 | 95,780,858.13 | 45,498,081.92 | 141,278,940.05 |
| 2.基金赎回款 | -92,893,690.69 | -46,427,063.95 | -139,320,754.64 |
| 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） | 21,366,529.65 | 19,261,481.87 | 40,628,011.52 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| 严晓珺 | 周华成 | 朱一民 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东海科技动力混合型证券投资基金（以下简称"本基金"），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[2019]743 号文《关于准予东海科技动力混合型证券投资基金的批复》准予注册，由东海基金管理有限公司（以下简称"东海基金"）依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《东海科技动力混合型证券投资基金基金合同（以下简称"基金合同"）》发售，基金合同于 2019 年 6 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 222,737,973.95 份基金份额。本基金的基金管理人为东海基金，基金托管人为江苏银行股份有限公司（以下简称"江苏银行"）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《东海科技动力混合型证券投资基金基金合同》和更新的《东海科技动力混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金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基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金投资组合的比例范围为：股票投资占基金资产的比例范围为 60%一 95%．其中投资于本基金定义的科技动力型企业发行的股票不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等．本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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。

### 7.4.3 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎

回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益 。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配，具体分配方案以公告为准；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类基金份额的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。由于本基金各类基金份额收取费用的不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 1,777,948.20 | 1,030,735.08 |
| 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 | 3,167,267.81 | 3,822,885.41 |
| 合计： | 4,945,216.01 | 4,853,620.49 |

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 29,895,809.78 | 32,537,921.33 | 2,642,111.55 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 29,895,809.78 | 32,537,921.33 | 2,642,111.55 |
| 项目 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 29,904,454.80 | 36,195,337.91 | 6,290,883.11 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 29,904,454.80 | 36,195,337.91 | 6,290,883.11 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 474.71 | 194.00 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | 209.53 | 327.46 |
| 应收结算备付金利息 | - | - |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 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 | - | - |
| 合计 | 684.24 | 521.46 |

注：其他存款利息本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用。

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 14.13 | 366.01 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提审计费用 | 40,000.00 | 30,000.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 预提信息披露费 | 50,000.00 | - |
| 合计 | 90,014.13 | 30,366.01 |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 东海科技动力 A | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 9,760,801.32 | 9,760,801.32 |
| 本期申购 | 8,799,627.07 | 8,799,627.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,591,697.38 | -12,591,697.38 |
| - 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 | 5,968,731.01 | 5,968,731.01 |

金额单位：人民币元

| 东海科技动力 C | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 11,605,728.33 | 11,605,728.33 |
| 本期申购 | 39,528,257.96 | 39,528,257.96 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -38,934,350.81 | -38,934,350.81 |
| - 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 | 12,199,635.48 | 12,199,635.48 |

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 东海科技动力 A | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 5,918,621.02 | 3,066,076.59 | 8,984,697.61 |
| 本期利润 | 3,491,452.47 | -2,402,752.45 | 1,088,700.02 |
| 本期基金份额交易 | -3,420,446.91 | -248,339.33 | -3,668,786.24 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 7,096,371.55 | 2,245,997.98 | 9,342,369.53 |
| 基金赎回款 | -10,516,818.46 | -2,494,337.31 | -13,011,155.77 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 5,989,626.58 | 414,984.81 | 6,404,611.39 |

单位：人民币元

| 东海科技动力 C | | | |
|---|---|---|---|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 6,664,509.52 | 3,612,274.74 | 10,276,784.26 |
| 本期利润 | 4,389,816.84 | -1,246,019.11 | 3,143,797.73 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 718,945.28 | -1,497,938.21 | -778,992.93 |
| 其中：基金申购款 | 31,502,081.69 | 7,245,148.90 | 38,747,230.59 |
| 基金赎回款 | -30,783,136.41 | -8,743,087.11 | -39,526,223.52 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 11,773,271.64 | 868,317.42 | 12,641,589.06 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 8,302.46 | 6,845.31 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | 14,806.85 | 16,370.48 |
| 结算备付金利息收入 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 23,109.31 | 23,215.79 |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

### 7.4.7.12 股票投资收益

### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 200,547,031.69 | 433,023,569.56 |
| 减：卖出股票成本总额 | 191,910,846.87 | 418,234,719.54 |

| | | |
|---|---|---|
| 买卖股票差价收入 | 8,636,184.82 | 14,788,850.02 |

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益项目构成。

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 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。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

#### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益项目构成。

#### 7.4.7.14.2 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。

#### 7.4.7.14.3 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。

#### 7.4.7.14.4 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。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 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。

### 7.4.7.15.2 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。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 119,952.37 | 240,787.59 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 119,952.37 | 240,787.59 |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -3,648,771.56 | 3,519,518.72 |
| ——股票投资 | -3,648,771.56 | 3,519,518.72 |
| ——债券投资 | - | - |
| ——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增值税 | - | - |
| 合计 | -3,648,771.56 | 3,519,518.72 |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 246,414.12 | 458,397.10 |
| 合计 | 246,414.12 | 458,397.10 |

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 518,019.14 | 1,131,781.20 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 交易基金产生的费用 | - | - |
| 其中：申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 合计 | 518,019.14 | 1,131,781.20 |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 40,000.00 | 30,000.00 |
| 信息披露费 | 50,000.00 | - |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 证券账户开户费 | - | - |
| 其他 | - | -40,000.00 |
| 上市费 | - | - |
| 合计 | 90,000.00 | -10,000.00 |

### 7.4.7.21 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。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 江苏银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 东海证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 苏州市相城区江南化纤集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳鹏博实业集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 东海瑞京资产管理（上海)有限公司 | 基金管理人子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

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交易。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 425,444.02 | 531,454.06 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 144,071.92 | 139,867.33 |

注：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按前一日基金资产净值 1.20%的年

费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 70,907.33 | 88,575.55 |

注：支付基金托管人江苏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

### 7.4.10.2.3 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>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C | 合计 |
| 江苏银行银行股份有限公司 | - | 97.39 | 97.39 |
| 东海基金管理有限责任公司 | - | 2,333.35 | 2,333.35 |
| 合计 | - | 2,430.74 | 2,430.74 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C | 合计 |
| 江苏银行银行股份有限公司 | - | 185.60 | 185.60 |
| 东海基金管理有限责任公司 | - | 21,831.53 | 21,831.53 |
| 合计 | - | 22,017.13 | 22,017.13 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额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：C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%÷当年天数

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

### 7.4.10.6 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>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 江苏银行 | 1,777,948.20 | 8,302.46 | 1,030,735.08 | 6,845.31 |

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.10.7 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。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001234 | 泰慕士 | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股流通受限 | 16.53 | 16.53 | 185 | 3,058.05 | 3,058.05 | - |

注：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及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券 。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行江苏银行 ，与该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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 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，并且可在需要时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%。

### 7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 12 月 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 | 1,777,948.20 | - | - | - | - | - | 1,777,948.20 |
| 结算备付金 | 3,167,267.81 | - | - | - | - | - | 3,167,267.81 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 32,537,921.33 | 32,537,921.33 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 684.24 | 684.24 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 54,971.78 | 54,971.78 |
| 资产总计 | 4,945,216.01 | - | - | - | - | 32,593,577.35 | 37,538,793.36 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 186,470.79 | 186,470.79 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 37,399.15 | 37,399.15 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 6,233.20 | 6,233.20 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 4,109.15 | 4,109.15 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 90,014.13 | 90,014.13 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 324,226.42 | 324,226.42 |
| 利率敏感度缺口 | 4,945,216.01 | - | - | - | - | 32,269,350.93 | 37,214,566.94 |
| 上年度末 2020 年 12 月 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 | 1,030,735.08 | - | - | - | - | - | 1,030,735.08 |
| 结算备付金 | 3,822,885.41 | - | - | - | - | - | 3,822,885.41 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 36,195,337.91 | 36,195,337.91 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 521.46 | 521.46 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 73,033.35 | 73,033.35 |
| 资产总计 | 4,853,620.49 | - | - | - | - | 36,268,892.72 | 41,122,513.21 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 411,914.79 | 411,914.79 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 41,561.39 | 41,561.39 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 6,926.89 | 6,926.89 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 3,732.61 | 3,732.61 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 30,366.01 | 30,366.01 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 494,501.69 | 494,501.69 |
| 利率敏感度缺口 | 4,853,620.49 | - | - | - | - | 35,774,391.03 | 40,628,011.52 |

### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，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,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 32,537,921.33 | 87.43 | 36,195,337.91 | 89.09 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 32,537,921.33 | 87.43 | 36,195,337.91 | 89.09 |

