

东海科技动力混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：江苏银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
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.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59

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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 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	18,700,181.01 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	8,577,826.09 份	10,122,354.92 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	<p>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。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）科技动力主题的界定</p> <p>本基金所指的科技动力主题是指，主要包含以下两个层面：</p> <p>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</p>

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。

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、文旅旅游、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。

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。

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。

(2) 行业配置

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。

(3) 个股选择

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。

定量分析：

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。

(a) 成长指标：营业收入增长率、净利润增长率。

(b) 估值指标：市盈率、市盈率/净利润增长率。

(c) 财务指标：净资产收益率、资产负债率、毛利率、净利率。

定性分析：

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。

(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。

(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。

(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。

3、债券投资策略

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。

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

	<p>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。</p> <p>4、股指期货投资策略 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。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。</p> <p>5、资产支持证券投资策略 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。</p>	
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	Zhouhongl@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

§ 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	东海科技动力 A	东海科技动力 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,428,033.31	-4,798,038.79
本期利润	-2,047,771.32	-3,214,487.80
加权平均基金份额本期利润	-0.2505	-0.2849
本期加权平均净值利润率	-14.47%	-16.67%
本期基金份额净值增长率	-13.25%	-13.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	5,148,751.76	5,755,245.00
期末可供分配基金份额利润	0.6002	0.5686
期末基金资产净值	15,426,098.99	17,876,306.94
期末基金份额净值	1.7984	1.7660
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	79.84%	76.60%

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
过去一个月	13.90%	1.98%	6.71%	0.79%	7.19%	1.19%
过去三个月	3.28%	1.93%	4.27%	1.10%	-0.99%	0.83%
过去六个月	-13.25%	1.96%	-6.94%	1.10%	-6.31%	0.86%
过去一年	-9.14%	1.87%	-7.88%	0.91%	-1.26%	0.96%
过去三年	79.84%	1.71%	19.71%	0.94%	60.13%	0.77%

自基金合同生效起至今	79.84%	1.70%	20.07%	0.93%	59.77%	0.77%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

