

# 东海中证社会发展安全产业主题指数型证 券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 市场中性策略执行情况.....	44
7.13 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金
基金简称	东海社会安全
场内简称	-
基金主代码	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
基金管理人	东海基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,031,057.47 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	-

### 2.2 基金产品说明

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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东海基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王恒	郭明
	联系电话	021-60586966	010-66105799
	电子邮箱	wangheng@donghaifunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-9595531	95588
传真		021-60586926	010-66105798
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		赵俊	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	121,658.87
本期利润	3,755,735.89
加权平均基金份额本期利润	0.0697
本期加权平均净值利润率	9.70%
本期基金份额净值增长率	9.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-24,018,571.91
期末可供分配基金份额利润	-0.4801
期末基金资产净值	37,299,984.99
期末基金份额净值	0.7460
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.40%

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。

#### 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	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	8.43%	0.93%	8.74%	0.96%	-0.31%	-0.03%
过去三个月	12.69%	1.33%	12.11%	1.30%	0.58%	0.03%
过去六个月	9.71%	2.01%	9.50%	1.97%	0.21%	0.04%
过去一年	15.30%	1.67%	13.76%	1.64%	1.54%	0.03%
过去三年	-6.75%	1.59%	-7.82%	1.62%	1.07%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-25.40%	1.61%	-25.45%	1.67%	0.05%	-0.06%

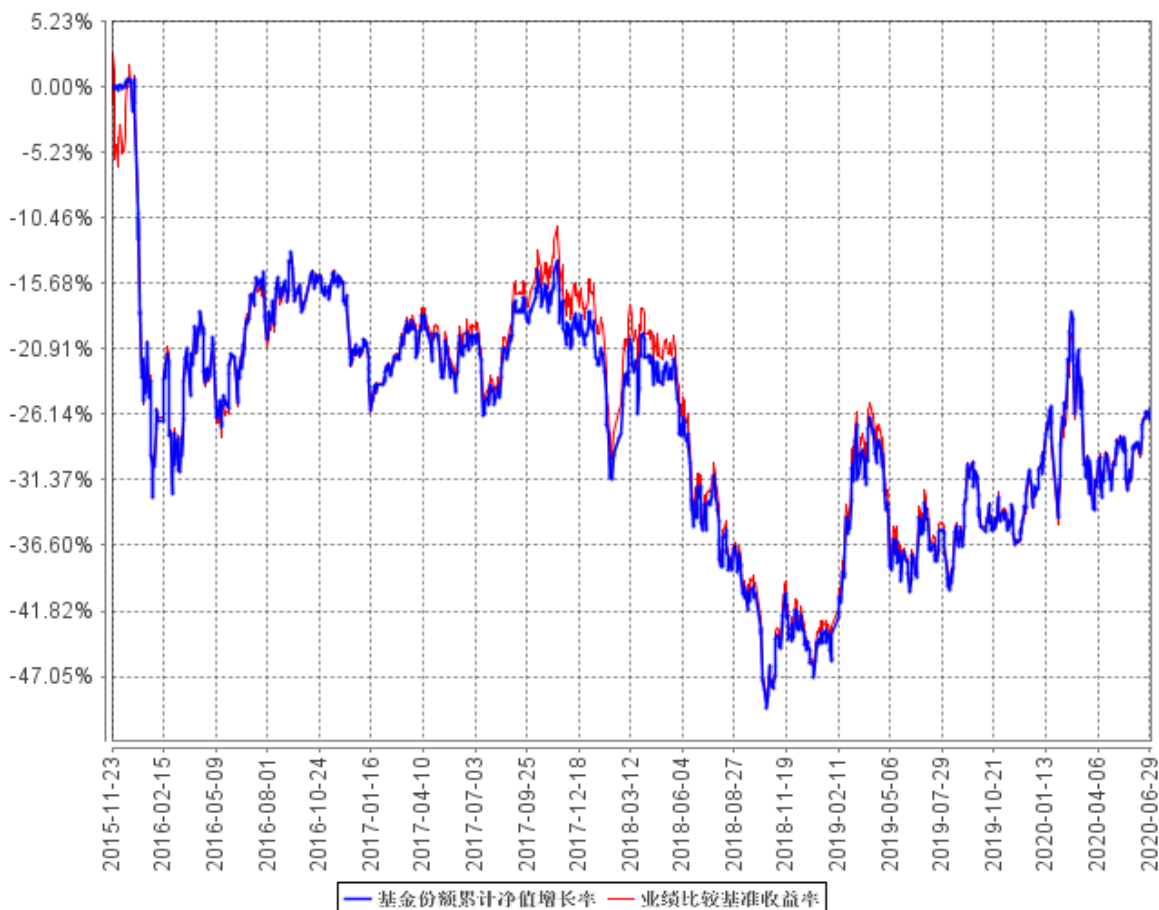
注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；