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|---|---|---|---|
| 假设 | 基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。以下分析中，除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。 | | |
| 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影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（ 2021 年 12 月 31 日 ） | 上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ） |
| | 业绩比较基准增加 1% | 455,238.06 | 517,882.89 |
| | 业绩比较基准减少 1% | -455,238.06 | -517,882.89 |

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 32,534,863.28 元，第二层次的余额为人民币 3,058.05 元，第三层次的余额为人民币 0.00 元（2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 36,184,306.55 元，第

二层次的余额为人民币11,031.36元，第三层次的余额为人民币0.00元）。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：无）。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

# §8 投资组合报告

## 8.1 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 | 32,537,921.33 | 86.68 |
| | 其中：股票 | 32,537,921.33 | 86.68 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,945,216.01 | 13.17 |
| 8 | 其他各项资产 | 55,656.02 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 37,538,793.36 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 907,120.00 | 2.44 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 26,345,181.33 | 70.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,995,780.00 | 8.05 |
| 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 | 1,341,200.00 | 3.60 |
| 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 | 948,640.00 | 2.55 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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 | 32,537,921.33 | 87.43 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 8.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300316 | 晶盛机电 | 28,940 | 2,011,330.00 | 5.40 |
| 2 | 002241 | 歌尔股份 | 35,000 | 1,893,500.00 | 5.09 |
| 3 | 002484 | 江海股份 | 66,000 | 1,803,120.00 | 4.85 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 3,000 | 1,764,000.00 | 4.74 |
| 5 | 688377 | 迪威尔 | 90,000 | 1,674,900.00 | 4.50 |
| 6 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 60,000 | 1,650,600.00 | 4.44 |
| 7 | 000887 | 中鼎股份 | 70,000 | 1,526,700.00 | 4.10 |
| 8 | 002459 | 晶澳科技 | 15,000 | 1,390,500.00 | 3.74 |
| 9 | 002920 | 德赛西威 | 9,000 | 1,273,590.00 | 3.42 |
| 10 | 688005 | 容百科技 | 11,000 | 1,271,380.00 | 3.42 |
| 11 | 600150 | 中国船舶 | 50,000 | 1,239,500.00 | 3.33 |
| 12 | 601012 | 隆基股份 | 14,200 | 1,224,040.00 | 3.29 |
| 13 | 603596 | 伯特利 | 16,000 | 1,113,600.00 | 2.99 |
| 14 | 002555 | 三七互娱 | 40,000 | 1,080,800.00 | 2.90 |
| 15 | 600905 | 三峡能源 | 140,000 | 1,051,400.00 | 2.83 |
| 16 | 300953 | 震裕科技 | 8,000 | 1,044,560.00 | 2.81 |
