东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划
2023年年度报告

2023年12月31日

基金管理人：东海证券股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024年3月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本集合计划管理人的董事会、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。

本集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 3 月 29 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。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利。

本集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§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遵规守信情况的说明 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 14
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 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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 16
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
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 51
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52

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 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 54
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 55
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 55
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 55
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 55
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
8.12 投资组合报告附注 55

§9 基金份额持有人信息 56

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 57

§10 开放式基金份额变动 57

§11 重大事件揭示 57

11.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 58
11.4 基金投资策略的改变 58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
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 58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 58
11.8 其他重大事件 59

§12 影响投资者决策的其他重要信息 59

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 59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 59

§13 备查文件目录 60

13.1 备查文件目录 60
13.2 存放地点 60
13.3 查阅方式 60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划	
基金简称	东海海睿进取	
基金主代码	970033	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 7 日	
基金管理人	东海证券股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	134,906,089.72 份	
基金合同存续期	本集合计划存续期限自合同生效至本合同终止之间的期限。中国证监会另有规定的，按规定执行。	
下属分级基金的基金简称	海睿进取 A	海睿进取 B
下属分级基金的交易代码	970032	970033
报告期末下属分级基金的份额总额	36,544,103.96 份	98,361,985.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求集合计划资产的长期增值。
投资策略	本集合计划的主要投资策略包括： 1、大类资产配置策略； 2、股票投资策略； 3、债券投资策略； 4、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本集合计划是一只混合型集合资产管理计划，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

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		东海证券股份有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高宇	陆志俊
	联系电话	95531	95559
	电子邮箱	gyu@longone.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95531	95559
传真		021-50498835	021-62701216
注册地址		江苏省常州市延陵西路 23 号投	中国（上海）自由贸易试验区

	资广场 18 层	银城中路 188 号
办公地址	上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200125	200336
法定代表人	王文卓	任德奇

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	www.longone.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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 6 月 7 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	2021 年 6 月 10 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日
	海睿进取 A	海睿进取 B	海睿进取 A	海睿进取 B	海睿进取 A	海睿进取 B
本期已实现收益	-2,443,323.17	-5,963,026.30	-9,830,166.71	-29,332,122.20	-548,789.43	-3,588,571.14
本期利润	-3,690,874.59	-9,003,656.49	-11,490,314.63	-34,539,755.27	-3,853,847.61	-4,804,661.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0979	-0.0828	-0.2820	-0.2561	-0.0828	-0.0258
本期加权平均净值	-13.02%	-12.52%	-31.99%	-33.01%	-7.52%	-2.66%

利润率						
本期基金份额净值增长率	-12.64%	-12.63%	-26.32%	-26.31%	-7.24%	-6.63%
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	-11,516,895.08	-39,239,901.56	-8,390,427.72	-38,123,099.70	2,690,873.96	-10,115,066.85
期末可供分配基金份额利润	-0.3152	-0.3989	-0.2161	-0.3120	0.0639	-0.0663
期末基金资产净值	25,027,208.88	59,122,084.20	30,430,570.33	84,057,878.38	44,819,506.74	142,535,314.43
期末基金份额净值	0.6848	0.6011	0.7839	0.6880	1.0639	0.9337
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	-40.30%	-39.89%	-31.66%	-31.20%	-7.24%	-6.63%