(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%。

### 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

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



(1) 本基金基金合同生效日为 2015 年 11 月 23 日。

(2) 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证安全指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### 3.3 其他指标

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡德军	本基金的基金经理	2017 年 5 月 22 日	-	10 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。现任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东海中证社会发展安全产业主题指数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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 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

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，并定期分析组合间的同向交易。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。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年新冠疫情快速席卷全球，资本市场经历了史诗级的大波动与大反转。期间，市场核心矛盾始终围绕疫情，基本面预期与政策均随之而变。疫情放大了经济周期的波动；各国政策力度不同，针对疫情采取了不同策略；疫情催化了一系列新业态，加速了部分行业的集中。我们紧跟海内外疫情形势、复工复产进度以及主要经济体政策应对情况。从市场运行看，我们较准

确把握了国内形势好转以及海外应对政策超预期后的市场机会，这两个阶段权益资产均有系统性收益。东海中证社会发展安全作为被动指数基金主要跟踪中证社会发展安全产业主题指数，由于中证社会发展安全产业主题指数成分中包含了较多的安防、环保等行业的公司，本报告期内，本基金表现一般。

#### 4.4.2 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 0.7460 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.71%，业绩比较基准收益率为 9.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了上半年疫情之后，国内经济稳步恢复，复工复产逐渐好转，二季度经济增长明显好于预期，但是各个行业复苏出现了明显的差别。科技行业的生产与投资、疫情催化下的新业态以及地产销售恢复程度较好，消费行业内部分化也逐步加大。在“房住不炒”的大背景下，深圳、南京为代表的城市基本都采取了收紧地产的政策，政策防止地产过热的信号强烈，传统经济缺乏向上弹性。中期维度来看，高技术产业、新老基建投资、部分可选消费等仍将是驱动经济修复的主要力量，疫情受损与受益行业的分化仍会持续一段时间。

从外围情况来看，疫情仍在部分发达国家和发展中国家肆虐，发达经济体疫情呈现致死程度减轻、年轻化等特点，而新兴经济体部分国家仍在爆发的过程中。以美国为代表的部分国家经济活动已开始受到疫情二次爆发影响，因此，海外的宽松政策退出之时尚早。未来，美国第二轮财政刺激计划即将落地，美联储货币政策持续宽松以应对不确定性，外需大幅回落的概率已不大。而中国、美国等国家新冠疫苗已进入三期临床测试阶段，未来半年落地概率较高。因此从中期维度来看，全球经济延续修复与政策温和退出将是大概率事件。

展望未来一个季度，A 股流动性仍旧充裕。居民存款搬家以及理财产品净值化等大趋势下，公募基金等构成今年 A 股市场的主要增量资金，结构性行情仍将延续。我们预计市场风格不会有大切换，但低估值板块具备一定风险再平衡作用。驱动本轮成长股（大消费与大科技，以创业板指为代表）走牛的核心原因来自长期低利率环境、科技创新周期、消费升级、经济转型与资本市场改革带来的盈利预期提升。目前看，这些中长期因素并未出现大的变化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