东海科技动力 C

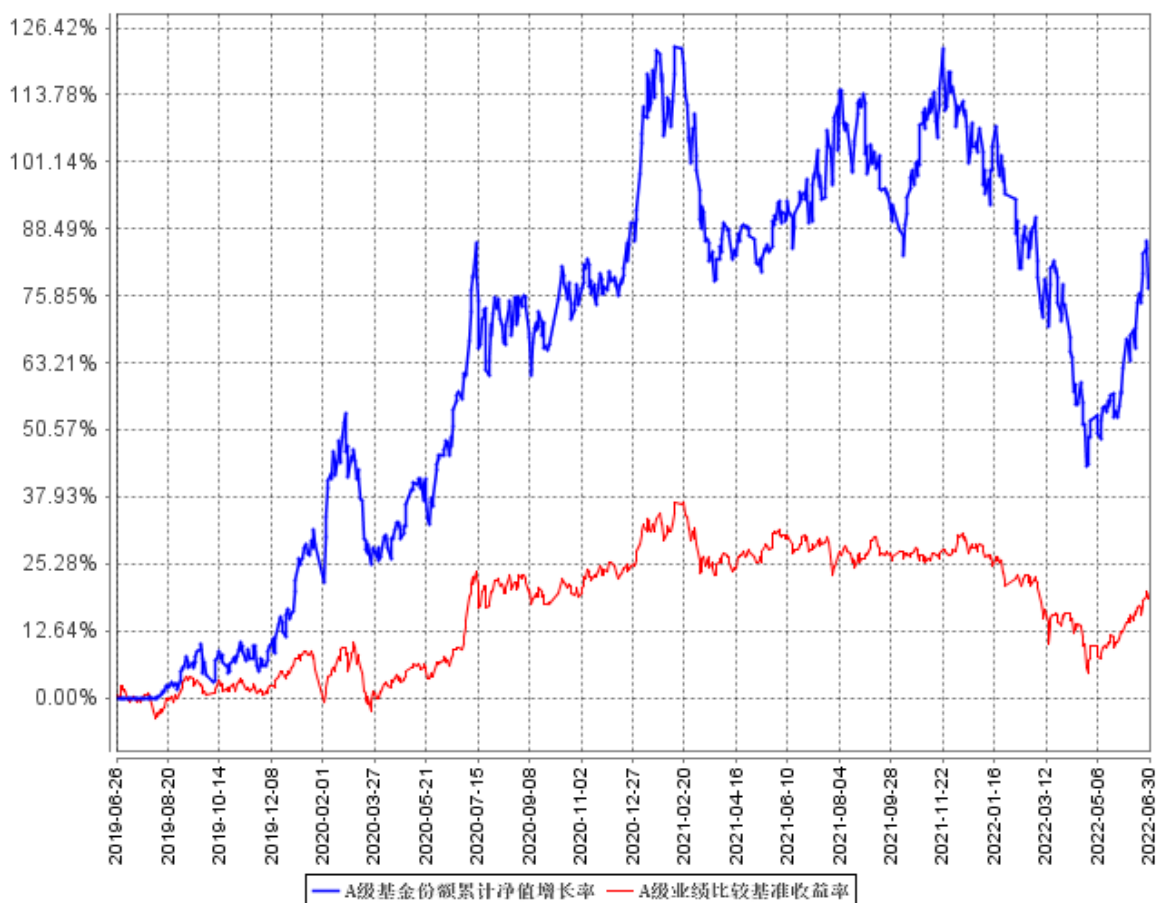
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	13.88%	1.98%	6.71%	0.79%	7.17%	1.19%
过去三个月	3.23%	1.93%	4.27%	1.10%	-1.04%	0.83%
过去六个月	-13.27%	1.96%	-6.94%	1.10%	-6.33%	0.86%
过去一年	-9.03%	1.87%	-7.88%	0.91%	-1.15%	0.96%
过去三年	76.62%	1.71%	19.71%	0.94%	56.91%	0.77%
自基金合同生效起至今	76.60%	1.70%	20.07%	0.93%	56.53%	0.77%