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

海睿进取 A

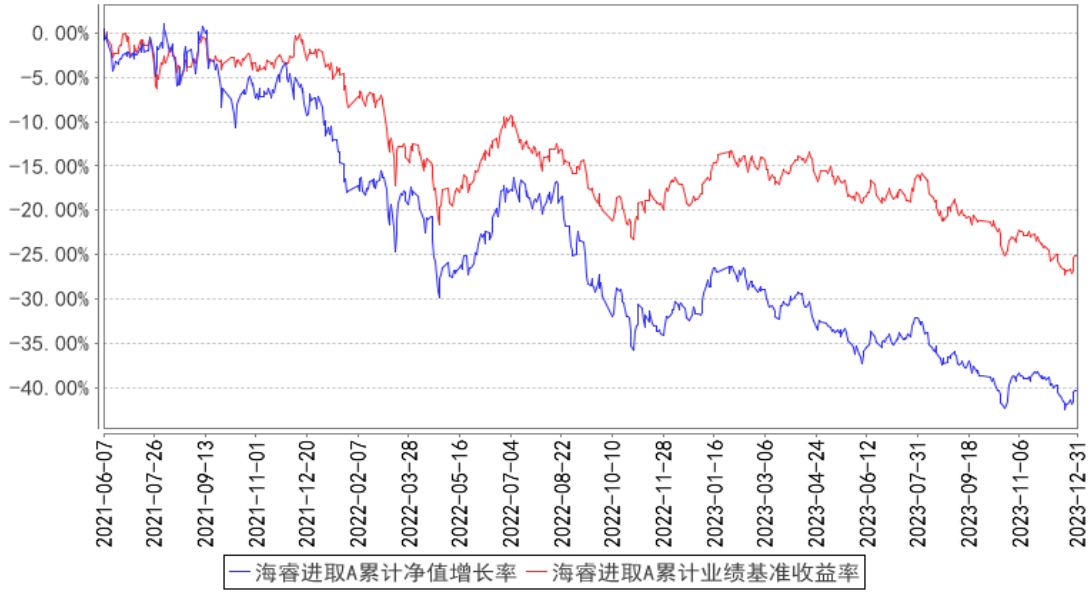
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.73%	0.79%	-4.95%	0.63%	2.22%	0.16%
过去六个月	-8.92%	0.77%	-8.19%	0.66%	-0.73%	0.11%
过去一年	-12.64%	0.78%	-7.96%	0.65%	-4.68%	0.13%
自基金合同生效起至今	-40.30%	1.10%	-25.15%	0.82%	-15.15%	0.28%

海睿进取 B

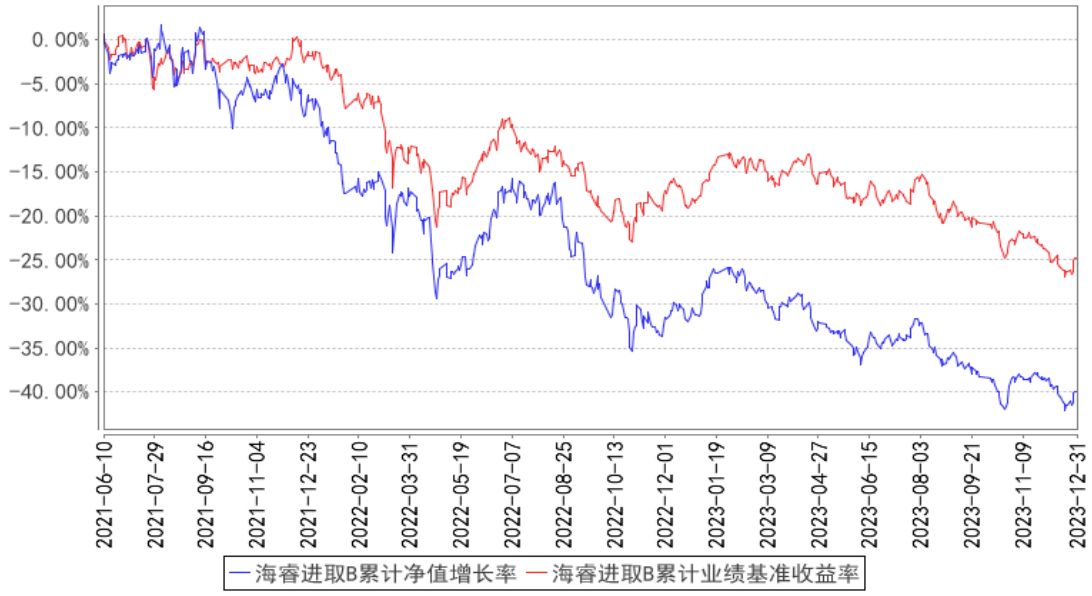
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.72%	0.79%	-4.95%	0.63%	2.23%	0.16%
过去六个月	-8.91%	0.77%	-8.19%	0.66%	-0.72%	0.11%
过去一年	-12.63%	0.77%	-7.96%	0.65%	-4.67%	0.12%
自基金合同生效起至今	-39.89%	1.10%	-24.72%	0.83%	-15.17%	0.27%