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；本基金资产净值于 2020 年 1 月 2 日低于 5000 万元以下，截至报告期末，已持续 117 个工作日。本基金管理人已经将该基金情况向证监会报备，将持续关注本基金资产净值情况，下一步基金管理人将进行持续营销，力争基金净值尽快回升并稳定在五千万以上。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金的管理人—东海基金管理有限公司在东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东海基金管理有限公司编制和披露的东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,465,984.69	2,744,499.90
结算备付金		-	-
存出保证金		2,240.17	786.36
交易性金融资产	6.4.7.2	34,940,483.14	38,576,031.54
其中：股票投资		34,940,483.14	38,576,031.54
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		66,103.34	-
应收利息	6.4.7.5	279.97	579.68
应收股利		-	-
应收申购款		59,183.85	2,197.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		37,534,275.16	41,324,094.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,837.46	-
应付赎回款		43,637.70	27,547.06
应付管理人报酬		24,123.04	28,081.76
应付托管费		3,015.37	3,510.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	50,496.79	99,964.03
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,179.81	100,001.42
负债合计		234,290.17	259,104.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	50,031,057.47	60,372,932.22
未分配利润	6.4.7.10	-12,731,072.48	-19,307,941.86
所有者权益合计		37,299,984.99	41,064,990.36
负债和所有者权益总计		37,534,275.16	41,324,094.84

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7460 元，基金份额总额 50,031,057.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		4,125,287.61	8,012,050.00
1.利息收入		7,620.69	12,117.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,620.69	12,117.75
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）		459,762.78	-5,129,621.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	184,630.68	-5,418,577.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	275,132.10	288,955.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,634,077.02	13,095,528.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,827.12	34,024.84
<b>减：二、费用</b>		369,551.72	370,724.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	154,254.46	171,031.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,281.82	21,378.92

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	56,684.12	43,446.05
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	6.4.7.20	139,331.32	134,868.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,755,735.89</b>	<b>7,641,325.32</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,755,735.89</b>	<b>7,641,325.32</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	60,372,932.22	-19,307,941.86	41,064,990.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,755,735.89	3,755,735.89
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）	-10,341,874.75	2,821,133.49	-7,520,741.26
其中：1.基金申购款	6,201,599.68	-1,647,607.57	4,553,992.11
2.基金赎回款	-16,543,474.43	4,468,741.06	-12,074,733.37
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）	50,031,057.47	-12,731,072.48	37,299,984.99
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	70,255,793.15	-32,290,255.49	37,965,537.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,641,325.32	7,641,325.32
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)	-5,548,624.50	1,737,228.68	-3,811,395.82
其中：1.基金申购款	7,009,805.60	-2,298,097.86	4,711,707.74
2.基金赎回款	-12,558,430.10	4,035,326.54	-8,523,103.56
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)	64,707,168.65	-22,911,701.49	41,795,467.16

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：

          赵俊  邓升军  刘宇            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2158 号文《关于准予东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人东海基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 11 月 23 日正式生效。首次设立募集规模为 310,604,096.49 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及注册登记机构均为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证安全指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、债券、债券回购、权

证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金业绩比较基准：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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、

财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股

期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,465,984.69
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,465,984.69

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,274,040.44	34,940,483.14	3,666,442.70
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		31,274,040.44	34,940,483.14	3,666,442.70

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均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：本基金本报告期末及上年度可比期间均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	278.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
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	1.00
合计	279.97

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	50,496.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	50,496.79

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,169.32
应付指数使用费	50,000.00
合计	109,179.81

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,372,932.22	60,372,932.22
本期申购	6,201,599.68	6,201,599.68
本期赎回(以“-”号填列)	-16,543,474.43	-16,543,474.43
- 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	50,031,057.47	50,031,057.47

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-29,153,882.38	9,845,940.52	-19,307,941.86
本期利润	121,658.87	3,634,077.02	3,755,735.89
本期基金份额交易	5,013,651.60	-2,192,518.11	2,821,133.49



产生的变动数			
其中：基金申购款	-2,989,530.89	1,341,923.32	-1,647,607.57
基金赎回款	8,003,182.49	-3,534,441.43	4,468,741.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,018,571.91	11,287,499.43	-12,731,072.48

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	7,558.73
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	47.45
其他	14.51
合计	7,620.69

