

东海核心价值精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§ 9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	62
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	65
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东海核心价值精选混合型证券投资基金
基金简称	东海核心价值
基金主代码	006538
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 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	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,104,886.11 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、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>本基金强调自上而下的研究策略，根据各行业所处生命周期、行业竞争结构、行业景气度变动趋势等因素，对各行业的相对投资价值进行综合分析，挑选具有优势的行业和景气度趋于上行的行业进行重点布局投资，并通过行业内优势比较精选具有核心竞争力的企业作为优先配置对象。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金运用价值投资理念，按照经营质量、竞争优势评价和价值评估的股票选择流程，投资于经营稳健、具有核心竞争优势、价值被低估的大中型上市公司股票。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用放大操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。</p> <p>本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较</p>

	<p>差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p> <p>5、股指期货等投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>7、流通受限证券投资策略</p> <p>本基金可投资流通受限证券，即本基金可参与上市公司非公开发行股票的投资。从战略投资的角度评估参与增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的增发项目。</p> <p>随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×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。

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	牛锐	周宏
	联系电话	021-60586900	025-58588217
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	Zhouhong1@jsbchina.cn
客户服务电话		400-9595531	95319
传真		021-60586926	025-58588155
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	江苏省南京市中华路 26 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼	江苏省南京市中华路 26 号
邮政编码		200122	210001
法定代表人		严晓珺	葛仁余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.donghaifunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天职国际会计师事务所（特 殊普通合伙）	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意 园 12 号楼
注册登记机构	东海基金管理有限责任公司	上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金 大厦 15 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期 间数据和 指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实 现收益	-1,356,905.59	-681,160.39	975,958.19
本期利润	-735,705.91	-1,573,343.68	622,520.53
加权平均 基金份额 本期利润	-0.1265	-0.5160	0.3536
本期加权 平均净值 利润率	-8.60%	-30.77%	16.88%
本期基金 份额净值 增长率	-10.86%	-28.57%	11.06%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	2,016,989.28	3,864,691.57	1,947,528.28
期末可供分配基金份额利润	0.3304	0.4925	1.0896
期末基金资产净值	8,121,875.39	11,711,209.70	3,734,956.46
期末基金份额净值	1.3304	1.4925	2.0896
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	33.04%	49.25%	108.96%

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 2018 年 11 月 23 日。

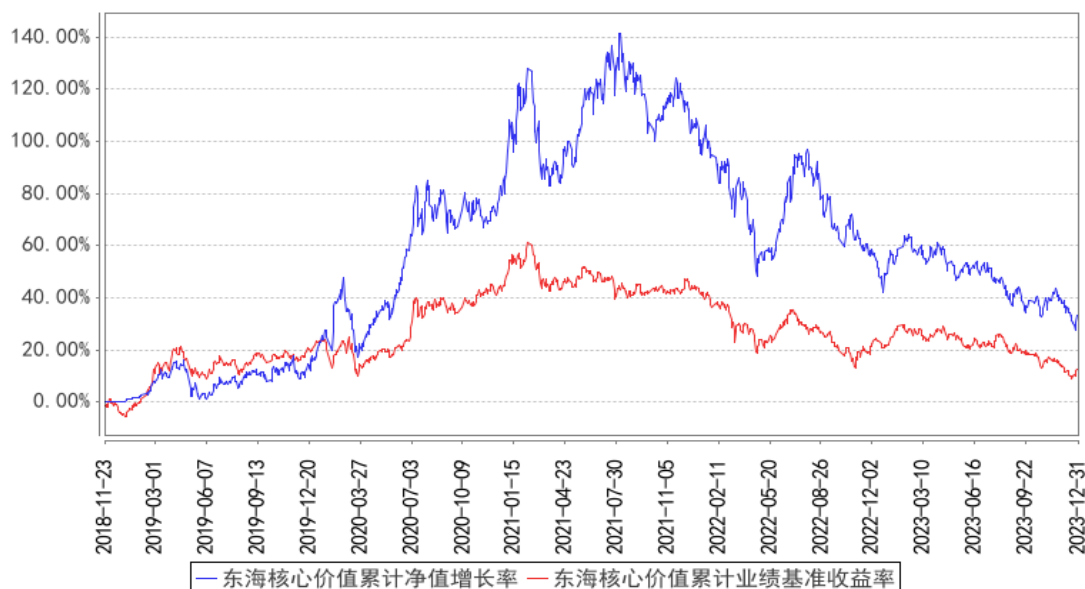
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.13%	1.01%	-5.08%	0.59%	0.95%	0.42%
过去六个月	-12.50%	0.99%	-7.69%	0.64%	-4.81%	0.35%
过去一年	-10.86%	1.00%	-7.65%	0.63%	-3.21%	0.37%
过去三年	-29.29%	1.53%	-24.14%	0.84%	-5.15%	0.69%
过去五年	32.88%	1.50%	17.73%	0.91%	15.15%	0.59%
自基金合同生效起至今	33.04%	1.49%	12.38%	0.91%	20.66%	0.58%

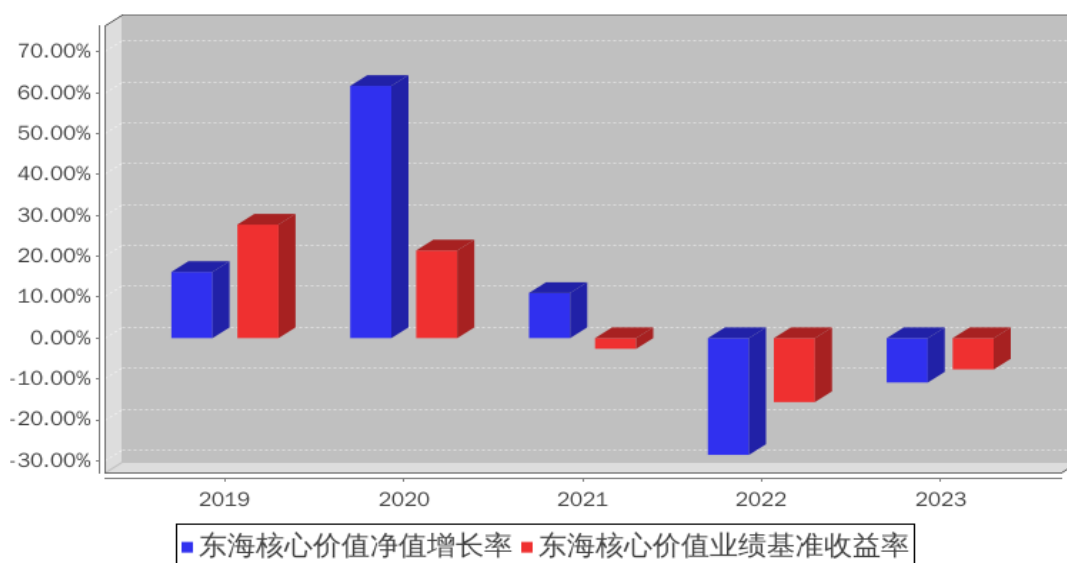
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东海核心价值累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东海核心价值基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东海基金管理有限责任公司成立于 2013 年 2 月 25 日，注册地上海，是中国证监会批准设立的第 78 家公募基金管理公司，拥有公募、特定客户资产管理业务资格。