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

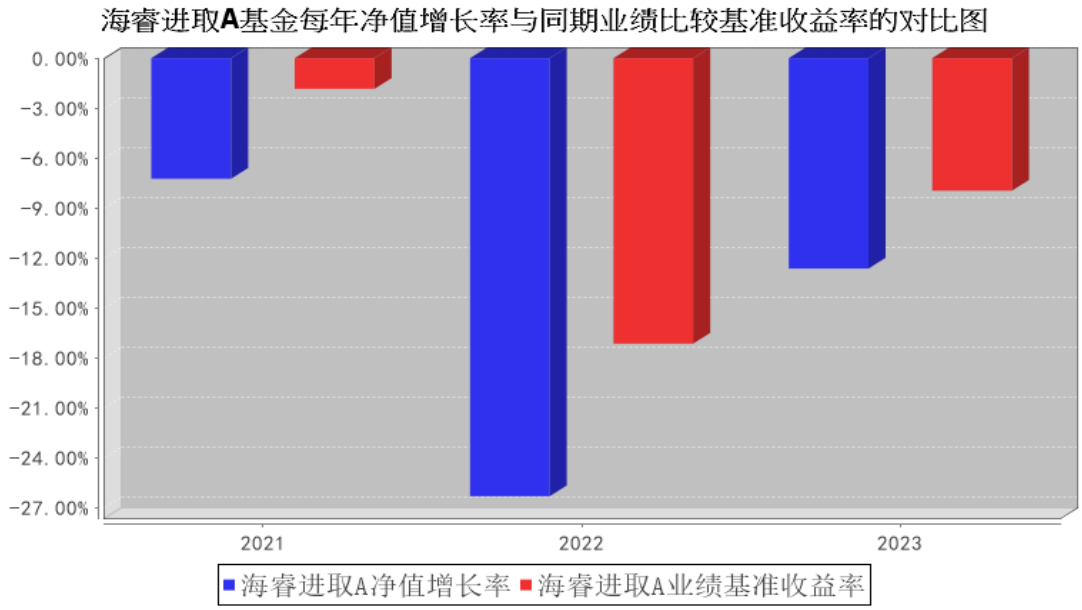
海睿进取A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

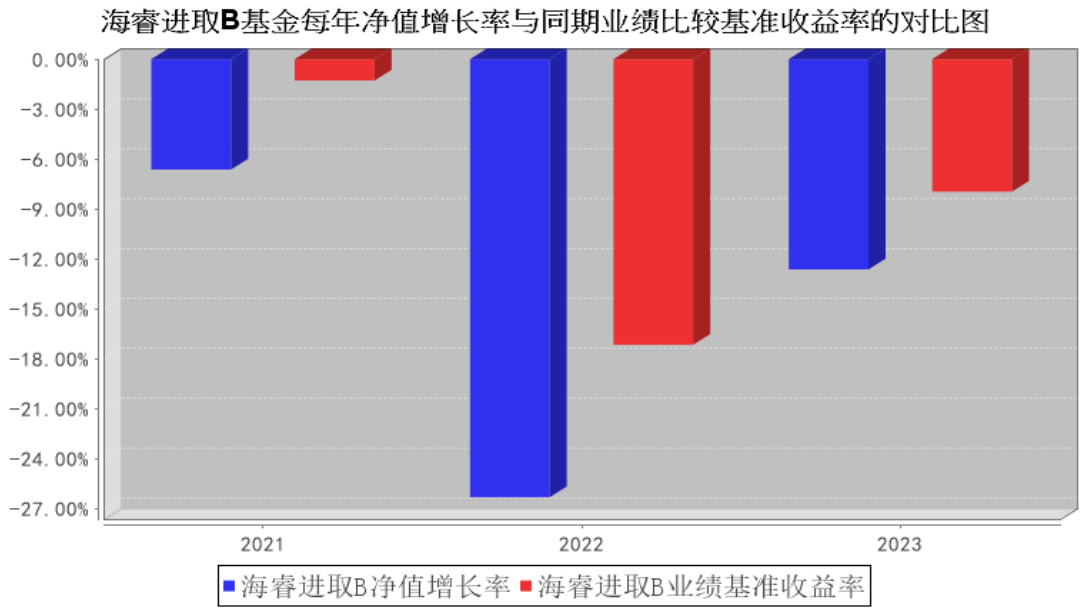


海睿进取B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：注：本集合计划自成立至本报告期末未进行利润分配。

