

东海科技动力混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 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

报告送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东海科技动力	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	14,996,365.23 份	
投资目标	本基金重点投资于具备以科技和创新为动力和支撑，具有核心科技优势或创新优势的优质上市公司，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值	
投资策略	在历经多年的高速增长之后，中国经济的转型升级已成为必然。科技是第一生产力；从量变到质变，科技肩负的重任不言而喻。信息产业、新能源及新材料、生命科学及生物工程、高端及智能制造等，承载着新经济的发展动能，更可称之为未来国之竞争本源。因此，立足本土的科技动力型企业发展势必成为关键。本基金将挖掘这一主题机会，伴随中国经济迈上新台阶之余，为投资者带来长期稳定的价值增值。	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	东海科技动力 A	东海科技动力 C

下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	007439	007463
报告期末下属分级基金的份额总额	7,598,042.71 份	7,398,322.52 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§ 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4月1日—2021年6月30日）	
	东海科技动力 A	东海科技动力 C
1. 本期已实现收益	-1,101,951.51	-803,776.09
2. 本期利润	1,080,682.99	840,424.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1372	0.1445
4. 期末基金资产净值	15,038,649.62	14,362,013.57
5. 期末基金份额净值	1.9793	1.9413

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

东海科技动力 A

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	7.57%	1.09%	3.85%	0.66%	3.72%	0.43%
过去六个月	3.06%	1.57%	2.00%	0.91%	1.06%	0.66%
过去一年	23.22%	1.69%	18.14%	0.96%	5.08%	0.73%
自基金合同生效起至今	97.93%	1.61%	30.33%	0.94%	67.60%	0.67%