| 17 | 600745 | 闻泰科技 | 8,000 | 1,034,400.00 | 2.78 |
| 18 | 603606 | 东方电缆 | 20,000 | 1,023,200.00 | 2.75 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 7,000 | 1,020,600.00 | 2.74 |
| 20 | 000539 | 粤电力 A | 160,000 | 984,000.00 | 2.64 |
| 21 | 603259 | 药明康德 | 8,000 | 948,640.00 | 2.55 |
| 22 | 002714 | 牧原股份 | 17,000 | 907,120.00 | 2.44 |
| 23 | 002039 | 黔源电力 | 40,000 | 843,200.00 | 2.27 |
| 24 | 603501 | 韦尔股份 | 1,960 | 609,109.20 | 1.64 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 25 | 605005 | 合兴股份 | 20,000 | 475,800.00 | 1.28 |
| 26 | 000811 | 冰轮环境 | 30,000 | 461,700.00 | 1.24 |
| 27 | 688636 | 智明达 | 3,000 | 423,750.00 | 1.14 |
| 28 | 000400 | 许继电气 | 10,000 | 261,000.00 | 0.70 |
| 29 | 688099 | 晶晨股份 | 2,000 | 260,400.00 | 0.70 |
| 30 | 600566 | 济川药业 | 5,000 | 141,700.00 | 0.38 |
| 31 | 601016 | 节能风电 | 18,000 | 117,180.00 | 0.31 |
| 32 | 001296 | 长江材料 | 161 | 9,544.08 | 0.03 |
| 33 | 001234 | 泰慕士 | 185 | 3,058.05 | 0.01 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300726 | 宏达电子 | 5,072,160.88 | 12.48 |
| 2 | 603259 | 药明康德 | 3,795,839.00 | 9.34 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 3,224,626.00 | 7.94 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 3,069,820.00 | 7.56 |
| 5 | 688005 | 容百科技 | 2,962,842.30 | 7.29 |
| 6 | 600745 | 闻泰科技 | 2,758,161.00 | 6.79 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 2,744,769.00 | 6.76 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 2,564,467.50 | 6.31 |
| 9 | 300433 | 蓝思科技 | 2,483,882.00 | 6.11 |
| 10 | 002459 | 晶澳科技 | 2,366,222.00 | 5.82 |
| 11 | 002025 | 航天电器 | 2,363,852.00 | 5.82 |
| 12 | 002555 | 三七互娱 | 2,358,843.00 | 5.81 |
| 13 | 002812 | 恩捷股份 | 2,260,667.00 | 5.56 |
| 14 | 688202 | 美迪西 | 2,201,358.77 | 5.42 |
| 15 | 000100 | TCL 科技 | 2,197,800.00 | 5.41 |
| 16 | 603501 | 韦尔股份 | 2,161,709.00 | 5.32 |
| 17 | 002714 | 牧原股份 | 2,149,203.00 | 5.29 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 2,127,010.00 | 5.24 |
| 19 | 601318 | 中国平安 | 2,124,650.00 | 5.23 |
| 20 | 688981 | 中芯国际 | 2,108,454.09 | 5.19 |
| 21 | 600111 | 北方稀土 | 1,910,108.00 | 4.70 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 22 | 002013 | 中航机电 | 1,907,553.00 | 4.70 |
| 23 | 600519 | 贵州茅台 | 1,891,773.00 | 4.66 |
| 24 | 688680 | 海优新材 | 1,883,375.14 | 4.64 |
| 25 | 603659 | 璞泰来 | 1,817,823.00 | 4.47 |
| 26 | 688126 | 沪硅产业 | 1,787,620.58 | 4.40 |
| 27 | 603596 | 伯特利 | 1,764,550.00 | 4.34 |
| 28 | 000858 | 五粮液 | 1,762,810.00 | 4.34 |
| 29 | 002920 | 德赛西威 | 1,745,847.00 | 4.30 |
| 30 | 000333 | 美的集团 | 1,715,037.00 | 4.22 |
| 31 | 300316 | 晶盛机电 | 1,712,683.40 | 4.22 |
| 32 | 002484 | 江海股份 | 1,696,561.00 | 4.18 |
| 33 | 002049 | 紫光国微 | 1,676,336.00 | 4.13 |
| 34 | 600406 | 国电南瑞 | 1,636,998.00 | 4.03 |