§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

东海证券成立于 1993 年，原名“常州证券”，是全国最早设立的综合性券商之一，2005 年成为全国首批 10 家创新试点券商之一；2015 年在全国中小企业股份转让系统挂牌。目前，公司

注册资本为 18.56 亿元，客户数超百万。公司始终倡导“务实、创新、规范、协同”的价值理念，坚守稳健合规的经营理念，各项经营指标均符合监管要求。

东海证券 2005 年取得证监会出具的《关于东海证券有限责任公司客户资产管理业务资格的批复》（证监机构字[2005]77 号）批准从事客户资产管理业务的资格。

东海证券设立资产管理部，由资产管理部开展资产管理业务。为落实公募业务与私募业务相分离的监管要求，资产管理部设立专门的基金投资团队和专户投资团队，分别负责大集合产品和私募产品的投资运作；设置独立研究团队，提供投资研究支持，确保各个岗位保持独立，权责分明、互相制衡。

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		
刘迟到	本基金的基金经理	2022 年 9 月 6 日	-	15 年	硕士研究生，2008 年 4 月-2018 年 3 月曾任天相投顾、浙商证券、申万宏源研究所家电行业分析师、2018 年 4 月-2022 年 5 月任海外大型 QFII 研究员和投资经理，长期深耕于消费品领域投资和研究，集中和逆向投资相结合，与公司长期发展共同成长。
席红辉	本基金的基金经理	2022 年 3 月 17 日	2023 年 11 月 15 日	11 年	历任长江养老保险战略与产品研发部主管、华安基金创新业务事业部高级经理，华商基金第四投资事业部负责人兼执行投资总监、投资经理、东海证券资产管理部投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：期末无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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同约定的行为，未有损害计划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

本集合计划管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有集合计划投资组

合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各集合计划投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有集合计划投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东海证券股份有限公司资产管理部公平交易实施细则》等规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本集合计划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成交量 5%的情况。

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 股市场全线下跌，上证指数报收入于 2974.9 点，下跌 3.7%，深证成指、沪深 300 指数、创业板指数分别下跌 13.5%、19.4%和 11.4%。按照申万 31 个行业指数划分，TMT 板块涨幅领先，通信、传媒和计算机涨幅前三，分别上涨 25.8%、16.8%和 9%，电子板块紧随其后，上涨 7.3%，周期板块中石油石化、煤炭表现相对较好；跌幅前三的分别是美容护理、商贸零售、房地产板块，分别下跌 32%、31.3%和 26.4%，其他电力设备、建筑材料以及社会服务跌幅均达到 15%以上，板块之间走势分化严重。

从全年角度来看，中国经济平稳运行，2023 年中国 GDP 达到 126.06 万亿，同比增长 5.2%，符合年初市场预期；规模以上企业工业增加值比上年增长 4.6%，其中装备制造业增加值达到 6.8%，增速高出规模以上工业增加值 2.2 个百分点，但是，2023 年 CPI 仅比上年上涨 0.2%，扣除食品和能源价格后，核心 CPI 上涨 0.7%，第四季度 CPI 出现了小幅下滑。另一个影响中国经济的关键变量房地产市场走势依然低迷，商品住宅销售面积 9.48 亿平米，同比下降 8.2%，相比 2021 的高点

15.66 亿平米的销售面积，下降幅度接近 40%，由于竣工的滞后性，商品住宅竣工面积同比达到 17.2%的增幅，截至 12 月份底，商品住宅待售面积同比提高达到 22.2%。全球的角度来看，主要经济体经济体美国经济走势强劲，第四季度 GDP 增速达到 3.3%，虽然相对于前两年通胀有所缓解，但是 CPI 和核心 CPI 依然保持 3%以上的相对高位运行，从而导致 2023 年年初美联储降息一致预期落空。