公司的愿景是成为专注资产配置的卓越基金公司，公司秉持信、惠、臻的企业价值观，以“坚持科技驱动、凝聚价值点滴、成就财富海洋”为公司使命。根据公司整体战略规划，东海基金将着力打造大类资产配置品牌，坚持投研一体和科技金融双轮驱动发展理念，以期显著提升产品规模、业绩，提升大类资产配置品牌，成为科技金融的践行者。

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、东海鑫宁利率债三个月定期开放债券型证券投资基金、东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东海数字经济混合型发起式证券投资基金、东海消费臻选混合型发起式证券投资基金。

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		
张立新	本基金的基金经理、权益投资部总经理助理（主持工作）	2022 年 9 月 6 日	-	8 年	国籍：中国。工学硕士，曾任职于国联证券研究所电子行业研究员、东吴证券研究所电子行业研究员、中银国际证券股份有限公司资产管理板块研究与交易部电子行业研究员。2021 年 6 月加入东海基金，现任权益投资部总经理助理（主持工作）、基金经理。2022 年 9 月 6 日起任东海核心价值精选混合型证券投资基金、东海科技动力混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 30 日起任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经理；2023 年 8 月 15 日起任东海数字经济混合型发起式证券投资基金基金经理。

邵炜	本基金的基金经理、公募投资总监、资产配置部总经理	2022 年 9 月 8 日	-	11 年	国籍：中国。政治经济学硕士，曾任职于德邦证券资产管理有限公司资产管理总部，先后担任债券交易员、交易主管、投资经理、投资部副总经理、总经理助理、董事总经理等职务。2020 年 7 月加入东海基金，现任公司公募投资总监、资产配置部总经理、基金经理。2022 年 9 月 6 日起担任东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2022 年 9 月 8 日起担任东海核心价值精选混合型证券投资基金基金经理。
----	--------------------------	----------------	---	------	--

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司决议确定的聘任日期和解聘日期，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

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人高度重视投资者利益的保护工作，建立了严格的投资决策流程和公平交易监控机制，从而保证旗下基金运作的公平。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分，基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日

内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，公司未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

公司利用公平交易分析系统，对组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易次数为 0 次。

本报告期内，各组合投资交易未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，A 股市场可谓跌宕起伏。年初在疫情管控放开之后，市场对经济给予了强复苏的预期，在乐观的预期之下，A 股也迎来了强势上涨。二季度开始，随着经济数据的不及预期，悲观情绪开始迅速蔓延，市场不断下调 A 股的收益预期；与此同时，年初市场预期的美国经济衰退、美联储降息并没有如期发生，美国偏强的经济表现促使市场不断后延美联储的加息时间表，较强的加息周期给全球风险资产带来了巨大的估值压力。最终，在内部复苏不及预期、外部强美元周期引发估值压力的预期差之下，市场全年表现较弱。期间仍然存在不少结构性投资机会，不管是年初的 chatGPT、数字经济、中特估，还是下半年以北交所为代表的小盘股、华为概念、短剧概念，年内都取得了不错的涨幅，但是整体偏主题炒作，板块轮动速度较快，投资难度较大。

报告期内，本基金继续在高端制造（国防军工、新能源、新材料、半导体）方向挖掘有边际变化的标的。另外，四季度我们增加生猪养殖行业整体配置，我们判断能繁母猪仍然处于去化的过程当中，短期猪价可能由于季节性供需产生扰动，但随着能繁母猪的去化，行业供需格局将进一步明朗。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值为 1.3304 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.86%，同

期业绩比较基准收益率为-7.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，经济方面最重要的看点是能否从当下的“弱预期弱现实”的情况扭转向上。2023 年三季度以来，为了弥补总需求的缺口，避免经济陷入长期低迷的负反馈，政策层面释放出了更多的积极信号，中央财政不仅增发了 1 万亿的特别国债，而且将 2023 年的预算赤字率从 3% 提升到了 3.8%。年底的经济工作会议也提出了要稳中求进、以进促稳、先立后破。整体来看，以中央政府加杠杆、地方政府债务化解为主要表现的宽财政将成为 2024 年的主要政策发力点，后续需要观测政策实际的落地情况。

市场当前处于情绪较为低迷的阶段，长周期和短周期均有看似确定的负面压制；但是我们认为，回顾历史，市场在基本面出现拐点前后会出现情绪的延续，2024 年中观数据的低基数效应集中于上半年释放，而价格和库存有望在下半年迎来拐点。站在当下，很多板块估值已经低于 2022 年的低点，虽然短期情绪对于股价可能造成冲击，当下股价已经包含了对于总量经济增速的悲观预期。我们认为应该立足当下、着眼未来，积极地寻找机会，走出弱现实与弱预期的负向反馈。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人始终将加强内部控制、促进公司诚信合法经营、保障基金持有人利益为己任。本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。

（一）持续完善制度流程，夯实制度基础

公司持续完善公司管理制度，根据监管法规调整情况和公司管理需要，持续督导业务部门开展制度升级，优化内部控制体系。年内公司各条线通过制定、修订多项管理制度，实现了管理流程的进一步优化和合规管理有效性的进一步提升。

（二）深入开展合规培训，提升全员合规意识

公司重视对员工的合规培训，紧跟新规要求、监管动态、行业热点，开展多种形式开展培训活动，深入推进合规文化建设，持续强化员工行为管控，不断提升员工合规意识。

（三）加强廉洁从业管理，促进业务合规发展

公司积极开展廉洁从业风险点自查，强化财经纪律，规范基金投资和销售行为，以系统化手段和流程化管控方式加强廉洁从业管理，持续推进公司廉洁从业文化建设。

（四）不断加强稽核审计和整改追踪

公司监察稽核部门针对各条线各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况开展多次稽核审计，审计范围覆盖投资研究、信息技术、基金运营、投资者适当性、反洗钱等各个方面。此外公

司还对董事、监事、高级管理人员和其他从业人员管理情况开展了全面自查整改。通过稽核审计工作，对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行评价、报告和建议，并对发现的问题开展持续整改追踪。