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	22,290,038.40
减：卖出股票成本总额	22,105,407.72
买卖股票差价收入	184,630.68

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 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。

##### 6.4.7.13.3 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。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金报告期及上年度可比期间未投资资产支持证券。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期间无衍生工具-其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	275,132.10
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	275,132.10

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,634,077.02
——股票投资	3,634,077.02
——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	3,634,077.02

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	23,827.12
合计	23,827.12

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	56,684.12
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	56,684.12

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	14,306.30
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	162.00
指数使用费	100,000.00
合计	139,331.32

#### 6.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期间无分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期末无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方进行过交易。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东海证券股份有限公司	-	-	73.13	0.14%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东海证券股份有限公司	-	-	73.13	0.06%

### 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	154,254.46	171,031.53
其中：支付销售机构的客户维护费	15,401.33	16,327.40

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 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.8%/当年天数

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,281.82	21,378.92

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数

**6.4.10.2.3 销售服务费**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

**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**

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

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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**

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。

**6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,465,984.69	7,558.73	3,388,586.03	12,005.21

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	563	5,635.63	5,635.63	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	235	4,143.05	4,143.05	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	592	3,516.48	3,516.48	-

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如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金报告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**

本基金报告期末未从事银行间市场债券正回购。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金报告期末未从事交易所市场债券正回购。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

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

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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



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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，建立流动性风险监控与预警机制，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定现金头寸，并且可在需要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 2020 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，并按照合约规定的利率重新定价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 2020年6月30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	2,465,984.69	-	-	-	-	-	2,465,984.69
存出保证金	2,240.17	-	-	-	-	-	2,240.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	34,940,483.14	34,940,483.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-	66,103.34	66,103.34
应收利息	-	-	-	-	-	279.97	279.97
应收申购款	-	-	-	-	-	59,183.85	59,183.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,468,224.86	-	-	-	-	35,066,050.30	37,534,275.16
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,837.46	3,837.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	43,637.70	43,637.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,123.04	24,123.04
应付托管费	-	-	-	-	-	3,015.37	3,015.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,496.79	50,496.79
其他负债	-	-	-	-	-	59,179.81	59,179.81

负债总计	-	-	-	-	-	234,290.17	234,290.17
利率敏感度缺口	2,468,224.86	-	-	-	-	-34,831,760.13	37,299,984.99
上年度末 2019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	2,744,499.90	-	-	-	-	-	2,744,499.90
存出保证金	786.36	-	-	-	-	-	786.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-38,576,031.54	38,576,031.54
应收利息	-	-	-	-	-	579.68	579.68
应收申购款	-	-	-	-	-	2,197.36	2,197.36
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,745,286.26	-	-	-	-	-38,578,808.58	41,324,094.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,547.06	27,547.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,081.76	28,081.76
应付托管费	-	-	-	-	-	3,510.21	3,510.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	99,964.03	99,964.03
其他负债	-	-	-	-	-	100,001.42	100,001.42
负债总计	-	-	-	-	-	259,104.48	259,104.48
利率敏感度缺口	2,745,286.26	-	-	-	-	-38,319,704.10	41,064,990.36

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	34,940,483.14	93.67	38,576,031.54	93.94
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	34,940,483.14	93.67	38,576,031.54	93.94

## 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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 1%	380,198.35	405,566.79
	业绩比较基准减少 1%	-380,198.35	-405,566.79

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

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	34,940,483.14	93.09
	其中：股票	34,940,483.14	93.09
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	2,465,984.69	6.57
8	其他各项资产	127,807.33	0.34
9	合计	37,534,275.16	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	22,779,869.74	61.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,115,212.40	2.99
E	建筑业	200,962.44	0.54
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	7,379,894.44	19.79
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	759,966.96	2.04
N	水利、环境和公共设施管理业	2,554,337.16	6.85
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	150,240.00	0.40
	合计	34,940,483.14	93.67