从二级市场的角度，市场对经济的预期高开低走，2022 年 12 月新冠疫情管制完全放开，投资者预期经济将出现较好的恢复性增长，年初外资大幅涌入，从而带动 A 股走出了一波小阳春，但是后期地产销售疲软，经济各项指标均有所回落，从而导致投资者悲观情绪持续低迷。全年市场最大的看点在于人工智能从 0 到 1 突破过程中带来的投资机会，从上游的光通信，到下游的应用端，热点从 1 季度末维持到 7、8 月份；年初中特估行情热度维持时间相对较短，仅 2 个月左右。第三季度伴随着反腐的持续推进，医药板块走势受到打击，9 月份情绪有所反弹；军工板块受到反腐及其他原因的影响，订单恢复持续低于预期，虽 12 月份有所恢复，但程度仍低于市场预期。

2024 年开年以来，中证 500 和中证 1000 雪球敲入，中小以及微盘股大幅下跌，从而带动过去几年市场规模急剧扩大的量化基金大幅抛售等一系列的连锁事件，导致市场过度下跌，但是政府通过一系列的措施来防止进一步恶化，如通过申购 ETF、加大处罚之前的违规操作、更换监管机构管理层等等。

操作上，对年初持有的新能源、家电仓位进行了减持或清仓，增持了中药、食品、兽用疫苗板块，在相对高位减仓了部分白酒持仓，并于年底在高端白酒之间进了部分仓位的切换。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划 A 份额净值为 0.6848 元，本报告期计划份额净值增长率为-12.64%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%；截至本报告期末东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划 B 份额净值为 0.6011 元，本报告期计划份额净值增长率为-12.63%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年的宏观经济依然面临较大的不确定性：第一、由于房地产价格持续下行，股票市场低迷、消费者收入预期下降等因素导致内需相对不足；第二、中美关系方面，今年是美国大选年，无论共和党还是民主党对华政策强硬以达成共识，美国对于中国生产和出口的产品、核心技术的封堵等方面是否会进一步加码充满未知数；第三，台湾民进党再次当选，是否会导致台海局势恶化；第四、企业家还是消费者信心的恢复尚需时日。从行业上来看，由于 2021 年下半年开始地产销售开始下滑，预计 2024 年商品房竣工数据可能受到一定影响，因此，相应下游需求可能会受到

减少；AI 技术的持续突破，会对 TMT 行业带来脉冲性的冲击；军工订单以及行业景气度的恢复将是大概率事件，只是时间尚无法确定；农业板块，猪价上半年可能依然低迷，下半年猪价将可能出现阶段性反弹。展望全年，经过今年一月份的大幅调整，未来证券市场的机会大于风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本集合计划管理人为防范和化解经营风险，确保集合计划投资的合法合规、切实维护集合计划份额持有人的最大利益，主要采取了如下监察稽核工作：公司紧密跟踪法律法规和监管要求，防控各类合规风险，促进公司各项业务合法合规；进一步完善内部控制制度体系建设，对参公资产管理业务制度进行了全面的梳理，细化风险管理的相关规章制度及流程，进一步明确岗位职责及操作规程；开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和资管产品销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、资管产品宣传推介材料，防范各类合规风险；公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督检查等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理、监控及提示，督促投研交易业务的合规开展；定期和不定期开展多项内部稽核，特别是对投资研究、资管产品交易等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本集合计划管理人所管理的资管产品整体运作合法合规。本集合计划管理人将继续以风险控制为核心，坚持集合计划份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障资管产品安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由财务、风险管理、运营等相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、资管产品投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、资管产品的风险控制与绩效评估、会计政策与资管产品核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，运营部应征询会计师事务所、集合计划托管人的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上的，应就集合计划管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征

的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及集合计划合同的规定。

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，本集合计划未有连续二十个工作日出现集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情况。

§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，本集合计划托管人在对东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和集合计划合同的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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，东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划的管理人——东海证券股份有限公司在东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划份额申购赎回价格计算、集合计划费用开支等问题上，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。本报告期内，东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划未进行利润分配。

