

东海中证社会发展安全产业主题指数型证
券投资基金
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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 2021 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 东海社会安全 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 001899 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 11 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 32,643,142.31 份 |
| 投资目标 | 本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金将采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理，以便实现对跟踪误差的有效控制。 |
| 业绩比较基准 | 中证社会发展安全产业主题指数收益率×95%+人民币税后活期存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的投资品种，预期风险与预期收益高于混合型基 |

| | |
|-------|---|
| | 金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 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 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年7月1日—2021年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -200,238.78 |
| 2. 本期利润 | -2,320,106.66 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0708 |
| 4. 期末基金资产净值 | 23,150,671.20 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.7090 |

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。

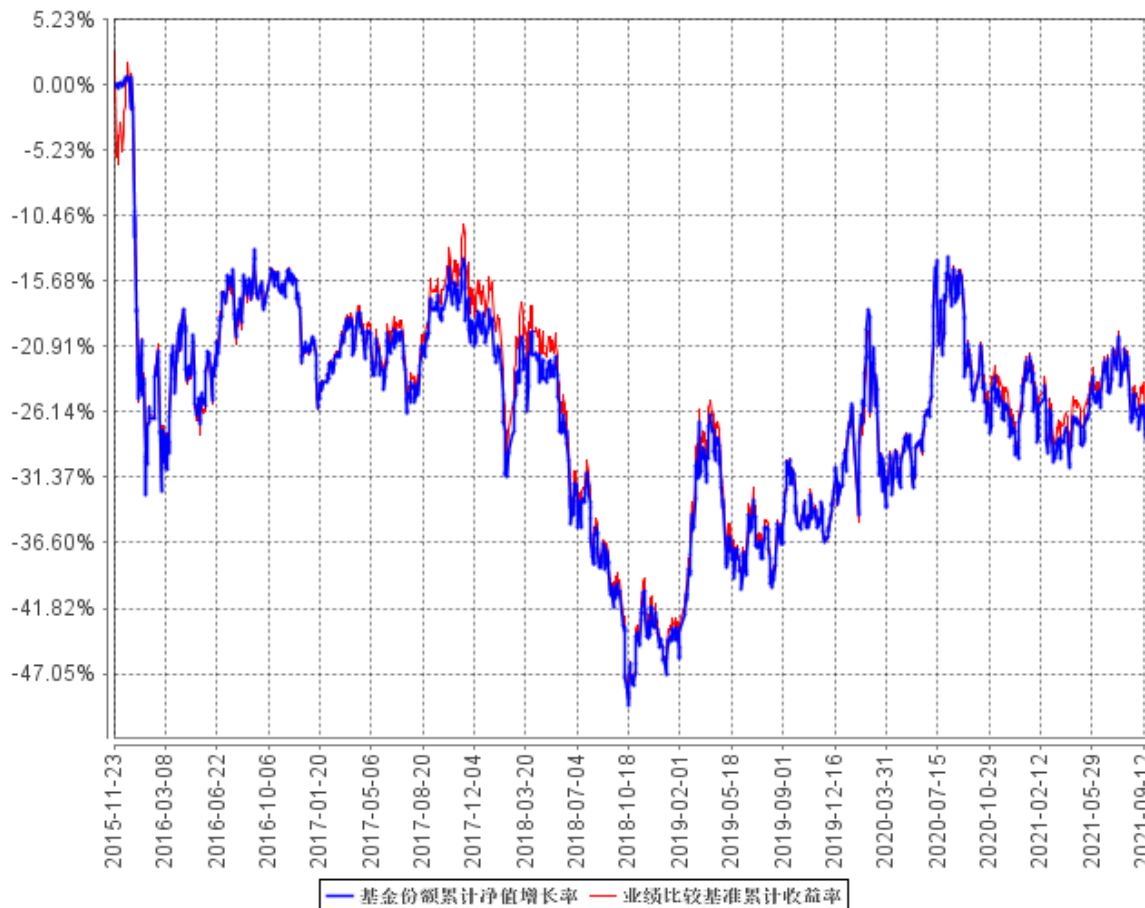
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -9.22% | 1.18% | -7.34% | 1.15% | -1.88% | 0.03% |
| 过去六个月 | -0.70% | 1.09% | -0.40% | 1.05% | -0.30% | 0.04% |
| 过去一年 | -6.34% | 1.19% | -4.24% | 1.17% | -2.10% | 0.02% |
| 过去三年 | 18.96% | 1.58% | 20.17% | 1.57% | -1.21% | 0.01% |
| 过去五年 | -14.58% | 1.44% | -12.51% | 1.45% | -2.07% | -0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | -29.10% | 1.55% | -27.31% | 1.59% | -1.79% | -0.04% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金基金合同生效日为 2015 年 11 月 23 日。图示日期为 2015 年 11 月 23 日至 2021 年 9 月 30 日。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|--------|----|
|----|----|-------------|--------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
|-----|----------|-----------------|-----------------|------|---|
| 张文理 | 本基金的基金经理 | 2021 年 9 月 22 日 | - | 4 年 | 国籍：中国。金融数学专业硕士，先后任职于瑞银集团（伦敦）中国项目组、汤森路透金融信息服务（中国）有限公司、国家金融信息中心有限责任公司、上投摩根基金管理有限公司，2020 年 5 月加入东海基金。现任东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金的基金经理。 |
| 胡德军 | 本基金的基金经理 | 2017 年 5 月 22 日 | 2021 年 9 月 22 日 | 11 年 | 国籍：中国。上海交通大学生物医学工程博士，曾任齐鲁证券有限公司研究所医药行业研究员，2013 年 6 月加入东海基金，历任公司研究开发部高级研究员、专户理财部投资经理等职。 |