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；

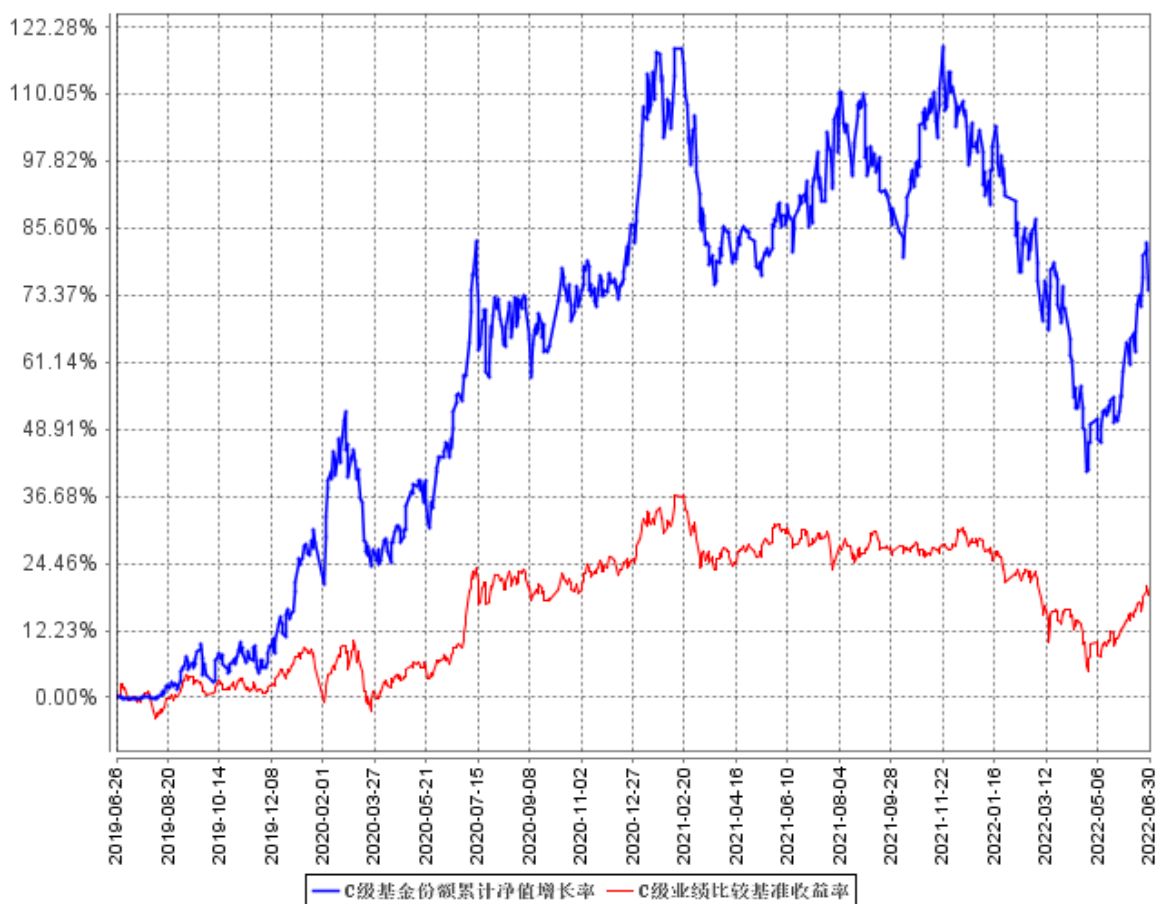
(2)本基金的业绩基准为：中证 800 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%。

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



3.3 其他指标

注：无

§ 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。

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。

4.2 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

上半年市场经历了比较大幅度的波动，背后的原因我们认为是以下几点：海外来看，美股通胀数据呈逐月上升态势，加息预期升温，俄乌战争爆发；国内疫情反复，上海及其他城市封城担忧对经济造成影响，因而资本市场反应剧烈，各类指数大幅下跌，而随着疫情的稳定，复工复产的逐步恢复，指数也率先从底部反弹，反弹幅度较大的板块也是跟经济和疫情影响最相关的一些板块，而汽车反弹力度最大，我们认为既符合前面的逻辑，也是政策支持力度最大的方向之一，同时从行业景气度看，也印证了这一逻辑。

二季度指数经历了快速下跌和暴力反弹，我们对组合进行了相应的调整，我们相信经历过政策托底，随着复工复产逐步开展，经济处在缓慢恢复中，更适合自下而上基于行业和基本面进行投资，主要看好新能源汽车产业链、光伏，军工，高端制造等景气度好且长期成长空间大的行业。

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 1.7984 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.25%；截至本报告期末东海科技动力 C 基金份额净值为 1.7660 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.27%；同期业绩比较基准收益率为-6.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自上而下角度来看，权益市场经历了上半年经济结构转型降速的预期下修，上海疫情封城带来的短期盈利预期、估值情绪的下杀，我们认为随着货币政策的宽松，对于经济最悲观的时期已经过去，预计下半年将继续维持宽松流动性，成长风格具备相对优势。成长方向中，我们依旧看好如新能源车、光伏、军工，高端制造等中观高景气度行业。