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

本托管人依法对东海证券股份有限公司编制和披露的东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告中财务指标、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 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]11080 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	东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“海睿进取集合计划”)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。公允反映了海睿进取集合计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和集合计划净值变动情况。
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，我们独立于海睿进取集合计划，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	-
其他事项	海睿进取集合计划财务报表仅为满足中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会的监管需要之目的而编制。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于供海睿进取集合计划管理人报送中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会使用，而不应分发至除海睿进取集合计划持有人、中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会以外的其他机构或人员或为其使用。 本段内容不影响已发表的审计意见。
其他信息	海睿进取集合计划管理人东海证券股份有限公司（以下简称“集合计划管理人”）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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	集合计划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。 在编制财务报表时，集合计划管理人管理层负责评估海睿进取集合计划的持续经营能力，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。 集合计划管理人治理层负责监督海睿进取集合计划的财务报告过程。
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。 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： 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。 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。 3.评价集合计划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。 4.对集合计划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，就可能导致对海睿进取集合计划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海睿进取集合计划不能持续经营。 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。 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。
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 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划

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	6,338,576.73	17,673,957.51
结算备付金		111,809.23	62,979.27
存出保证金		10,400.21	51,519.63
交易性金融资产	7.4.7.2	68,999,968.37	97,860,277.93
其中：股票投资		66,349,452.86	87,760,203.00
基金投资		-	-
债券投资		2,650,515.51	10,100,074.93
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	-1,359.10	-
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		9,090,689.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		84,550,084.44	115,648,734.34
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		-	-
应付赎回款		11,057.20	728,904.30

应付管理人报酬		85,783.00	118,654.08
应付托管费		16,441.75	22,742.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	287,509.41	289,985.22
负债合计		400,791.36	1,160,285.63
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	134,906,089.72	161,001,976.13
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-50,756,796.64	-46,513,527.42
净资产合计		84,149,293.08	114,488,448.71
负债和净资产总计		84,550,084.44	115,648,734.34

注： 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，东海海睿进取集合计划份额总额 134,906,089.72 份。东海海睿进取灵活配置混合 A 集合计划份额总额 36,544,103.96 份，集合计划份额净值 0.6848 元；东海海睿进取灵活配置混合 B 集合计划份额总额 98,361,985.76 份，集合计划份额净值 0.6011 元。

7.2 利润表

会计主体：东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划

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		-11,061,037.92	-43,815,385.63
1.利息收入		175,360.26	178,366.56
其中：存款利息收入	7.4.7.13	125,387.22	109,282.82
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		49,973.04	69,083.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,955,029.40	-37,153,698.22
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-8,268,609.63	-38,759,607.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	35,098.60	365,692.51
资产支持证券投资收益	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	1,278,481.63	1,240,217.14
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	-4,288,181.61	-6,867,780.99
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	6,812.83	27,727.02
减：二、营业总支出		1,633,493.16	2,214,684.27
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	1,207,329.02	1,693,225.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	231,404.62	324,535.02
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		1,294.76	831.08
8．其他费用	7.4.7.23	193,464.76	196,092.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,694,531.08	-46,030,069.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,694,531.08	-46,030,069.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,694,531.08	-46,030,069.90

7.3 净资产变动表

会计主体：东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划

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	161,001,976.13	-	-46,513,527.42	114,488,448.71

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	161,001,976.13	-	-46,513,527.42	114,488,448.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,095,886.41	-	-4,243,269.22	-30,339,155.63
（一）、综合收益总额	-	-	-12,694,531.08	-12,694,531.08
（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）	-26,095,886.41	-	8,451,261.86	-17,644,624.55
其中：1.基金申购款	420,617.98	-	-141,979.23	278,638.75
2.基金赎回款	-26,516,504.39	-	8,593,241.09	-17,923,263.30
（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	134,906,089.72	-	-50,756,796.64	84,149,293.08
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	194,779,014.06	-	-7,424,192.89	187,354,821.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	194,779,014.06	-	-7,424,192.89	187,354,821.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-33,777,037.93	-	-39,089,334.53	-72,866,372.46
（一）、综合收益总额	-	-	-46,030,069.90	-46,030,069.90
（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）	-33,777,037.93	-	6,940,735.37	-26,836,302.56
其中：1.基金申购款	2,144,602.34	-	-460,766.49	1,683,835.85
2.基金赎回款	-35,921,640.27	-	7,401,501.86	-28,520,138.41
（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	161,001,976.13	-	-46,513,527.42	114,488,448.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署：