### 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沪港通股票。

### 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	002690	美亚光电	102,693	5,401,651.80	14.48
2	002415	海康威视	112,593	3,417,197.55	9.16
3	300572	安车检测	43,800	2,783,490.00	7.46
4	002236	大华股份	56,363	1,082,733.23	2.90
5	002340	格林美	195,500	971,635.00	2.60
6	000063	中兴通讯	23,000	922,990.00	2.47
7	600570	恒生电子	7,800	840,060.00	2.25
8	300070	碧水源	94,015	763,401.80	2.05
9	300215	电科院	122,972	759,966.96	2.04
10	600845	宝信软件	11,240	664,059.20	1.78
11	600588	用友网络	15,000	661,500.00	1.77
12	002414	高德红外	19,900	582,672.00	1.56
13	002373	千方科技	23,300	558,967.00	1.50
14	600100	同方股份	73,586	536,441.94	1.44
15	600323	瀚蓝环境	24,432	534,572.16	1.43
16	600008	首创股份	154,300	464,443.00	1.25
17	603686	龙马环卫	18,320	446,458.40	1.20
18	600584	长电科技	13,615	425,741.05	1.14
19	000598	兴蓉环境	90,109	414,501.40	1.11
20	000977	浪潮信息	10,269	402,339.42	1.08
21	603160	汇顶科技	1,800	401,220.00	1.08
22	300454	深信服	1,800	370,728.00	0.99
23	603019	中科曙光	9,400	360,960.00	0.97
24	002049	紫光国微	4,760	346,290.00	0.93
25	300203	聚光科技	18,876	315,795.48	0.85

26	300078	思创医惠	23,000	311,190.00	0.83
27	300098	高新兴	50,421	305,551.26	0.82
28	002912	中新赛克	1,800	294,462.00	0.79
29	002439	启明星辰	6,700	281,869.00	0.76
30	002214	大立科技	9,700	273,346.00	0.73
31	603568	伟明环保	11,569	268,400.80	0.72
32	002396	星网锐捷	7,500	264,975.00	0.71
33	002212	南洋股份	9,900	263,142.00	0.71
34	002672	东江环保	25,555	230,250.55	0.62
35	300383	光环新网	8,800	229,416.00	0.62
36	300190	维尔利	27,700	209,135.00	0.56
37	600728	佳都科技	22,700	206,797.00	0.55
38	300055	万邦达	32,837	200,962.44	0.54
39	002065	东华软件	16,000	200,320.00	0.54
40	600874	创业环保	29,700	197,208.00	0.53
41	603588	高能环境	16,780	195,654.80	0.52
42	601360	三六零	10,641	194,836.71	0.52
43	600602	云赛智联	26,263	190,669.38	0.51
44	300053	欧比特	17,550	190,593.00	0.51
45	600536	中国软件	2,400	190,080.00	0.51
46	600388	龙净环保	21,068	185,398.40	0.50
47	000066	中国长城	14,000	184,800.00	0.50
48	600498	烽火通信	6,228	180,051.48	0.48
49	300101	振芯科技	16,253	179,595.65	0.48
50	300523	辰安科技	3,780	177,055.20	0.47
51	000988	华工科技	6,900	168,567.00	0.45
52	002609	捷顺科技	13,100	167,025.00	0.45
53	300738	奥飞数据	2,890	166,695.20	0.45
54	601698	中国卫通	9,100	163,891.00	0.44
55	600990	四创电子	3,900	154,830.00	0.42
56	600118	中国卫星	4,900	151,067.00	0.41
57	600770	综艺股份	31,300	150,240.00	0.40
58	300010	立思辰	7,500	146,775.00	0.39
59	601200	上海环境	12,178	146,136.00	0.39
60	300017	网宿科技	17,200	146,028.00	0.39
61	300223	北京君正	1,399	141,215.06	0.38
62	002268	卫士通	6,560	139,990.40	0.38
63	600217	中再资环	28,400	136,888.00	0.37
64	600855	航天长峰	8,600	136,740.00	0.37