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

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。

4.8 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

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。

报告期内，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。本基金资产净值于 2022 年 1 月 1 日至报告期末均低于 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，本基金托管人一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，本基金托管人一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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东海科技动力混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,987,063.34	4,945,216.01
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	30,221,130.33	32,537,921.33
其中：股票投资		30,221,130.33	32,537,921.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		276,815.87	54,971.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	42,229.29	684.24
资产总计		33,527,238.83	37,538,793.36
负债和净资产			
负债：			
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		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		124,478.28	186,470.79
应付管理人报酬		32,573.27	37,399.15
应付托管费		5,428.85	6,233.20
应付销售服务费		2,995.20	4,109.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	59,357.30	90,014.13
负债合计		224,832.90	324,226.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	18,700,181.01	18,168,366.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,602,224.92	19,046,200.45
净资产合计		33,302,405.93	37,214,566.94
负债和净资产总计		33,527,238.83	37,538,793.36

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，东海科技动力 A 基金份额净值 1.7984 元，基金份额总额 8,577,826.09 份；东海科技动力 C 基金份额净值 1.7660 元，基金份额总额 10,122,354.92 份。东海科技动力份额总额合计为 18,700,181.01 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,928,346.70	2,228,916.06
1.利息收入		9,376.15	10,663.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,376.15	10,663.16
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）		-7,927,723.78	5,526,188.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,072,930.23	5,421,204.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	145,206.45	104,984.12
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,963,812.98	-3,404,456.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	26,187.95	96,520.96
减：二、营业总支出		333,912.42	501,560.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	199,204.81	190,568.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,200.84	31,761.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19,188.09	14,547.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	82,318.68	264,684.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,262,259.12	1,727,355.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,262,259.12	1,727,355.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,262,259.12	1,727,355.51

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基	18,168,366.49	-	19,046,200.45	37,214,566.94

金净值)				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	18,168,366.49	-	19,046,200.45	37,214,566.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	531,814.52	-	-4,443,975.53	-3,912,161.01
(一)、综合收益总额	-	-	-5,262,259.12	-5,262,259.12
(二)、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)	531,814.52	-	818,283.59	1,350,098.11
其中：1.基金申购款	12,547,567.61	-	9,972,235.40	22,519,803.01
2.基金赎回款	-12,015,753.09	-	-9,153,951.81	-21,169,704.90
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	18,700,181.01	-	14,602,224.92	33,302,405.93
项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	21,366,529.65	-	19,261,481.87	40,628,011.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	21,366,529.65	-	19,261,481.87	40,628,011.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,370,164.42	-	-4,857,183.91	-11,227,348.33
(一)、综合收益总额	-	-	1,727,355.51	1,727,355.51
(二)、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)	-6,370,164.42	-	-6,584,539.42	-12,954,703.84
其中：1.基金申购款	17,122,229.94	-	17,760,330.03	34,882,559.97
2.基金赎回款	-23,492,394.36	-	-24,344,869.45	-47,837,263.81
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	14,996,365.23	-	14,404,297.96	29,400,663.19

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：

严晓珺

基金管理人负责人

周华成

主管会计工作负责人

周华成

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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、《东海核心价值精选混合型证券投资基金基金合同》和更新的《东海核心价值精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、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%—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%。

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%—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%。

6.4.2 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。

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6.4.2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2022

年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信

用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 32,537,921.33 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 32,537,921.33 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

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》、《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。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	737,335.16
等于：本金	737,178.78
加：应计利息	156.38
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	2,249,728.18
等于：本金	2,249,471.29
加：应计利息	256.89
减：坏账准备	-
合计：	2,987,063.34

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,615,205.80	-	30,221,130.33	5,605,924.53
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	24,615,205.80	-	30,221,130.33	5,605,924.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有任何黄金衍生品。

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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度可比期间均未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	42,229.29
合计	42,229.29

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
其他应付款	4,800.00
预提费用	-
预提审计费用	14,876.39
预提信息披露费	39,671.58
合计	59,357.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东海科技动力 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	5,968,731.01	5,968,731.01
本期申购	4,122,606.87	4,122,606.87
本期赎回(以“-”号填列)	-1,513,511.79	-1,513,511.79
- 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	8,577,826.09	8,577,826.09