| 35 | 688377 | 迪威尔 | 1,625,395.37 | 4.00 |
| 36 | 600905 | 三峡能源 | 1,625,103.00 | 4.00 |
| 37 | 002179 | 中航光电 | 1,608,301.00 | 3.96 |
| 38 | 000887 | 中鼎股份 | 1,597,444.00 | 3.93 |
| 39 | 300627 | 华测导航 | 1,572,667.00 | 3.87 |
| 40 | 300347 | 泰格医药 | 1,556,700.00 | 3.83 |
| 41 | 000636 | 风华高科 | 1,554,957.00 | 3.83 |
| 42 | 300059 | 东方财富 | 1,522,988.60 | 3.75 |
| 43 | 002624 | 完美世界 | 1,505,900.00 | 3.71 |
| 44 | 600703 | 三安光电 | 1,503,400.00 | 3.70 |
| 45 | 603444 | 吉比特 | 1,499,097.00 | 3.69 |
| 46 | 002241 | 歌尔股份 | 1,495,543.00 | 3.68 |
| 47 | 600690 | 海尔智家 | 1,486,665.00 | 3.66 |
| 48 | 601601 | 中国太保 | 1,474,608.00 | 3.63 |
| 49 | 300450 | 先导智能 | 1,453,882.00 | 3.58 |
| 50 | 603027 | 千禾味业 | 1,438,024.40 | 3.54 |
| 51 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,414,864.00 | 3.48 |
| 52 | 300699 | 光威复材 | 1,390,865.00 | 3.42 |
| 53 | 601233 | 桐昆股份 | 1,379,775.00 | 3.40 |
| 54 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 1,346,500.00 | 3.31 |
| 55 | 688499 | 利元亨 | 1,336,310.75 | 3.29 |
| 56 | 603290 | 斯达半导 | 1,307,941.00 | 3.22 |
| 57 | 603986 | 兆易创新 | 1,294,720.80 | 3.19 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 58 | 300122 | 智飞生物 | 1,280,500.00 | 3.15 |
| 59 | 600885 | 宏发股份 | 1,255,782.00 | 3.09 |
| 60 | 600765 | 中航重机 | 1,247,249.00 | 3.07 |
| 61 | 600150 | 中国船舶 | 1,220,268.00 | 3.00 |
| 62 | 000009 | 中国宝安 | 1,193,581.00 | 2.94 |
| 63 | 002371 | 北方华创 | 1,169,672.00 | 2.88 |
| 64 | 300218 | 安利股份 | 1,144,795.00 | 2.82 |
| 65 | 600577 | 精达股份 | 1,140,078.00 | 2.81 |
| 66 | 000725 | 京东方A | 1,135,200.00 | 2.79 |
| 67 | 603345 | 安井食品 | 1,129,526.00 | 2.78 |
| 68 | 002493 | 荣盛石化 | 1,119,132.00 | 2.75 |
| 69 | 600104 | 上汽集团 | 1,107,310.00 | 2.73 |
| 70 | 300687 | 赛意信息 | 1,107,195.00 | 2.73 |
| 71 | 300953 | 震裕科技 | 1,036,455.00 | 2.55 |
| 72 | 688122 | 西部超导 | 1,023,335.68 | 2.52 |
| 73 | 601799 | 星宇股份 | 1,021,920.00 | 2.52 |
| 74 | 601633 | 长城汽车 | 1,007,576.00 | 2.48 |
| 75 | 300759 | 康龙化成 | 1,002,385.00 | 2.47 |
| 76 | 603606 | 东方电缆 | 998,930.00 | 2.46 |
| 77 | 601689 | 拓普集团 | 988,802.00 | 2.43 |
| 78 | 300274 | 阳光电源 | 982,368.00 | 2.42 |
| 79 | 300474 | 景嘉微 | 966,229.00 | 2.38 |
| 80 | 000963 | 华东医药 | 962,169.00 | 2.37 |
| 81 | 300776 | 帝尔激光 | 921,076.00 | 2.27 |
| 82 | 600801 | 华新水泥 | 896,267.00 | 2.21 |
| 83 | 000733 | 振华科技 | 886,512.00 | 2.18 |
| 84 | 002039 | 黔源电力 | 885,529.00 | 2.18 |
| 85 | 000001 | 平安银行 | 877,998.00 | 2.16 |
| 86 | 688699 | 明微电子 | 868,756.99 | 2.14 |
| 87 | 600821 | 金开新能 | 865,712.00 | 2.13 |
| 88 | 002648 | 卫星化学 | 839,716.00 | 2.07 |
| 89 | 002594 | 比亚迪 | 816,114.00 | 2.01 |
| 90 | 600392 | 盛和资源 | 815,911.00 | 2.01 |
| 91 | 601012 | 隆基股份 | 813,393.00 | 2.00 |