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。

4.1.1 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。

4.2 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》、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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策与执行、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

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以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资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。本报告期内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 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年三季度，受到国内短期疫情影响，消费增长较弱。同时，能源等上游原材料价格持续上涨，对中下游制造业企业盈利造成挤压。另一方面，海外需求持续复苏，出口数据保持强劲。整体来看，宏观经济短期不确定性因素较多，经济增长面临一定压力。市场方面，A 股整体估值仍处于较高位置。因此在宏观经济具有一定不确定性的环境下，A 股市场三季度整体波动较大。本指数基金跟踪的中证社会发展安全产业主题指数，报告期内跟随市场震荡下跌，跌幅-5.93%。同期沪深 300 指数下跌 6.25%。年初至今市场结构化行情显著，周期类板块，包括化工、钢铁、采掘等受益于通胀压力的行业表现相对突出。但国内外经济正逐步从疫情后的复苏反弹向新常态

回归。长期来看，在经济产业结构调整的大趋势下，科技、环保等新兴产业仍具有显著的长期投资价值。而本指数基金跟踪的中证社会发展安全产业主题指数也部分涵盖了以上行业标的。具有一定的长期增长潜力。投资操作上，基金采用量化方法跟踪标的指数，目标将跟踪误差保持在合理范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7090 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.22%，业绩比较基准收益率为-7.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内，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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 21,328,199.23 | 91.30 |
| | 其中：股票 | 21,328,199.23 | 91.30 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,977,090.03 | 8.46 |
| 8 | 其他资产 | 55,136.02 | 0.24 |
| 9 | 合计 | 23,360,425.28 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 14,752,389.33 | 63.72 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 674,075.39 | 2.91 |
| 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 | 3,042,969.59 | 13.14 |
| 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 | 228,000.00 | 0.98 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,630,764.92 | 11.36 |
| 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 | 21,328,199.23 | 92.13 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 002415 | 海康威视 | 64,568 | 3,551,240.00 | 15.34 |
| 2 | 002690 | 美亚光电 | 84,793 | 3,224,677.79 | 13.93 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 002340 | 格林美 | 148,200 | 1,656,876.00 | 7.16 |
| 4 | 300572 | 安车检测 | 47,500 | 940,500.00 | 4.06 |
| 5 | 002049 | 紫光国微 | 3,060 | 632,808.00 | 2.73 |
| 6 | 002236 | 大华股份 | 26,063 | 618,214.36 | 2.67 |
| 7 | 000063 | 中兴通讯 | 15,300 | 506,889.00 | 2.19 |
| 8 | 300070 | 碧水源 | 54,700 | 425,019.00 | 1.84 |
| 9 | 603588 | 高能环境 | 25,014 | 420,985.62 | 1.82 |
| 10 | 600323 | 瀚蓝环境 | 15,732 | 416,898.00 | 1.80 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 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

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 858.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 184.56 |
| 5 | 应收申购款 | 54,093.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 55,136.02 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 34,071,978.76 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,257,404.40 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,686,240.85 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 32,643,142.31 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金设立的文件
- 2、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金基金合同》
- 3、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金招募说明书》
- 4、《东海中证社会发展安全产业主题指数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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2021 年 10 月 27 日