金额单位：人民币元

东海科技动力 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	12,199,635.48	12,199,635.48
本期申购	8,424,960.74	8,424,960.74
本期赎回(以“-”号填列)	-10,502,241.30	-10,502,241.30
- 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	10,122,354.92	10,122,354.92

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	5,989,626.58	414,984.81	6,404,611.39
本期利润	-3,428,033.31	1,380,261.99	-2,047,771.32
本期基金份额交易产生的变动数	2,587,158.49	-95,725.66	2,491,432.83
其中：基金申购款	3,764,643.48	-200,709.73	3,563,933.75
基金赎回款	-1,177,484.99	104,984.07	-1,072,500.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,148,751.76	1,699,521.14	6,848,272.90

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
本期期初	11,773,271.64	868,317.42	12,641,589.06
本期利润	-4,798,038.79	1,583,550.99	-3,214,487.80
本期基金份额交易产生的变动数	-1,219,987.85	-453,161.39	-1,673,149.24
其中：基金申购款	7,030,311.57	-622,009.92	6,408,301.65
基金赎回款	-8,250,299.42	168,848.53	-8,081,450.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,755,245.00	1,998,707.02	7,753,952.02

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	3,340.47
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	6,035.68
其他	-
合计	9,376.15

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,072,930.23
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-8,072,930.23

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	65,128,196.47
减：卖出股票成本总额	73,028,753.10
减：交易费用	172,373.60
买卖股票差价收入	-8,072,930.23

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

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-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证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资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金报告期及上年度可比期间未投资资产支持证券-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 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收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	145,206.45
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	145,206.45

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	2,963,812.98
——股票投资	2,963,812.98
——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	2,963,812.98

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	26,187.95
合计	26,187.95

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	67,442.29
证券出借违约金	-
合计	82,318.68

6.4.7.24 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

注：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

注：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：本基金本报告期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
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

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。

6.4.10.1.2 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。

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

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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	199,204.81	190,568.02
其中：支付销售机构的客户维护费	74,474.50	61,341.49

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30
----	--------------------------------	--

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	33,200.84	31,761.36

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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	-	60.60	60.60
东海证券股份有限公司	-	36.37	36.37
东海基金管理有限责任公司	-	522.32	522.32
合计	-	619.29	619.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	-	22.13	22.13
东海基金管理有限责任公司	-	1,746.91	1,746.91
合计	-	1,769.04	1,769.04

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。

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。

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自有资金投资本基金的情况**

注：本基金基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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末均未投资本基金。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
江苏银行	737,178.78	3,340.47	513,441.13	2,938.74

注：本基金通过“江苏银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于开源证券的结算备付金，于2022年6月30日的相关余额为人民币2249471.29元。（2021年6月30日：人民币2079290.66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：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2022 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金期末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

注：本基金报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

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，本基金无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

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

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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

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 2022 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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%。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

6.4.13.4 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，并按照合同约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

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	--------	-------	-------	-----	----

2022 年 6 月 30 日			年				
资产							
银行存款	2,987,063.34	-	-	-	-	-	2,987,063.34
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-30,221,130.33	30,221,130.33
应收申购款	-	-	-	-	-	276,815.87	276,815.87
其他资产	-	-	-	-	-	42,229.29	42,229.29
资产总计	2,987,063.34	-	-	-	-	-30,540,175.49	33,527,238.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	124,478.28	124,478.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,573.27	32,573.27
应付托管费	-	-	-	-	-	5,428.85	5,428.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,995.20	2,995.20
其他负债	-	-	-	-	-	59,357.30	59,357.30
负债总计	-	-	-	-	-	224,832.90	224,832.90
利率敏感度缺口	2,987,063.34	-	-	-	-	-30,315,342.59	33,302,405.93
上年度末 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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 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。

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

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。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	30,221,130.33	90.75	32,537,921.33	87.43
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	30,221,130.33	90.75	32,537,921.33	87.43