（五）持续优化合规考核，引导全员主动合规

公司对合规考核方式进行细化优化，提升考核的导向作用，加强违规处罚机制设置。通过落实合规考核机制，引导全员主动合规，立足本岗位持续夯实各业务、各环节的内部控制。

（六）推动反洗钱工作深入开展

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，加强客户尽职调查和可疑交易排查，稳妥保存客户资料和交易记录。此外，公司还对洗钱控制措施有效性等开展自查整改，有效提升反洗钱工作管理水平。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

本报告期内，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 3 日至报告期末均低于 5000 万元，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 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——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《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天职业字[2024]14603 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东海核心价值精选混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了东海核心价值精选混合型证券投资基金（以下简称“东海核心价值基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东海核心价值基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变

	动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东海核心价值基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>东海核心价值基金管理人东海基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东海核心价值基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东海核心价值基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东海核心价值基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致东海核心价值基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	户永红 高忠刚
会计师事务所的地址	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东海核心价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,204,113.82	1,488,974.04
结算备付金		8,176.73	58,043.34
存出保证金		36,724.20	23,388.15

交易性金融资产	7.4.7.2	6,916,906.00	9,979,471.92
其中：股票投资		6,916,906.00	9,979,471.92
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		529.21	477,317.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		8,166,449.96	12,027,194.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	239,259.90
应付赎回款		9.44	1,016.79
应付管理人报酬		8,375.87	12,156.59
应付托管费		1,395.98	1,620.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	34,793.28	61,930.88
负债合计		44,574.57	315,985.17
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	6,104,886.11	7,846,518.13
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,016,989.28	3,864,691.57
净资产合计		8,121,875.39	11,711,209.70

负债和净资产总计		8,166,449.96	12,027,194.87
----------	--	--------------	---------------

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3304 元，基金份额总额 6,104,886.11 份。

7.2 利润表

会计主体：东海核心价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-598,685.99	-1,453,553.76
1. 利息收入		8,895.66	8,198.40
其中：存款利息收入	7.4.7.13	8,895.66	8,068.54
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		-	129.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,261,677.97	-696,531.27
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,311,315.77	-724,000.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	16,750.13
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	49,637.80	10,719.18
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）	7.4.7.20	621,199.68	-892,183.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	32,896.64	126,962.40
减：二、营业总支出		137,019.92	119,789.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	117,880.73	79,226.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	17,139.19	10,563.50

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.13
8. 其他费用	7.4.7.23	2,000.00	30,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-735,705.91	-1,573,343.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-735,705.91	-1,573,343.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-735,705.91	-1,573,343.68

7.3 净资产变动表

会计主体：东海核心价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	7,846,518.13	-	3,864,691.57	11,711,209.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,846,518.13	-	3,864,691.57	11,711,209.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,741,632.02	-	-1,847,702.29	-3,589,334.31
（一）、综合收益总额	-	-	-735,705.91	-735,705.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,741,632.02	-	-1,111,996.38	-2,853,628.40

其中：1. 基金申购款	3,941,210.40	-	1,874,046.09	5,815,256.49
2. 基金赎回款	-5,682,842.42	-	-2,986,042.47	-8,668,884.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,104,886.11	-	2,016,989.28	8,121,875.39
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	1,787,428.18	-	1,947,528.28	3,734,956.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,787,428.18	-	1,947,528.28	3,734,956.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,059,089.95	-	1,917,163.29	7,976,253.24
(一)、综合收益总额	-	-	-1,573,343.68	-1,573,343.68
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	6,059,089.95	-	3,490,506.97	9,549,596.92
其中：1. 基金申购款	17,835,425.18	-	11,352,348.16	29,187,773.34
2. 基金赎回款	-11,776,335.23	-	-7,861,841.19	-19,638,176.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,846,518.13	-	3,864,691.57	11,711,209.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>严晓珺</u>	<u>周华成</u>	<u>黄河</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东海核心价值精选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[2018]1566 号文《关于准予东海核心价值精选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由东海基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《东海核心价值精选混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2018 年 11 月 23 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 271,630,618.22 份基金份额。本基金管理人为东海基金管理有限责任公司，本基金托管人为江苏银行股份有限公司。

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。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。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：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种

方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润 / (累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公

允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

本报告期间本基金无需说明的外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估

值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期间，本基金无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间，本基金无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《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《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	188,904.69	1,488,974.04
等于：本金	188,858.69	1,488,694.73
加：应计利息	46.00	279.31

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	1,015,209.13	-
等于：本金	1,015,147.51	-
加：应计利息	61.62	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,204,113.82	1,488,974.04

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

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,042,949.58	-	6,916,906.00	-126,043.58
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	7,042,949.58	-	6,916,906.00	-126,043.58
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	10,726,715.18	-	9,979,471.92	-747,243.26
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	0.00	-	0.00	0.00

合计	10,726,715.18	-	9,979,471.92	-747,243.26
----	---------------	---	--------------	-------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末及上年度末，本基金均未持有任何期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末及上年度末，本基金均未持有任何黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期末及上年度末，本基金均无债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金均未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期末及上年度末，本基金均无其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	18,793.28	31,930.88
其中：交易所市场	18,793.28	31,930.88
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费用	16,000.00	30,000.00
合计	34,793.28	61,930.88

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,846,518.13	7,846,518.13
本期申购	3,941,210.40	3,941,210.40
本期赎回（以“-”号填列）	-5,682,842.42	-5,682,842.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,104,886.11	6,104,886.11

7.4.7.11 其他综合收益

本报告期末及上年度末，本基金均无其他综合收益。

7.4.7.12 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	7,153,930.99	-3,289,239.42	3,864,691.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,153,930.99	-3,289,239.42	3,864,691.57
本期利润	-1,356,905.59	621,199.68	-735,705.91
本期基金份额交易	-1,584,456.49	472,460.11	-1,111,996.38

产生的变动数			
其中：基金申购款	3,339,102.71	-1,465,056.62	1,874,046.09
基金赎回款	-4,923,559.20	1,937,516.73	-2,986,042.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,212,568.91	-2,195,579.63	2,016,989.28

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	6,567.02	7,550.10
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	475.31	-
结算备付金利息收入	1,284.89	390.43
其他	568.44	128.01
合计	8,895.66	8,068.54

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

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,311,315.77	-724,000.58
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	-1,311,315.77	-724,000.58

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	157,369,258.62	30,710,285.90
减：卖出股票成本总额	158,306,274.03	31,345,643.30
减：交易费用	374,300.36	88,643.18
买卖股票差价收入	-1,311,315.77	-724,000.58

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	-	27.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	16,722.85
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	16,750.13

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	92,760.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	76,000.00
减：应计利息总额	-	28.42

减：交易费用	-	9.28
买卖债券差价收入	-	16,722.85

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	49,637.80	10,719.18
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	49,637.80	10,719.18

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	621,199.68	-892,183.29
股票投资	621,199.68	-892,183.29
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	621,199.68	-892,183.29

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	32,896.64	126,962.40
合计	32,896.64	126,962.40