65	603660	苏州科达	14,432	132,341.44	0.35
66	300145	中金环境	40,300	125,736.00	0.34
67	300379	东方通	2,800	120,484.00	0.32
68	300140	中环装备	13,400	120,332.00	0.32
69	000826	启迪环境	16,210	120,278.20	0.32
70	300369	绿盟科技	5,159	120,153.11	0.32
71	002152	广电运通	9,100	117,754.00	0.32
72	300448	浩云科技	12,100	115,555.00	0.31
73	300266	兴源环境	34,111	111,884.08	0.30
74	600460	士兰微	7,572	111,156.96	0.30
75	002573	清新环境	19,542	106,699.32	0.29
76	603508	思维列控	3,057	102,837.48	0.28
77	300579	数字认证	2,500	101,825.00	0.27
78	300603	立昂技术	3,400	99,722.00	0.27
79	000967	盈峰环境	11,900	98,175.00	0.26
80	002151	北斗星通	3,026	96,922.78	0.26
81	002528	英飞拓	19,600	92,512.00	0.25
82	300324	旋极信息	13,860	92,307.60	0.25
83	300352	北信源	12,912	91,029.60	0.24
84	300188	美亚柏科	4,371	86,676.93	0.23
85	300458	全志科技	2,318	85,302.40	0.23
86	600776	东方通信	4,700	70,923.00	0.19
87	600360	华微电子	7,044	60,860.16	0.16
88	300465	高伟达	3,080	42,750.40	0.11
89	000544	中原环保	6,000	39,060.00	0.10
90	300229	拓尔思	3,350	38,458.00	0.10
91	002298	中电兴发	4,700	38,211.00	0.10
92	300386	飞天诚信	2,124	36,362.88	0.10
93	300311	任子行	5,067	35,722.35	0.10
94	300531	优博讯	1,700	35,360.00	0.09
95	300297	蓝盾股份	8,170	32,761.70	0.09
96	600734	*ST 实达	12,800	28,160.00	0.08
97	300768	迪普科技	500	23,145.00	0.06
98	300205	天喻信息	1,500	15,600.00	0.04
99	002986	宇新股份	189	9,535.05	0.03
100	300842	帝科股份	227	9,243.44	0.02
101	300839	博汇股份	251	5,875.91	0.02
102	300843	胜蓝股份	563	5,635.63	0.02
103	300845	捷安高科	235	4,143.05	0.01

104	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01
105	300840	酷特智能	592	3,516.48	0.01

## 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	300572	安车检测	2,179,993.00	5.31
2	002690	美亚光电	2,123,694.10	5.17
3	002373	千方科技	1,024,787.93	2.50
4	000063	中兴通讯	957,509.00	2.33
5	002340	格林美	921,934.00	2.25
6	600570	恒生电子	733,632.00	1.79
7	600588	用友网络	571,474.00	1.39
8	300140	中环装备	559,915.00	1.36
9	002414	高德红外	533,296.00	1.30
10	300070	碧水源	527,759.00	1.29
11	603019	中科曙光	366,206.00	0.89
12	600100	同方股份	359,489.06	0.88
13	000598	兴蓉环境	357,342.00	0.87
14	300454	深信服	285,210.00	0.69
15	002396	星网锐捷	254,873.00	0.62
16	002672	东江环保	220,864.00	0.54
17	300383	光环新网	218,984.00	0.53
18	300190	维尔利	203,898.00	0.50
19	603686	龙马环卫	184,604.00	0.45
20	000066	中国长城	182,840.00	0.45

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	300203	聚光科技	1,348,337.96	3.28
2	002415	海康威视	1,198,699.00	2.92

3	000977	浪潮信息	1,105,858.00	2.69
4	300137	先河环保	1,036,527.85	2.52
5	300007	汉威科技	1,027,864.16	2.50
6	600584	长电科技	976,727.00	2.38
7	600845	宝信软件	873,196.00	2.13
8	603160	汇顶科技	869,786.00	2.12
9	002690	美亚光电	867,920.43	2.11
10	002049	紫光国微	615,211.00	1.50
11	603508	思维列控	608,129.40	1.48
12	002439	启明星辰	581,673.00	1.42
13	600100	同方股份	562,509.00	1.37
14	002373	千方科技	521,932.00	1.27
15	600498	烽火通信	511,979.60	1.25
16	002212	南洋股份	427,102.00	1.04
17	002268	卫士通	339,549.54	0.83
18	300070	碧水源	311,899.00	0.76
19	002236	大华股份	310,636.00	0.76
20	000685	中山公用	301,066.30	0.73