注：″买入金额″按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300726 | 宏达电子 | 4,919,531.48 | 12.11 |
| 2 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,519,369.00 | 11.12 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 4,305,695.00 | 10.60 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 4,168,340.00 | 10.26 |
| 5 | 000725 | 京东方 A | 3,489,000.00 | 8.59 |
| 6 | 300014 | 亿纬锂能 | 3,439,810.00 | 8.47 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 3,182,390.00 | 7.83 |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 2,939,298.00 | 7.23 |
| 9 | 601233 | 桐昆股份 | 2,913,755.00 | 7.17 |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 2,907,202.00 | 7.16 |
| 11 | 600690 | 海尔智家 | 2,900,083.00 | 7.14 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 2,768,383.00 | 6.81 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 2,748,533.38 | 6.77 |
| 14 | 603259 | 药明康德 | 2,634,528.00 | 6.48 |
| 15 | 300433 | 蓝思科技 | 2,527,551.00 | 6.22 |
| 16 | 002493 | 荣盛石化 | 2,512,125.00 | 6.18 |
| 17 | 002459 | 晶澳科技 | 2,475,978.00 | 6.09 |
| 18 | 002049 | 紫光国微 | 2,353,732.00 | 5.79 |
| 19 | 002025 | 航天电器 | 2,332,403.00 | 5.74 |
| 20 | 688202 | 美迪西 | 2,318,501.64 | 5.71 |
| 21 | 002812 | 恩捷股份 | 2,297,317.00 | 5.65 |
| 22 | 002013 | 中航机电 | 2,158,145.00 | 5.31 |
| 23 | 300627 | 华测导航 | 2,135,658.00 | 5.26 |
| 24 | 600111 | 北方稀土 | 2,113,634.00 | 5.20 |
| 25 | 688680 | 海优新材 | 2,089,511.80 | 5.14 |
| 26 | 600486 | 扬农化工 | 2,044,493.00 | 5.03 |
| 27 | 688981 | 中芯国际 | 2,007,901.64 | 4.94 |
| 28 | 002050 | 三花智控 | 1,978,191.15 | 4.87 |
| 29 | 600519 | 贵州茅台 | 1,954,984.00 | 4.81 |
| 30 | 000661 | 长春高新 | 1,950,833.00 | 4.80 |
| 31 | 000100 | TCL 科技 | 1,936,800.00 | 4.77 |
| 32 | 603659 | 璞泰来 | 1,917,806.00 | 4.72 |
| 33 | 300474 | 景嘉微 | 1,877,996.00 | 4.62 |
| 34 | 002179 | 中航光电 | 1,826,973.00 | 4.50 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 35 | 688126 | 沪硅产业 | 1,734,489.01 | 4.27 |
| 36 | 600926 | 杭州银行 | 1,703,703.00 | 4.19 |
| 37 | 000333 | 美的集团 | 1,685,115.00 | 4.15 |
| 38 | 603444 | 吉比特 | 1,668,874.00 | 4.11 |
| 39 | 600703 | 三安光电 | 1,665,730.00 | 4.10 |
| 40 | 688396 | 华润微 | 1,636,127.61 | 4.03 |
| 41 | 000858 | 五粮液 | 1,608,366.00 | 3.96 |
| 42 | 603501 | 韦尔股份 | 1,576,257.00 | 3.88 |
| 43 | 603027 | 千禾味业 | 1,554,405.00 | 3.83 |
| 44 | 605111 | 新洁能 | 1,543,260.00 | 3.80 |
| 45 | 601689 | 拓普集团 | 1,538,770.00 | 3.79 |
| 46 | 600406 | 国电南瑞 | 1,534,811.00 | 3.78 |
| 47 | 002185 | 华天科技 | 1,531,712.94 | 3.77 |
| 48 | 600745 | 闻泰科技 | 1,519,604.00 | 3.74 |
| 49 | 300059 | 东方财富 | 1,516,100.00 | 3.73 |
| 50 | 600031 | 三一重工 | 1,495,956.00 | 3.68 |
| 51 | 300450 | 先导智能 | 1,464,770.76 | 3.61 |
| 52 | 603290 | 斯达半导 | 1,456,847.00 | 3.59 |
| 53 | 600346 | 恒力石化 | 1,420,673.00 | 3.50 |
| 54 | 600765 | 中航重机 | 1,408,324.00 | 3.47 |
| 55 | 002371 | 北方华创 | 1,404,313.00 | 3.46 |
| 56 | 688005 | 容百科技 | 1,400,958.95 | 3.45 |
| 57 | 688499 | 利元亨 | 1,397,393.55 | 3.44 |
| 58 | 300347 | 泰格医药 | 1,359,088.00 | 3.35 |
| 59 | 000636 | 风华高科 | 1,310,270.00 | 3.23 |
| 60 | 300122 | 智飞生物 | 1,294,910.00 | 3.19 |
| 61 | 002036 | 联创电子 | 1,290,971.00 | 3.18 |
| 62 | 600885 | 宏发股份 | 1,276,669.00 | 3.14 |
| 63 | 603986 | 兆易创新 | 1,267,164.80 | 3.12 |
| 64 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,233,077.00 | 3.04 |
| 65 | 300699 | 光威复材 | 1,217,848.00 | 3.00 |
| 66 | 601601 | 中国太保 | 1,211,490.00 | 2.98 |
| 67 | 002624 | 完美世界 | 1,187,600.00 | 2.92 |
| 68 | 002714 | 牧原股份 | 1,179,064.00 | 2.90 |
| 69 | 002601 | 龙佰集团 | 1,162,130.00 | 2.86 |
| 70 | 002555 | 三七互娱 | 1,132,928.00 | 2.79 |
| 71 | 600309 | 万华化学 | 1,126,862.00 | 2.77 |
| 72 | 600104 | 上汽集团 | 1,124,180.00 | 2.77 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 73 | 601799 | 星宇股份 | 1,083,218.00 | 2.67 |
| 74 | 300759 | 康龙化成 | 1,079,257.00 | 2.66 |
| 75 | 603345 | 安井食品 | 1,070,845.00 | 2.64 |
| 76 | 300218 | 安利股份 | 1,044,617.00 | 2.57 |
| 77 | 300687 | 赛意信息 | 1,020,209.00 | 2.51 |
| 78 | 300776 | 帝尔激光 | 968,234.00 | 2.38 |
| 79 | 603877 | 太平鸟 | 958,268.00 | 2.36 |
| 80 | 600392 | 盛和资源 | 932,598.00 | 2.30 |
| 81 | 000963 | 华东医药 | 917,122.00 | 2.26 |
| 82 | 300118 | 东方日升 | 903,500.00 | 2.22 |
| 83 | 601633 | 长城汽车 | 879,687.00 | 2.17 |
| 84 | 600801 | 华新水泥 | 862,242.00 | 2.12 |
| 85 | 688122 | 西部超导 | 854,343.08 | 2.10 |
| 86 | 600577 | 精达股份 | 844,800.00 | 2.08 |
| 87 | 000009 | 中国宝安 | 840,900.00 | 2.07 |