7.4.7.22 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	2,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
合计	2,000.00	30,000.00

7.4.7.24 分部报告

本报告期及上年度可比期间，本基金均无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东海基金管理有限责任公司（“东海基金”）	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（“江苏银行”）	基金托管人、基金代销机构
东海证券股份有限公司（“东海证券”）	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	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，本报告期不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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东海证券	83,877,642.51	26.88	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	61,030.16	26.70	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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 (%)
-	-	-	-	-

注：(1) 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

(2) 根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用东海证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从东海证券获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	117,880.73	79,226.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,436.07	34,674.43
应支付基金管理人的净管理费	71,444.66	44,551.86

注：(1) 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自 2018 年 11 月 23 日至 2023 年 08 月 06 日，按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数；

(2)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自 2023 年 08 月 07 日起，按前一日基金资产净值 1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,139.19	10,563.50

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 0.2%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×0.2%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金均未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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

基金合同生效日（2018 年 11 月 23 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期内申购/买入总份额	991,288.55	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	991,288.55	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.24%	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
江苏银行	188,904.69	6,567.02	1,488,974.04	7,550.10
东海证券股份有限公司	1,015,147.51	543.87	-	-

注：本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择东海证券股份有限公司作为证券经纪商，本基金的银行存款由基金托管人江苏银行、证券经纪商东海证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期，本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票、债券投资等。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风险管理工作。公司管理层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，公司设独立的风险管理部门对公司运作各环节的各类风险进行监控。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的货币资金放于信用良好的银行，与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国

证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的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。本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。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。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得

超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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							
货币资金	1,204,113.82	-	-	-	-	-	1,204,113.82

结算备付金	8,176.73	-	-	-	-	-	8,176.73
存出保证金	36,724.20	-	-	-	-	-	36,724.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	6,916,906.00	6,916,906.00
应收申购款	-	-	-	-	-	529.21	529.21
资产总计	1,249,014.75	-	-	-	-	6,917,435.21	8,166,449.96
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	9.44	9.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,375.87	8,375.87
应付托管费	-	-	-	-	-	1,395.98	1,395.98
其他负债	-	-	-	-	-	34,793.28	34,793.28
负债总计	-	-	-	-	-	44,574.57	44,574.57
利率敏感度缺口	1,249,014.75	-	-	-	-	6,872,860.64	8,121,875.39
上年度末 2022 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							
货币资金	1,488,974.04	-	-	-	-	-	1,488,974.04
结算备付金	58,043.34	-	-	-	-	-	58,043.34
存出保证金	23,388.15	-	-	-	-	-	23,388.15
交易性金融资产	-	-	-	-	-	9,979,471.92	9,979,471.92
应收申购款	-	-	-	-	-	477,317.42	477,317.42
资产总计	1,570,405.53	-	-	-	-	10,456,789.34	12,027,194.87
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,016.79	1,016.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,156.59	12,156.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,620.86	1,620.86
应付清算款	-	-	-	-	-	239,259.90	239,259.90
应交税费	-	-	-	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	-	-	-	61,930.88	61,930.88
负债总计	-	-	-	-	-	315,985.17	315,985.17
利率敏感度缺口	1,570,405.53	-	-	-	-	10,140,804.17	11,711,209.70

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末及上年度期末，本基金未持有交易性债券投资，货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值

或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	6,916,906.00	85.16	9,979,471.92	85.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	6,916,906.00	85.16	9,979,471.92	85.21

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。以下分析中，除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准增加1%	59,794.44	96,172.17
	业绩比较基准减少1%	-59,794.44	-96,172.17

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场

价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	6,916,906.00	9,979,471.92
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	6,916,906.00	9,979,471.92

7.4.14.2.2 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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况（2022 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,916,906.00	84.70
	其中：股票	6,916,906.00	84.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,212,290.55	14.84
8	其他各项资产	37,253.41	0.46
9	合计	8,166,449.96	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	6,518,746.00	80.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	207,920.00	2.56
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	190,240.00	2.34
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	6,916,906.00	85.16

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002840	华统股份	22,000	457,380.00	5.63
2	002567	唐人神	60,000	450,000.00	5.54
3	002100	天康生物	50,000	438,500.00	5.40
4	688636	智明达	5,000	326,000.00	4.01
5	605389	长龄液压	9,500	254,220.00	3.13
6	688270	臻镭科技	3,600	246,168.00	3.03
7	688523	航天环宇	9,000	241,380.00	2.97
8	688123	聚辰股份	3,900	238,797.00	2.94
9	300589	江龙船艇	17,000	235,960.00	2.91
10	688311	盟升电子	4,600	234,646.00	2.89
11	300699	光威复材	8,700	232,029.00	2.86
12	688383	新益昌	2,200	230,538.00	2.84
13	002977	天箭科技	6,500	230,230.00	2.83
14	301308	江波龙	2,500	230,125.00	2.83

15	688439	振华风光	2,500	222,775.00	2.74
16	000048	京基智农	12,000	219,600.00	2.70
17	002465	海格通信	17,000	218,450.00	2.69
18	300629	新劲刚	10,000	216,300.00	2.66
19	688008	澜起科技	3,600	211,536.00	2.60
20	688333	铂力特	1,800	208,620.00	2.57
21	603388	元成股份	23,000	207,920.00	2.56
22	688166	博瑞医药	5,700	199,500.00	2.46
23	688170	德龙激光	5,000	195,250.00	2.40
24	688776	国光电气	2,000	194,780.00	2.40
25	601601	中国太保	8,000	190,240.00	2.34
26	605123	派克新材	2,000	182,400.00	2.25
27	300719	安达维尔	13,000	173,290.00	2.13
28	603283	赛腾股份	1,700	123,352.00	1.52
29	600399	抚顺特钢	11,000	106,920.00	1.32

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300976	达瑞电子	1,711,144.00	14.61
2	688383	新益昌	1,682,879.70	14.37
3	688282	理工导航	1,681,834.36	14.36
4	002100	天康生物	1,582,800.00	13.52
5	301308	江波龙	1,438,757.00	12.29
6	600435	北方导航	1,403,316.00	11.98
7	002465	海格通信	1,342,617.00	11.46
8	688281	华秦科技	1,262,403.51	10.78
9	600011	华能国际	1,244,186.00	10.62
10	601899	紫金矿业	1,235,862.00	10.55
11	002567	唐人神	1,219,409.00	10.41
12	688311	盟升电子	1,182,598.32	10.10
13	600975	新五丰	1,162,686.00	9.93
14	300782	卓胜微	1,125,798.00	9.61
15	300081	恒信东方	1,069,184.00	9.13
16	000807	云铝股份	1,038,742.00	8.87
17	603388	元成股份	1,027,826.00	8.78
18	000977	浪潮信息	1,012,316.00	8.64
19	688123	聚辰股份	1,002,194.15	8.56
20	688270	臻镭科技	972,209.01	8.30
21	603993	洛阳钼业	951,400.00	8.12
22	300719	安达维尔	945,301.00	8.07
23	002840	华统股份	919,217.00	7.85