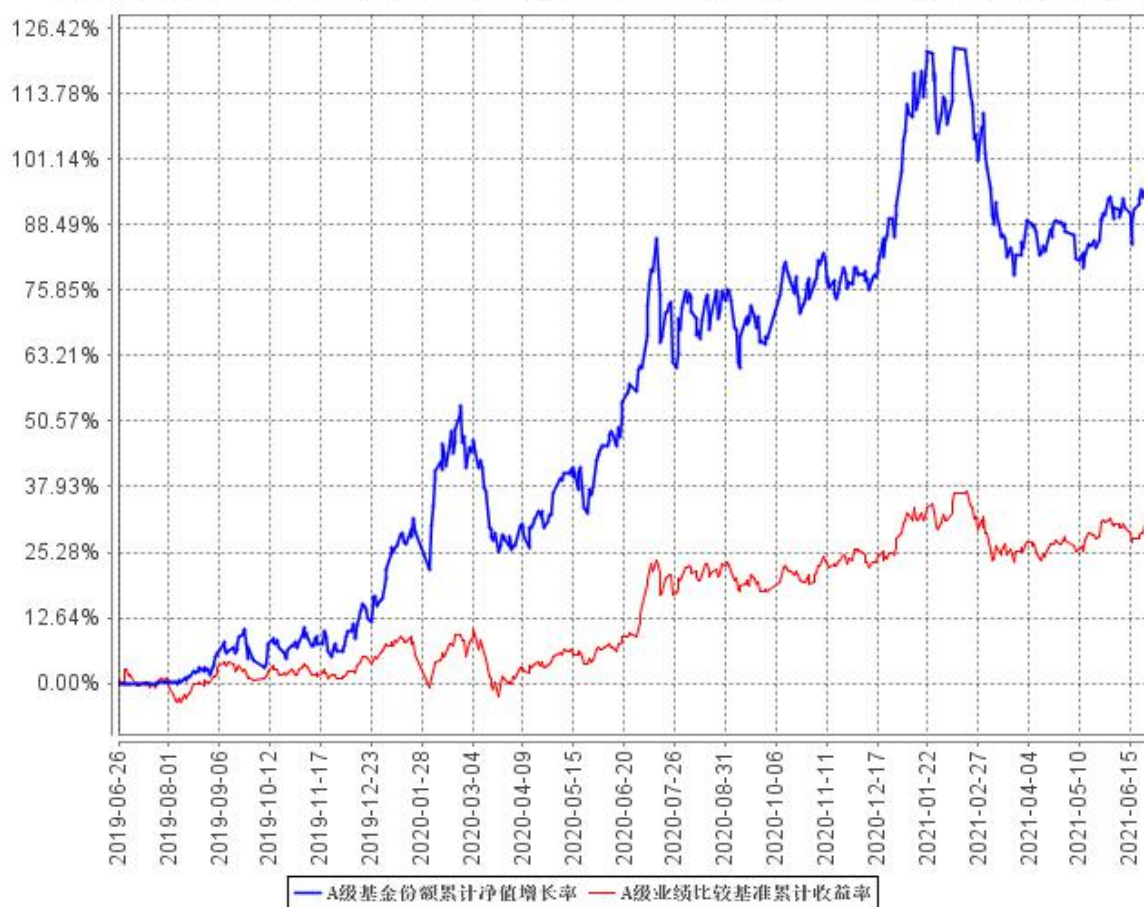
东海科技动力 C

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	7.49%	1.09%	3.85%	0.66%	3.64%	0.43%
过去六个月	2.96%	1.57%	2.00%	0.91%	0.96%	0.66%

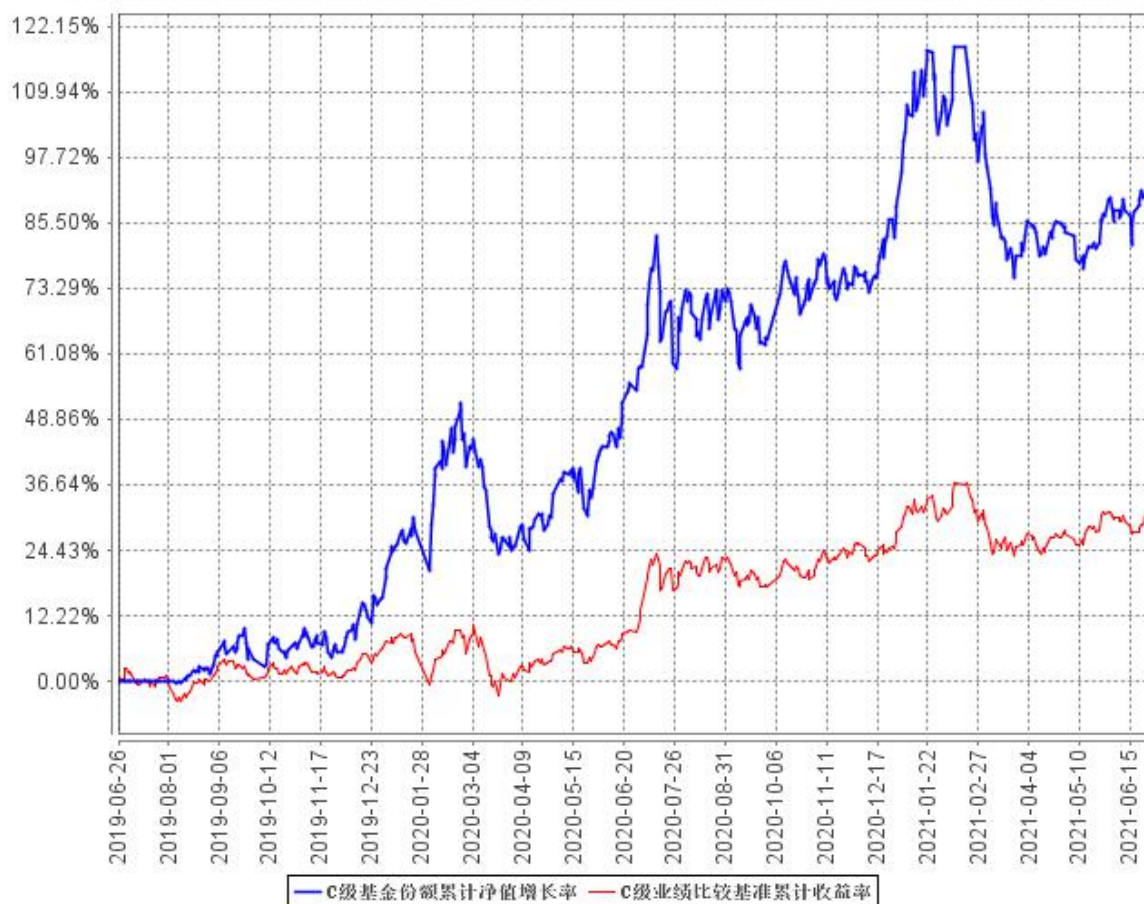
过去一年	22.60%	1.69%	18.14%	0.96%	4.46%	0.73%
自基金合同生效起至今	94.13%	1.61%	30.33%	0.94%	63.80%	0.67%

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

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



注：（1）本基金基金合同生效日为 2019 年 6 月 26 日，图示日期为 2019 年 6 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日；