注：″卖出金额″按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 191,902,201.85 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 200,547,031.69 |

注：本表″买入股票成本（成交）总额″，″卖出股票收入（成交）总额″均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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

报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 684.24 |
| 5 | 应收申购款 | 54,971.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 55,656.02 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 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。

# §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 东海科技动力 A | 1,593 | 3,746.85 | 0.00 | 0.00% | 5,968,731.01 | 100.00% |
| 东海科技动力 C | 7,233 | 1,686.66 | 0.00 | 0.00% | 12,199,635.48 | 100.00% |
| 合计 | 8,826 | 2,058.51 | 0.00 | 0.00% | 18,168,366.49 | 100.00% |

## 9.2 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） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东海科技动力 A | 356,683.08 | 5.9759% |
| | 东海科技动力 C | 262,570.41 | 2.1523% |
| | 合计 | 619,253.49 | 3.4084% |

## 9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 东海科技动力 A | 10~50 |
| | 东海科技动力 C | 0~10 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 东海科技动力 A | 0~10 |
| | 东海科技动力 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期内，基金经理未兼任其他私募资产管理计划投资经理。

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东海科技动力 A | 东海科技动力 C |
| --- | --- | --- |
| 基金合同生效日（2019 年 6 月 26 日）基金份额总额 | 26,283,123.97 | 196,454,849.98 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 9,760,801.32 | 11,605,728.33 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,799,627.07 | 39,528,257.96 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 12,591,697.38 | 38,934,350.81 |
| 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 | 5,968,731.01 | 12,199,635.48 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 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 2021 年 6 月 3 日发布公告，自 2021 年 6 月 1 日起，新任宗华俊先生和刘爱华女士为基金管理人副总经理，邓升军先生不再担任基金管理人副总经理。

2、基金管理人 2021 年 12 月 4 日发布公告，自 2021 年 12 月 2 日起，苏尚才先生不再担任基金管理人副总经理。

3、基金管理人 2021 年 12 月 11 日发布公告，自 2021 年 12 月 10 日起，由基金管理人总经理严晓珺女士代为履行基金管理人董事长职务，赵俊先生不再担任基金管理人董事长。

4、本报告期内，江苏银行股份有限公司资产托管部负责人变更为周宏先生。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人未改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的基金审计费用为 4 万元，其已提供审计服务的连续年限为 3 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、基金管理人：本报告期内，因在私募资产管理业务过程中存在的问题，公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的责令整改及整改期间暂停办理公司私募资产管理计划备案的行政监管措施，并对相关责任人员出具了行政监管措施。公司高度重视，已按照法律法规和监管要求，积极进行了有效整改，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。此事项不影响公司公募基金业务的正常开展。