24	002179	中航光电	879,219.00	7.51
25	600559	老白干酒	865,844.00	7.39
26	605296	神农集团	847,215.50	7.23
27	300747	锐科激光	822,586.40	7.02
28	002843	泰嘉股份	812,302.00	6.94
29	301117	佳缘科技	809,748.00	6.91
30	300475	香农芯创	808,023.50	6.90
31	300629	新劲刚	803,597.00	6.86
32	600027	华电国际	754,300.00	6.44
33	688523	航天环宇	753,219.39	6.43
34	688552	航天南湖	749,727.60	6.40
35	688566	吉贝尔	744,049.46	6.35
36	002475	立讯精密	735,152.85	6.28
37	688266	泽璟制药	717,214.70	6.12
38	600760	中航沈飞	712,477.00	6.08
39	688676	金盘科技	702,661.34	6.00
40	600023	浙能电力	700,120.00	5.98
41	600862	中航高科	699,432.00	5.97
42	688088	虹软科技	693,054.36	5.92
43	002977	天箭科技	691,586.20	5.91
44	000048	京基智农	690,800.89	5.90
45	000938	紫光股份	682,210.00	5.83
46	002947	恒铭达	681,344.00	5.82
47	601869	长飞光纤	668,845.74	5.71
48	688439	振华风光	664,448.37	5.67
49	600406	国电南瑞	658,900.00	5.63
50	600988	赤峰黄金	646,127.00	5.52
51	600684	珠江股份	644,450.00	5.50
52	000534	万泽股份	641,955.00	5.48
53	300624	万兴科技	636,147.00	5.43
54	000400	许继电气	627,578.00	5.36
55	000625	长安汽车	625,200.00	5.34
56	601069	西部黄金	621,822.00	5.31
57	600487	亨通光电	615,900.00	5.26
58	600409	三友化工	608,631.00	5.20
59	603267	鸿远电子	602,854.00	5.15
60	688166	博瑞医药	602,434.07	5.14
61	600872	中炬高新	596,979.00	5.10
62	688376	美埃科技	586,690.27	5.01
63	600900	长江电力	571,950.00	4.88
64	300395	菲利华	569,241.00	4.86
65	301093	华兰股份	563,802.00	4.81
66	002276	万马股份	557,800.00	4.76

67	600509	天富能源	557,535.00	4.76
68	002025	航天电器	555,987.00	4.75
69	603259	药明康德	555,628.00	4.74
70	600327	大东方	555,450.00	4.74
71	002153	石基信息	552,084.40	4.71
72	600879	航天电子	548,630.00	4.68
73	002815	崇达技术	545,488.00	4.66
74	002555	三七互娱	544,994.00	4.65
75	300351	永贵电器	538,733.00	4.60
76	001270	铖昌科技	532,208.00	4.54
77	000021	深科技	529,818.00	4.52
78	600483	福能股份	527,905.00	4.51
79	002371	北方华创	520,788.00	4.45
80	600905	三峡能源	513,300.00	4.38
81	600416	湘电股份	503,576.00	4.30
82	000034	神州数码	502,525.00	4.29
83	300762	上海瀚讯	502,127.00	4.29
84	600967	内蒙一机	501,111.00	4.28
85	600251	冠农股份	495,565.00	4.23
86	603927	中科软	487,610.00	4.16
87	300498	温氏股份	480,770.00	4.11
88	002864	盘龙药业	480,491.49	4.10
89	300226	上海钢联	478,815.00	4.09
90	600031	三一重工	469,440.00	4.01
91	603081	大丰实业	467,241.00	3.99
92	600529	山东药玻	465,342.00	3.97
93	688375	国博电子	463,280.00	3.96
94	605123	派克新材	461,903.00	3.94
95	605389	长龄液压	459,613.00	3.92
96	603163	圣晖集成	459,205.00	3.92
97	605186	健麾信息	454,294.00	3.88
98	300928	华安鑫创	453,748.00	3.87
99	300724	捷佳伟创	453,381.00	3.87
100	603076	乐惠国际	450,929.00	3.85
101	600150	中国船舶	450,271.00	3.84
102	603929	亚翔集成	450,000.00	3.84
103	688248	南网科技	448,428.88	3.83
104	600415	小商品城	446,100.00	3.81
105	002675	东诚药业	441,352.00	3.77
106	000050	深天马 A	440,946.00	3.77
107	300122	智飞生物	440,725.00	3.76
108	000539	粤电力 A	439,868.00	3.76
109	603456	九洲药业	439,862.00	3.76

110	600276	恒瑞医药	438,460.00	3.74
111	601702	华峰铝业	436,321.00	3.73
112	002439	启明星辰	435,989.00	3.72
113	601600	中国铝业	432,150.00	3.69
114	688489	三未信安	426,607.32	3.64
115	688685	迈信林	423,477.10	3.62
116	000858	五粮液	423,369.00	3.62
117	300181	佐力药业	422,180.00	3.60
118	688636	智明达	421,082.72	3.60
119	002241	歌尔股份	421,000.00	3.59
120	300810	中科海讯	418,820.00	3.58
121	688627	精智达	418,553.00	3.57
122	688521	芯原股份	413,194.91	3.53
123	000333	美的集团	412,818.00	3.52
124	688167	炬光科技	412,162.20	3.52
125	301018	申菱环境	411,820.00	3.52
126	688095	福昕软件	411,010.05	3.51
127	600867	通化东宝	411,004.00	3.51
128	300739	明阳电路	409,656.00	3.50
129	300708	聚灿光电	409,060.00	3.49
130	601319	中国人保	408,680.00	3.49
131	688276	百克生物	406,778.93	3.47
132	601628	中国人寿	406,722.00	3.47
133	603986	兆易创新	406,076.00	3.47
134	002466	天齐锂业	403,000.00	3.44
135	300855	图南股份	402,097.00	3.43
136	601126	四方股份	398,399.00	3.40
137	603799	华友钴业	397,000.00	3.39
138	002317	众生药业	396,230.00	3.38
139	002446	盛路通信	396,140.00	3.38
140	601991	大唐发电	394,600.00	3.37
141	603228	景旺电子	394,527.00	3.37
142	603712	七一二	394,090.00	3.37
143	688522	纳睿雷达	393,375.00	3.36
144	688776	国光电气	390,759.54	3.34
145	300366	创意信息	390,300.00	3.33
146	002287	奇正藏药	389,667.40	3.33
147	600535	天士力	389,384.00	3.32
148	688170	德龙激光	389,369.96	3.32
149	688008	澜起科技	389,198.81	3.32
150	688305	科德数控	388,420.00	3.32
151	002385	大北农	387,500.00	3.31
152	300775	三角防务	386,900.00	3.30