（2）本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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		
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等职务。现任东海基金管理有限责任公司研究开发部负责人，担任东海科技动力混合型证券投资基金基金经理。
李昂	本基金的基金经理	2021 年 1 月 4 日	2021 年 5 月 11 日	5 年	国籍：中国。硕士，2015 年 10 月加入东海基金管理有限责任公司，历任公司 TMT 行业研究员、基金经理助理等职。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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 年上半年表现最好的两类资产，一类是创业板，这类企业的盈利从底部开始显著回升。当前经济处于转型期，各类技术和政策性主题也层出不穷，为市场的结构性活跃提供了支撑。全球的流动性充裕，利率处于低位，使得这类高成长类资产有很好的价格弹性。这类新经济代表的企业，接下来还会有很多的发展机会。另一类是传统周期大宗商品，大宗商品整体受益于全球流动性、全球经济复苏，再加上国内碳中和政策强化了供需结构错配的矛盾。这类企业的一季报整体数据好，给了市场盈利支撑。随着全球供给能力的逐步恢复，预计大宗商品将会逐步放缓并下行。

宏观经济整体接下来动能温和放缓，PPI 同比相比 5 月份的高点将逐步下行但仍会维持较高水平，美国的 TAPER 预期实施，将或使得美元流动性边际收紧，在权益市场上，海外利率的上升，将可能对抱团股的估值存在一定压制。在市场交易风格上，成长股将会继续占优。对于科技赛道，随着技术创新瓶颈不断突破，科技产业进入全新阶段。全球半导体供需紧张预计将会持续，未来 2-3 年更重要的投资主线在于半导体国产替代。智能硬件的需求将会得到爆发，自动驾驶也将打开汽车软硬件产业链价值增量空间。新能源汽车产业将会是一个历史级的机会，虽然当下整体估值不便宜，但从长期来看，新能源汽车产业链仍会有大的发展。

4.5 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 1.9793 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.57%；截至本报告期末东海科技动力 C 基金份额净值为 1.9413 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.49%；同期业绩比较基准收益率为 3.85%。

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 2021 年 4 月 1 日低于 5000 万元以下，截至报告期末，已持续 60 个工作日。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	26,501,099.44	88.66
	其中：股票	26,501,099.44	88.66
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	2,592,731.79	8.67
8	其他资产	797,944.62	2.67
9	合计	29,891,775.85	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	23,434,676.73	79.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,864.80	0.01
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	848,000.00	2.88
J	金融业	654,679.91	2.23
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	1,561,878.00	5.31
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	26,501,099.44	90.14

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	25,000	1,612,500.00	5.48
2	601012	隆基股份	14,200	1,261,528.00	4.29
3	002049	紫光国微	8,000	1,233,520.00	4.20
4	300627	华测导航	35,000	1,193,850.00	4.06
5	688126	沪硅产业	40,000	1,167,200.00	3.97
6	601799	星宇股份	5,000	1,128,600.00	3.84
7	601689	拓普集团	30,000	1,122,900.00	3.82
8	600703	三安光电	35,000	1,121,750.00	3.82
9	603501	韦尔股份	3,400	1,094,800.00	3.72
10	300759	康龙化成	4,600	998,154.00	3.40

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，本基金投资的韦尔股份于 20210506 收到中国证监会上海证监局警示函的公告，公司对于资产质押情况未及时在临时公告中披露，直至 2020 年 4 月 10 日才在 2019 年年度报告中披露。

上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号）第二条第一款、第三十条第二款第十五项的规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。

公司方面的回复为：公司将切实加强《证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上市公司信息披露管理办法》等相关法律法规、规范性文件及公司内部管理制度的学习，进一步提高规范运作意识，严格按照上市公司信息披露规范要求履行信息披露义务，并不断提升信息披露质

量，避免此类事件的再次发生，维护公司及全体股东利益，促进公司健康、稳定、持续发展。

我们认为此次事件并不影响公司的投资价值，对于公司后续的经营情况，我们会保持持续关注。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	272.50
5	应收申购款	797,672.12
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	797,944.62

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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：报告期末前十名股票中未存在流通受限的股票。

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

项目	东海科技动力 A	东海科技动力 C
报告期期初基金份额总额	8,458,749.39	6,073,595.17
报告期期间基金总申购份额	1,136,688.74	3,274,623.62
减：报告期期间基金总赎回份额	1,997,395.42	1,949,896.27
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	7,598,042.71	7,398,322.52

§ 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

注：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

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 7 月 21 日