注：“卖出金额”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。

#### 7.4.3 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	14,835,782.30
卖出股票收入（成交）总额	22,290,038.40

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内及上年度可比期间未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 市场中性策略执行情况

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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

2020年3月14日，海康威视（证券代码：002415.SZ）发布公告，海康威视董事龚虹嘉先生、胡扬忠先生于2020年3月13日收到《中国证券监督管理委员会结案告知书》（以下简称《结案告知书》），以及《中国证券监督管理委员会浙江监管局行政监管措施决定书》（[2020]16号）（以下简称《决定书》）——关于对龚虹嘉、胡扬忠采取出具警示函措施的决定：公司副董事长龚虹嘉、总经理胡扬忠在增减持股份过程中未向海康威视报告为他人提供融资安排的情况，导致上市公司未能真实、准确、完整地披露相关信息，违反了《上市公司信息披露管理办法》第三条规定，决定对龚虹嘉、胡扬忠采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。同时，要求龚虹嘉、胡扬忠于2020年3月20日前向浙江证监局提交书面整改报告。

本基金投研人员分析认为，海康威视受到中国证监会浙江监管局的行政监管措施决定书对公司副董事长龚虹嘉、总经理胡扬忠在增减持股份过程中未向海康威视报告为他人提供融资安排的情况，是针对管理层个人的处罚措施，对公司持续经营不产生重大影响，不影响公司主营业务。

本基金基金经理根据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对海康威视进行了投资。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	2,240.17
2	应收证券清算款	66,103.34
3	应收股利	-
4	应收利息	279.97
5	应收申购款	59,183.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	127,807.33

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末持有的前十名股票不存在流通受限的情况。

## § 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

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
1,333	37,532.68	2,982,597.36	5.96%	47,048,460.11	94.04%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	120,320.30	0.2405%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 11 月 23 日 ）基金份额总额	310,604,096.49
本报告期期初基金份额总额	60,372,932.22
本报告期基金总申购份额	6,201,599.68
减：本报告期基金总赎回份额	16,543,474.43
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	50,031,057.47

## § 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 2020 年 4 月 20 日发布公告，自 2020 年 4 月 17 日起新任苏尚才先生为基金管理人副总经理。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中航证券	2	18,156,453.80	49.05%	16,545.96	53.18%	-
长江证券	1	6,491,904.56	17.54%	4,734.61	15.22%	-
银河证券	1	6,207,044.56	16.77%	4,415.24	14.19%	-
海通证券	2	2,836,558.97	7.66%	2,641.75	8.49%	-
广发证券	2	1,561,241.00	4.22%	1,422.80	4.57%	-
恒泰证券	2	1,288,159.60	3.48%	916.34	2.95%	-
宏源证券	2	477,477.00	1.29%	435.14	1.40%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-



华鑫证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中航证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 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旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》、《东海美丽中国灵活配置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	2020 年 1 月 17 日
2	《东海基金管理有限责任公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修订旗下基金基金合同的公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日
3	《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》、《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》、《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更新(2020 年第 1 号)》、《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摘要更新(2020 年第 1 号)》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日
4	《东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司开通基金定投业务及开展费率优惠活动的公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 2 月 22 日
5	《东海基金管理有限责任公司关于不法分子冒用我司名义的澄清公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 6 日
6	《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》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 17 日
7	《东海基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日
8	《东海基金管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 4 日
9	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增大连网金基金销售有限公司为代销机构并参加费	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 14 日

	率优惠的公告》		
10	《东海基金管理有限责任公司副总经理任职的公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
11	《东海基金管理有限责任公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2019 年度报告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 21 日
12	《东海基金管理有限责任公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
13	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增恒泰证券股份有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告》	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 25 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：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。

### 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处

### 12.3 查阅方式

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

东海基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 29 日