153	688279	峰昭科技	386,805.11	3.30
154	603306	华懋科技	386,680.00	3.30
155	600737	中粮糖业	385,871.00	3.29
156	688239	航宇科技	383,459.88	3.27
157	301236	软通动力	383,093.00	3.27
158	300291	百纳千成	371,822.00	3.17
159	688110	东芯股份	369,628.78	3.16
160	600488	津药药业	367,909.00	3.14
161	600764	中国海防	361,765.00	3.09
162	688568	中科星图	360,365.92	3.08
163	300548	博创科技	354,720.00	3.03
164	603225	新凤鸣	353,822.00	3.02
165	688213	思特威	352,264.58	3.01
166	000589	贵州轮胎	350,100.00	2.99
167	600795	国电电力	348,600.00	2.98
168	688019	安集科技	342,460.00	2.92
169	300537	广信材料	341,466.00	2.92
170	688510	航亚科技	334,784.99	2.86
171	603773	沃格光电	330,200.00	2.82
172	002870	香山股份	326,864.00	2.79
173	688608	恒玄科技	325,691.09	2.78
174	600399	抚顺特钢	323,298.00	2.76
175	600285	羚锐制药	322,517.00	2.75
176	300852	四会富仕	319,790.76	2.73
177	300648	星云股份	314,790.00	2.69
178	688391	钜泉科技	307,902.00	2.63
179	688343	云天励飞	305,200.00	2.61
180	601633	长城汽车	301,900.00	2.58
181	002245	蔚蓝锂芯	301,750.00	2.58
182	002938	鹏鼎控股	300,900.00	2.57
183	688031	星环科技	299,432.00	2.56
184	300418	昆仑万维	297,760.00	2.54
185	605222	起帆电缆	295,508.00	2.52
186	600566	济川药业	291,020.00	2.48
187	300573	兴齐眼药	290,400.00	2.48
188	002396	星网锐捷	289,370.00	2.47
189	002906	华阳集团	289,200.00	2.47
190	300952	恒辉安防	288,414.00	2.46
191	688268	华特气体	278,138.19	2.37
192	000975	银泰黄金	275,600.00	2.35
193	301358	湖南裕能	274,680.00	2.35
194	603105	芯能科技	274,239.00	2.34
195	600763	通策医疗	271,999.00	2.32

196	300433	蓝思科技	270,600.00	2.31
197	688517	金冠电气	270,573.70	2.31
198	688003	天准科技	269,600.00	2.30
199	300308	中际旭创	268,360.00	2.29
200	600809	山西汾酒	265,344.00	2.27
201	301272	英华特	260,928.00	2.23
202	300302	同有科技	258,956.00	2.21
203	601208	东材科技	256,500.00	2.19
204	300553	集智股份	255,825.00	2.18
205	002415	海康威视	255,817.00	2.18
206	688419	耐科装备	254,591.00	2.17
207	600030	中信证券	251,973.10	2.15
208	300258	精锻科技	251,637.00	2.15
209	600583	海油工程	248,413.00	2.12
210	002933	新兴装备	246,949.00	2.11
211	000738	航发控制	244,932.00	2.09
212	601108	财通证券	244,680.00	2.09
213	300835	龙磁科技	244,365.00	2.09
214	000568	泸州老窖	244,235.00	2.09
215	300827	上能电气	243,374.00	2.08
216	600339	中油工程	242,400.00	2.07
217	600778	友好集团	240,679.00	2.06
218	600552	凯盛科技	240,340.00	2.05
219	003009	中天火箭	237,206.00	2.03
220	601198	东兴证券	236,700.00	2.02
221	603737	三棵树	236,007.00	2.02
222	601601	中国太保	235,920.00	2.01
223	300996	普联软件	235,725.00	2.01
224	002223	鱼跃医疗	235,522.00	2.01
225	300873	海晨股份	235,497.00	2.01
226	300589	江龙船艇	235,204.00	2.01
227	000066	中国长城	234,742.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600011	华能国际	1,787,400.00	15.26
2	300976	达瑞电子	1,723,152.00	14.71
3	688282	理工导航	1,633,380.86	13.95
4	688281	华秦科技	1,570,313.81	13.41
5	688383	新益昌	1,530,491.84	13.07
6	600435	北方导航	1,418,513.00	12.11

7	301308	江波龙	1,280,693.00	10.94
8	601899	紫金矿业	1,254,630.00	10.71
9	002100	天康生物	1,186,970.00	10.14
10	600975	新五丰	1,183,503.00	10.11
11	300782	卓胜微	1,180,041.00	10.08
12	002465	海格通信	1,162,030.00	9.92
13	002179	中航光电	1,119,054.40	9.56
14	688676	金盘科技	1,077,844.88	9.20
15	300081	恒信东方	1,049,897.00	8.96
16	000807	云铝股份	1,046,112.00	8.93
17	000977	浪潮信息	1,044,460.00	8.92
18	002843	泰嘉股份	1,030,725.00	8.80
19	688266	泽璟制药	958,969.39	8.19
20	603993	洛阳钼业	923,200.00	7.88
21	300475	香农芯创	911,095.00	7.78
22	000534	万泽股份	908,701.00	7.76
23	605296	神农集团	903,949.00	7.72
24	688311	盟升电子	892,447.87	7.62
25	300629	新劲刚	866,983.00	7.40
26	600559	老白干酒	845,309.00	7.22
27	688248	南网科技	822,240.97	7.02
28	300747	锐科激光	818,913.00	6.99
29	603388	元成股份	815,070.00	6.96
30	600988	赤峰黄金	810,944.00	6.92
31	688123	聚辰股份	806,744.39	6.89
32	300719	安达维尔	786,348.00	6.71
33	002567	唐人神	780,340.00	6.66
34	688566	吉贝尔	776,624.53	6.63
35	688552	航天南湖	762,869.07	6.51
36	600027	华电国际	757,500.00	6.47
37	600023	浙能电力	751,200.00	6.41
38	688270	臻镭科技	728,235.68	6.22
39	301117	佳缘科技	717,191.00	6.12
40	603712	七一二	715,377.50	6.11
41	600760	中航沈飞	698,487.40	5.96
42	600862	中航高科	694,875.00	5.93
43	002475	立讯精密	693,397.15	5.92
44	601869	长飞光纤	689,620.00	5.89
45	002947	恒铭达	682,725.00	5.83
46	000938	紫光股份	679,366.00	5.80
47	600406	国电南瑞	670,850.00	5.73
48	300624	万兴科技	652,877.00	5.57
49	688088	虹软科技	651,038.57	5.56