6.4.13.4.3.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准增加1%	402,847.67	455,238.06

	业绩比较基准减少 1%	-402,847.67	-455,238.06
--	-------------	-------------	-------------

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。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	30,221,130.33	32,534,863.28
第二层次	-	3,058.05
第三层次	-	-

合计	-	-
----	---	---

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表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	30,221,130.33	90.14
	其中：股票	30,221,130.33	90.14
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	2,987,063.34	8.91
8	其他各项资产	319,045.16	0.95
9	合计	33,527,238.83	100.00

7.2 报告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

金额单位：人民币元

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	30,221,130.33	90.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-

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	30,221,130.33	90.75

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

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	688377	迪威尔	80,000	2,476,000.00	7.43
2	002129	TCL 中环	30,300	1,784,367.00	5.36
3	300750	宁德时代	3,300	1,762,200.00	5.29
4	600522	中天科技	75,000	1,732,500.00	5.20
5	601137	博威合金	95,000	1,681,500.00	5.05
6	601012	隆基绿能	25,060	1,669,747.80	5.01
7	002920	德赛西威	11,000	1,628,000.00	4.89
8	000887	中鼎股份	86,000	1,568,640.00	4.71
9	688599	天合光能	23,000	1,500,750.00	4.51
10	300776	帝尔激光	8,000	1,382,400.00	4.15
11	300316	晶盛机电	19,500	1,318,005.00	3.96
12	002756	永兴材料	8,000	1,217,680.00	3.66
13	688598	金博股份	4,000	1,178,800.00	3.54
14	300724	捷佳伟创	12,000	1,072,200.00	3.22
15	002531	天顺风能	60,000	989,400.00	2.97
16	300850	新强联	11,000	979,330.00	2.94
17	603297	永新光学	8,000	893,680.00	2.68
18	300450	先导智能	14,000	884,520.00	2.66
19	600933	爱柯迪	50,000	819,000.00	2.46
20	600237	铜峰电子	98,000	805,560.00	2.42
21	688005	容百科技	6,000	776,640.00	2.33
22	002402	和而泰	40,000	762,400.00	2.29
23	688559	海目星	8,000	581,600.00	1.75

24	002466	天齐锂业	4,000	499,200.00	1.50
25	002484	江海股份	10,000	233,400.00	0.70
26	601089	福元医药	853	17,955.65	0.05
27	001268	联合精密	204	5,654.88	0.02

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

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	300316	晶盛机电	2,801,209.00	7.53
2	688599	天合光能	2,536,928.33	6.82
3	601012	隆基绿能	1,960,000.00	5.27
4	688005	容百科技	1,840,726.31	4.95
5	000887	中鼎股份	1,776,926.00	4.77
6	300750	宁德时代	1,694,706.00	4.55
7	600036	招商银行	1,670,093.00	4.49
8	002241	歌尔股份	1,590,222.00	4.27
9	300207	欣旺达	1,574,957.00	4.23
10	600933	爱柯迪	1,555,214.00	4.18
11	603363	傲农生物	1,528,887.80	4.11
12	002124	天邦食品	1,528,309.00	4.11
13	600522	中天科技	1,521,649.00	4.09
14	601137	博威合金	1,458,975.00	3.92
15	300776	帝尔激光	1,321,158.00	3.55
16	300850	新强联	1,301,266.90	3.50
17	002129	TCL 中环	1,216,854.00	3.27
18	300724	捷佳伟创	1,215,808.00	3.27
19	688598	金博股份	1,193,084.88	3.21
20	300138	晨光生物	1,121,462.00	3.01
21	002245	蔚蓝锂芯	1,082,050.00	2.91
22	002531	天顺风能	1,061,364.00	2.85
23	002906	华阳集团	975,820.00	2.62
24	002756	永兴材料	968,015.00	2.60
25	601166	兴业银行	962,208.00	2.59
26	000977	浪潮信息	925,566.00	2.49