王文卓	蔡志勇	吴江虹
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

东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由东风 5 号集合资产管理计划变更而来。东风 5 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2010 年 1 月 14 日经中国证监会证监许可（2010）52 号文核准设立，自 2010 年 3 月 15 日起开始募集 于 2010 年 4 月 20 日结束募集工作，并于 2010 年 4 月 26 日正式成立。东风 5 号

集合资产管理计 划于 2015 年 7 月进行了合同变更，主要修改了集合计划的终止条款。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用《关于规范金融机构资产管理业务的指导 意见）操作指引》（证监会公告（2018）39 号）的规定，东风 5 号集合资产管理计划已完成产品的 规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准，自 2021 年 6 月 7 日起，《东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《东风 5 号集合资产管理计 划合同》同日起失效。原东风 5 号集合资产管理计划份额在《东海证券海睿进取灵活配置混合型 集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为 A 类集合计划份额。A 类集合计划份额的持有人 可在本集合计划开放赎回业务后任一开放日办理赎回业务。B 类集合计划份额开放日常申购与赎 回业务，B 类集合计划份额的持有人可在本集合计划开放申购赎回业务后任一开放日办理申购赎 回业务。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含公司债、企业债、国债、金融债、央行票据、短期融资券、可转换公司债券、分离交易可转债）、债券逆回购、资产支持证券等各类金融工具、银行存款及其他中国证监会允许投资的金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。集合计划的投资组合比例为:股票资产占集合计划资产的比例为 0%-90%。本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%.其中现金不包括 结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划业绩比较基准：中证 800 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》《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》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的

有关规定的要求，真实、完整地反映了本集合计划报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2023 年 1 月 1 日 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本集合计划选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1.金融资产的分类

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集合计划管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划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。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单、资产支持证券和衍生工具等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划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。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2.金融负债的分类

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。本集合计划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。本集合计划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。

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和金融负债，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。

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。

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，本集合计划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，本集合计划按照未来 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，本集合计划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，本集合计划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，本集合计划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。

本集合计划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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本集合计划均按照整个存续期的预期

信用损失计量损失准备。

本集合计划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，且本集合计划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；（3）该金融资产已转移，虽然本集合计划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

本集合计划计价持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）等按如下原则确定公允价值并进行估值：

1.对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2.对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对

前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，集合计划管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于集合计划相关活动确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致集合计划份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占集合计划净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

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。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由各兑付机构代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，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按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1.在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

2.本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益

分配方式是现金分红；

3.本集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即本集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4.同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

5.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本报告期间，本集合计划无需说明的外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、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。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本集合计划无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

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，本集合计划无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间，本集合计划无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

- 本集合计划本报告期内无需说明的会计差错更正。

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[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》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列示如下：

1.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。

2.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。

自 2018 年 1 月 1 日起，管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。

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。

3.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。

4.对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。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。

5.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。

6.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。

7.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。

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	6,338,576.73	17,673,957.51

等于：本金	6,336,293.98	17,669,852.49
加：应计利息	2,282.75	4,105.02
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	6,338,576.73	17,673,957.51

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		75,488,265.28	-	66,349,452.86	-9,138,812.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,599,079.00	50,255.51	2,650,515.51	1,181.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,599,079.00	50,255.51	2,650,515.51	1,181.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		78,087,344.28	50,255.51	68,999,968.37	-9,137,631.42
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		92,592,822.81	-	87,760,203.00	-4,832,619.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,915,840.00	201,064.93	10,100,074.93	-16,830.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	9,915,840.00	201,064.93	10,100,074.93	-16,830.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		102,508,662.81	201,064.93	97,860,277.93	-4,849,449.81

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

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-1,359.10	-
银行间市场	-	-
合计	-1,359.10	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末及上年度末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期末及上年度末，本集合计划均无按预期信用损失一般模型计提减值准备情况。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本集合计划本报告期末及上年度末未有债权投资情况。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期末及上年度末，本集合计划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

注：本集合计划本报告期末及上年度末未有其他债权投资情况。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本集合计划本报告期末及上年度末未有其他债权投资情况。