50	300122	智飞生物	648,267.00	5.54
51	000400	许继电气	640,411.00	5.47
52	600684	珠江股份	637,696.00	5.45
53	000625	长安汽车	636,867.00	5.44
54	600409	三友化工	620,650.00	5.30
55	300775	三角防务	619,583.00	5.29
56	300648	星云股份	610,759.00	5.22
57	688376	美埃科技	598,850.18	5.11
58	600399	抚顺特钢	597,523.00	5.10
59	603259	药明康德	597,150.00	5.10
60	600872	中炬高新	591,999.00	5.05
61	601069	西部黄金	590,212.00	5.04
62	600487	亨通光电	576,556.00	4.92
63	600900	长江电力	565,380.00	4.83
64	300395	菲利华	563,346.00	4.81
65	002815	崇达技术	562,966.00	4.81
66	002276	万马股份	559,200.00	4.77
67	301093	华兰股份	554,305.00	4.73
68	600509	天富能源	551,500.00	4.71
69	600879	航天电子	550,700.00	4.70
70	600795	国电电力	547,650.00	4.68
71	002555	三七互娱	543,467.00	4.64
72	000021	深科技	540,116.00	4.61
73	603267	鸿远电子	539,635.00	4.61
74	000034	神州数码	529,546.00	4.52
75	002153	石基信息	527,858.00	4.51
76	002371	北方华创	527,426.00	4.50
77	600327	大东方	526,660.00	4.50
78	600483	福能股份	521,650.00	4.45
79	001270	铖昌科技	519,750.00	4.44
80	002025	航天电器	514,387.00	4.39
81	300351	永贵电器	512,784.00	4.38
82	300762	上海瀚讯	505,653.00	4.32
83	002864	盘龙药业	502,892.00	4.29
84	600905	三峡能源	501,700.00	4.28
85	688523	航天环宇	501,519.76	4.28
86	600150	中国船舶	493,270.00	4.21
87	300226	上海钢联	491,545.00	4.20
88	600251	冠农股份	489,440.00	4.18
89	600967	内蒙一机	486,929.00	4.16
90	603927	中科软	483,212.00	4.13
91	300498	温氏股份	482,747.00	4.12
92	605286	同力日升	482,049.00	4.12

93	002840	华统股份	481,150.00	4.11
94	600529	山东药玻	467,640.00	3.99
95	605186	健麾信息	463,808.00	3.96
96	002977	天箭科技	461,371.00	3.94
97	688375	国博电子	460,355.44	3.93
98	300928	华安鑫创	458,744.00	3.92
99	000048	京基智农	457,262.00	3.90
100	603929	亚翔集成	453,798.00	3.87
101	603076	乐惠国际	452,400.00	3.86
102	301018	申菱环境	451,698.00	3.86
103	600415	小商品城	451,600.00	3.86
104	300724	捷佳伟创	451,211.00	3.85
105	000050	深天马 A	450,172.00	3.84
106	688112	鼎阳科技	446,916.04	3.82
107	603163	圣晖集成	445,901.00	3.81
108	600031	三一重工	444,782.00	3.80
109	600416	湘电股份	443,660.00	3.79
110	000539	粤电力 A	441,439.00	3.77
111	688663	新风光	438,923.54	3.75
112	603081	大丰实业	435,987.00	3.72
113	600276	恒瑞医药	434,190.00	3.71
114	603456	九洲药业	433,550.00	3.70
115	002675	东诚药业	433,085.00	3.70
116	000858	五粮液	432,839.00	3.70
117	688685	迈信林	431,160.43	3.68
118	603986	兆易创新	430,902.00	3.68
119	300181	佐力药业	428,544.00	3.66
120	601702	华峰铝业	428,401.00	3.66
121	688608	恒玄科技	425,579.72	3.63
122	601600	中国铝业	424,050.00	3.62
123	688489	三未信安	423,913.20	3.62
124	300708	聚灿光电	423,340.00	3.61
125	688627	精智达	422,924.50	3.61
126	300739	明阳电路	419,038.00	3.58
127	688167	炬光科技	418,041.54	3.57
128	688166	博瑞医药	411,342.82	3.51
129	300810	中科海讯	411,157.00	3.51
130	002439	启明星辰	410,898.00	3.51
131	688095	福昕软件	409,901.09	3.50
132	002466	天齐锂业	408,052.00	3.48
133	000589	贵州轮胎	405,700.00	3.46
134	688439	振华风光	405,493.00	3.46
135	603306	华懋科技	402,784.00	3.44

136	688276	百克生物	402,755.52	3.44
137	000333	美的集团	399,800.00	3.41
138	002446	盛路通信	398,240.00	3.40
139	688522	纳睿雷达	398,170.98	3.40
140	688279	峰岬科技	397,202.00	3.39
141	300366	创意信息	396,950.00	3.39
142	002287	奇正藏药	393,876.00	3.36
143	603228	景旺电子	393,061.00	3.36
144	002241	歌尔股份	392,724.00	3.35
145	600535	天士力	392,550.00	3.35
146	688521	芯原股份	391,061.94	3.34
147	300855	图南股份	390,662.00	3.34
148	002385	大北农	390,009.00	3.33
149	601126	四方股份	388,680.00	3.32
150	688110	东芯股份	386,494.76	3.30
151	603773	沃格光电	386,065.00	3.30
152	688737	中自科技	384,821.27	3.29
153	603799	华友钴业	384,650.00	3.28
154	301236	软通动力	384,575.00	3.28
155	600867	通化东宝	383,820.00	3.28
156	601991	大唐发电	381,300.00	3.26
157	300548	博创科技	379,750.00	3.24
158	601628	中国人寿	376,605.00	3.22
159	600737	中粮糖业	374,700.00	3.20
160	002317	众生药业	374,451.00	3.20
161	688239	航宇科技	366,715.25	3.13
162	601319	中国人保	365,950.00	3.12
163	300291	百纳千成	363,300.00	3.10
164	603225	新凤鸣	356,475.00	3.04
165	300068	南都电源	355,910.00	3.04
166	688213	思特威	354,491.36	3.03
167	601633	长城汽车	347,317.00	2.97
168	300537	广信材料	344,214.00	2.94
169	600488	津药药业	342,400.00	2.92
170	688019	安集科技	342,261.65	2.92
171	600764	中国海防	339,830.00	2.90
172	688510	航亚科技	338,180.54	2.89
173	002870	香山股份	329,078.00	2.81
174	600285	羚锐制药	327,486.00	2.80
175	688568	中科星图	327,409.00	2.80
176	300852	四会富仕	324,612.00	2.77
177	688343	云天励飞	320,394.78	2.74
178	688305	科德数控	314,912.40	2.69