2、基金托管人：本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 | |
| 开源证券 | 2 | 392,069,360.87 | 100.00% | 282,693.44 | 100.00% | - |

注：

1：本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

2：基金专用交易单元的选择标准如下：

（1）券商财务状况良好、经营行为规范，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；

（2）券商具有一定的研究能力，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；

（3）券商承诺研究服务不包含内幕信息；

（4）券商具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足代理各投资组合进行证券交易的需要；

（5）合作券商收取的佣金费率符合市场平均水平。

3：基金专用交易单元的选择程序如下：

（1）研发策略部牵头组织对券商研究服务评分工作，评分结果经研发策略部负责人、公司总经理审批后确认；

（2）根据券商研究服务评分结果与公司对券商交易单元的选择标准，研发策略部牵头与券商联系商讨合作意向，确定选用交易单元的所属券商；

（3）研发策略部负责交易席位的租用、调整分配等管理，交易席位的租用或退租经研发策略部分管领导、总经理审批同意后执行；

（4）运营保障部负责交易席位的技术维护，按照经批准的席位调配计划对交易系统、卫星通讯系统进行相应参数调整。

### 11.7.2 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 |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |

## 11.8 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 | 东海科技动力混合型证券投 | 中国证监会规定报 | 2021 年 1 月 4 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 资基金基金经理变更公告 | 刊及网站 | |
| 2 | 东海基金管理有限责任公司关于基金经理暂停履行职务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 1 月 4 日 |
| 3 | 东海科技动力混合型证券投资基金招募说明书更新（2021 年 1 号）、东海科技动力混合型证券投资基金（东海科技动力 A 份额）基金产品资料概要（更新）、东海科技动力混合型证券投资基金（东海科技动力 C 份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 1 月 7 日 |
| 4 | 东海科技动力混合型证券投资基金招募说明书更新（2021 年 2 号） | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 1 月 19 日 |
| 5 | 东海基金管理有限责任公司关于北京分公司变更负责人的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 1 月 20 日 |
| 6 | 东海科技动力混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 7 | 东海基金管理有限责任公司关于旗下基金在部分销售机构暂停办理相关销售业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 2 月 8 日 |
| 8 | 东海科技动力混合型证券投资基金 2020 年年度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 9 | 东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 10 | 东海基金管理有限责任公司关于基金经理恢复履行职务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 5 月 6 日 |
| 11 | 东海科技动力混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 5 月 10 日 |
| 12 | 东海科技动力混合型证券投资基金招募说明书更新（2021 年 3 号）、东海科技动力混合型证券投资基金（东海科技动力 A 份额）基金产品资料概要（更新）、东海科技动力混合型证券投资基金（东海科技动力 C 份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 5 月 14 日 |
| 13 | 东海基金管理有限责任公司 | 中国证监会规定报 | 2021 年 6 月 3 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 高级管理人员变更公告 | 刊及网站 | |
| 14 | 东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 7 月 21 日 |
| 15 | 东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 8 月 18 日 |
| 16 | 东海基金管理有限责任公司关于客户服务电话号码变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 8 月 24 日 |
| 17 | 东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年中期报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 8 月 31 日 |
| 18 | 东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 19 | 东海基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购、赎回及定投最低数额限制的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 11 月 8 日 |
| 20 | 东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增东方财富证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 11 月 10 日 |
| 21 | 东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 11 月 10 日 |
| 22 | 东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 11 月 12 日 |
| 23 | 东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增北京度小满基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 11 月 19 日 |
| 24 | 东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 12 月 4 日 |
| 25 | 东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 12 月 11 日 |
| 26 | 东海基金管理有限责任公司 | 中国证监会规定报 | 2021 年 12 月 21 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 关于旗下基金新增湘财证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告 | 刊及网站 | |
| 27 | 东海科技动力混合型证券投资基金招募说明书更新（2021 年 4 号） | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 12 月 24 日 |

# §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

## 12.2 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。 |

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东海科技动力混合型证券投资基金设立的文件

2、《东海科技动力混合型证券投资基金基金合同》

3、《东海科技动力混合型证券投资基金招募说明书》

4、《东海科技动力混合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

## 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 13.3 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

2022 年 3 月 31 日