27	600519	贵州茅台	892,836.00	2.40
28	603259	药明康德	890,251.00	2.39
29	603297	永新光学	841,566.00	2.26
30	002714	牧原股份	788,398.00	2.12
31	002475	立讯精密	780,128.00	2.10

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。

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

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	300316	晶盛机电	3,013,473.00	8.10
2	002245	蔚蓝锂芯	2,556,950.00	6.87
3	002241	歌尔股份	2,497,033.00	6.71
4	688005	容百科技	2,352,156.18	6.32
5	002714	牧原股份	1,744,896.00	4.69
6	603259	药明康德	1,650,118.00	4.43
7	300750	宁德时代	1,626,323.00	4.37
8	600036	招商银行	1,603,940.00	4.31
9	601012	隆基绿能	1,603,697.00	4.31
10	002459	晶澳科技	1,503,705.00	4.04
11	002124	天邦食品	1,501,600.00	4.03
12	300953	震裕科技	1,433,117.00	3.85
13	603363	傲农生物	1,384,417.85	3.72
14	600905	三峡能源	1,305,290.00	3.51
15	002484	江海股份	1,207,317.00	3.24
16	300138	晨光生物	1,109,811.30	2.98
17	300207	欣旺达	1,108,006.00	2.98
18	000887	中鼎股份	1,085,260.00	2.92
19	600150	中国船舶	1,073,679.00	2.89
20	000539	粤电力 A	1,058,600.00	2.84
21	002906	华阳集团	1,004,223.00	2.70
22	688599	天合光能	956,782.44	2.57
23	601166	兴业银行	913,005.00	2.45
24	600519	贵州茅台	874,314.00	2.35
25	603606	东方电缆	865,803.00	2.33
26	002555	三七互娱	860,542.00	2.31
27	300274	阳光电源	858,708.00	2.31

28	603596	伯特利	850,455.00	2.29
29	600745	闻泰科技	818,723.00	2.20
30	002039	黔源电力	780,502.00	2.10

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。

7.4.3 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	67,748,149.12
卖出股票收入（成交）总额	65,128,196.47

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。

7.5 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。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	276,815.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	42,229.29
8	其他	-
9	合计	319,045.16

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 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	1,368	6,270.34	0.00	0.00%	8,577,826.09	100.00%
东海科技动力 C	5,630	1,797.93	0.00	0.00%	10,122,354.92	100.00%
合计	6,998	2,672.22	0.00	0.00%	18,700,181.01	100.00%

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	392,075.17	4.5708%
	东海科技动力 C	143,594.44	1.4186%
	合计	535,669.61	2.8645%

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 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	5,968,731.01	12,199,635.48
本报告期基金总申购份额	4,122,606.87	8,424,960.74
减：本报告期基金总赎回份额	1,513,511.79	10,502,241.30
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	8,577,826.09	10,122,354.92

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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 2022 年 2 月 8 日发布公告，基金管理人法定代表人由赵俊先生变更为严晓珺女士。

2、基金管理人 2022 年 4 月 1 日发布公告，自 2022 年 3 月 30 日起，新任周华成先生担任基金管理人财务负责人。

3、基金托管人：本报告期内，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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
开源证券	2	132,791,624.05	100.00%	95,938.26	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) 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。

3、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
开源证券	-	-	-	-	-	-

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	东海基金管理有限责任公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 11 日
2	东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 1 月 24 日
3	东海基金管理有限责任公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 8 日
4	东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 31 日
5	东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 1 日
6	东海科技动力混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
7	东海基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金长期停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 27 日
8	东海科技动力混合型证券投资基金（东海科技动力 A 份	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 29 日

	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)		
9	东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增北京汇成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	中国证监会指定报刊及网站	2022年6月28日
10	东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增上海联泰基金销售有限公司为为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年6月30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

注：报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

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

2022 年 8 月 31 日