179	688333	铂力特	311,026.16	2.66
180	688022	瀚川智能	310,864.74	2.65
181	688391	钜泉科技	309,537.78	2.64
182	002938	鹏鼎控股	303,627.00	2.59
183	300573	兴齐眼药	299,750.00	2.56
184	300418	昆仑万维	296,960.00	2.54
185	002906	华阳集团	295,840.00	2.53
186	605222	起帆电缆	292,450.00	2.50
187	600763	通策医疗	288,801.00	2.47
188	300308	中际旭创	287,779.00	2.46
189	002396	星网锐捷	286,330.00	2.44
190	002859	洁美科技	283,502.00	2.42
191	688385	复旦微电	278,882.80	2.38
192	600566	济川药业	277,768.00	2.37
193	301358	湖南裕能	277,320.00	2.37
194	000975	银泰黄金	276,817.00	2.36
195	688517	金冠电气	275,460.42	2.35
196	688560	明冠新材	273,052.00	2.33
197	300302	同有科技	270,300.00	2.31
198	688191	智洋创新	269,030.55	2.30
199	600809	山西汾酒	266,750.00	2.28
200	688268	华特气体	266,294.52	2.27
201	688337	普源精电	264,048.00	2.25
202	688419	耐科装备	263,363.20	2.25
203	601208	东材科技	261,143.00	2.23
204	600288	大恒科技	260,414.00	2.22
205	300433	蓝思科技	260,400.00	2.22
206	300553	集智股份	259,978.00	2.22
207	605123	派克新材	257,254.00	2.20
208	002933	新兴装备	256,338.00	2.19
209	002245	蔚蓝锂芯	256,000.00	2.19
210	300558	贝达药业	253,271.00	2.16
211	603297	永新光学	252,990.00	2.16
212	605117	德业股份	251,304.00	2.15
213	603737	三棵树	249,760.00	2.13
214	003009	中天火箭	249,000.00	2.13
215	600552	凯盛科技	248,891.00	2.13
216	000568	泸州老窖	248,396.00	2.12
217	688237	超卓航科	247,495.53	2.11
218	600583	海油工程	247,200.00	2.11
219	601108	财通证券	246,900.00	2.11
220	688372	伟测科技	244,817.31	2.09
221	300476	胜宏科技	242,645.00	2.07

222	603165	荣晟环保	242,574.00	2.07
223	688003	天准科技	242,560.90	2.07
224	000032	深桑达 A	241,928.00	2.07
225	688596	正帆科技	241,104.62	2.06
226	300363	博腾股份	240,056.00	2.05
227	300896	爱美客	239,549.00	2.05
228	002735	王子新材	239,355.00	2.04
229	002126	银轮股份	239,221.00	2.04
230	300996	普联软件	238,054.00	2.03
231	000403	派林生物	238,051.00	2.03
232	002415	海康威视	237,588.00	2.03
233	300873	海晨股份	237,569.00	2.03
234	600129	太极集团	237,000.00	2.02
235	300827	上能电气	236,960.00	2.02
236	688114	华大智造	236,119.61	2.02
237	603019	中科曙光	235,550.00	2.01
238	002387	维信诺	234,300.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	154,622,508.43
卖出股票收入（成交）总额	157,369,258.62

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末，本基金未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末，本基金未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末，本基金未持有资产支持证券投资。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末，本基金未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期，本基金未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,724.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	529.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,253.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
884	6,905.98	991,386.96	16.24	5,113,499.15	83.76

9.2 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	483,202.37	7.9150

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年11月23日) 基金份额总额	271,630,618.22
本报告期期初基金份额总额	7,846,518.13
本报告期基金总申购份额	3,941,210.40
减：本报告期基金总赎回份额	5,682,842.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,104,886.11

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人 2023 年 10 月 21 日发布公告，自 2023 年 10 月 19 日起，杨明先生担任公司董事长，殷建华先生因退休不再担任公司董事长。

2. 基金托管人：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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本年度应支付给天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）的基金审计费用为 1.6 万元，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 4 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	股东深圳鹏博实业集团有限公司股权质押未能按期完成整改
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	股东方已提交整改报告
其他	-

11.6.2 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，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中国国际金融股份有限公司	2	202,545,013.84	64.92	148,517.80	64.96	-
东海证券	2	83,877,642.51	26.88	61,030.16	26.70	-
华创证券	1	25,569,110.70	8.20	19,071.63	8.34	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内在托管结算模式下新增租用华创证券有限责任公司交易单元，并于 2023 年 11 月由托管结算模式切换为券商结算模式。

2、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。选择租

用证券公司基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 资金实力雄厚，财务状况良好；
- (2) 经营行为稳健文件规范，在业内有良好的声誉；
- (3) 内控制度健全，内部管理严格；并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 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交易的需要；并能
为基金提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；
- (6) 具备较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较强的研究综合实力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析报告及丰富全面的信息服
务；合作机构研究强项与我司研究重点匹配度高，能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门
研究报告，具有开发量化投资组合的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及
其他业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据对券商交易单元的选择标准并结合对券商研究服务工作的评分结果，
确定选用交易单元的所属券商；
- (2) 由研发策略部负责交易席位的租用、调整分配、退租等管理工作，交易席位的租用或退
租经公司审批后执行。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 01 月 20 日
2	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 03 月 31 日
3	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 04 月 21 日
4	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 04 月 25 日
5	东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增上海长量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	2023 年 05 月 25 日
6	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 07 月 21 日
7	关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 08 月 05 日
8	东海核心价值精选混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 08 月 08 日
9	东海核心价值精选混合型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 08 月 08 日
10	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 08 月 31 日
11	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 21 日
12	关于东海核心价值精选混合型证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 07 日
13	关于东海核心价值精选混合型证券投资基金证券交易模式转换完成的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 08 日
14	东海核心价值精选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 08 日
15	东海核心价值精选混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 09 日
16	东海核心价值精选混合型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 09 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
个人	1	2023 年 02 月 08 日-2023 年 06 月 27 日	1,150,087.00	0.00	0.00	1,150,087.00	18.84
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规和本基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，自 2023 年 8 月 7 日起调低本基金的管理费率，并相应修订本基金的基金合同、托管协议、招募说明书和基金产品资料概要。具体信息参见基金管理人在规定媒介发布的公告。

本报告期内，本基金于 2023 年 11 月 7 日完成了证券交易结算模式转换，转换后本基金的证券交易所交易委托证券公司办理，由证券公司履行场内证券交易结算管理职责。具体信息参见基金管理人在规定媒介发布的公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海核心价值精选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《东海核心价值精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《东海核心价值精选混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《东海核心价值精选混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.donghaifunds.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所查阅。

投资者对本报告如有疑问，可拨打基金管理人客户服务热线电话：400-959-5531 咨询相关信

息。

东海基金管理有限责任公司

2024 年 3 月 29 日