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

注：本集合计划本报告期末及上年度末未有其他权益工具投资情况。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本集合计划本报告期末及上年度末未有其他权益工具投资情况。

7.4.7.8 其他资产

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有其他资产。

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	-	1,370.12
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	17,509.41	18,615.10
其中：交易所市场	17,509.41	18,615.10
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	270,000.00	270,000.00
合计	287,509.41	289,985.22

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海睿进取 A

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	38,820,998.05	38,820,998.05
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,276,894.09	-2,276,894.09
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	36,544,103.96	36,544,103.96

海睿进取 B

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	122,180,978.08	122,180,978.08
本期申购	420,617.98	420,617.98
本期赎回（以“-”号填列）	-24,239,610.30	-24,239,610.30
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	98,361,985.76	98,361,985.76

7.4.7.11 其他综合收益

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

海睿进取 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,697,734.31	-32,088,162.03	-8,390,427.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	23,697,734.31	-32,088,162.03	-8,390,427.72
本期利润	-2,443,323.17	-1,247,551.42	-3,690,874.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,336,085.10	1,900,492.33	564,407.23
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,336,085.10	1,900,492.33	564,407.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,918,326.04	-31,435,221.12	-11,516,895.08

海睿进取 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-27,204,099.16	-10,919,000.54	-38,123,099.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-27,204,099.16	-10,919,000.54	-38,123,099.70
本期利润	-5,963,026.30	-3,040,630.19	-9,003,656.49

本期基金份额交易产生的变动数	5,620,991.14	2,265,863.49	7,886,854.63
其中：基金申购款	-100,366.21	-41,613.02	-141,979.23
基金赎回款	5,721,357.35	2,307,476.51	8,028,833.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,546,134.32	-11,693,767.24	-39,239,901.56

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	123,589.48	99,599.13
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	1,450.81	8,009.46
其他	346.93	1,674.23
合计	125,387.22	109,282.82

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	-8,268,609.63	-38,759,607.87
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-8,268,609.63	-38,759,607.87

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	91,828,269.35	474,863,467.43

减：卖出股票成本总额	99,864,798.87	512,178,871.57
减：交易费用	232,080.11	1,444,203.73
买卖股票差价收入	-8,268,609.63	-38,759,607.87

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：

本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均无股票投资收益——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	57,888.97	358,424.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,790.37	7,267.60
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	35,098.60	365,692.51

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	17,273,310.00	51,018,825.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,921,325.00	49,834,721.10
减：应计利息总额	373,310.00	1,171,357.17
减：交易费用	1,465.37	5,479.30
买卖债券差价收入	-22,790.37	7,267.60

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划在本报告期内无债权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

注：本集合计划在本报告期内无债权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

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间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

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

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

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

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

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

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	1,278,481.63	1,240,217.14

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	1,278,481.63	1,240,217.14

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	-4,288,181.61	-6,867,780.99
股票投资	-4,306,192.61	-6,850,863.39
债券投资	18,011.00	-16,917.60
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	-4,288,181.61	-6,867,780.99

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	6,812.83	27,727.02
合计	6,812.83	27,727.02

7.4.7.22 信用减值损失

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 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
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	7,464.76	23,592.30

银行账户维护费	36,000.00	22,500.00
合计	193,464.76	196,092.30

7.4.7.24 分部报告

本集合计划在本报告期间及上年度可比期间均无分部报告 -

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，本集合计划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

截至本会计报告批准报出日，本集合计划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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	集合计划托管人、集合计划销售机构
东海证券股份有限公司(“东海证券”)	集合计划管理人、集合计划销售机构
东海期货有限责任公司	集合计划管理人的全资子公司、集合计划销售机构
关联自然人	公司董监高及其关系密切的家庭成员

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	158,652,932.17	100.00	969,328,814.41	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）

东海证券	9,604,564.00	100.00	28,284,163.60	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
东海证券	94,456,000.00	100.00	198,400,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均未通过关联方交易单元进行权证易。

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	148,242.53	100.00	17,509.41	100.00
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（%）
东海证券	892,185.13	100.00	18,615.10	100.00

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	1,207,329.02	1,693,225.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	252,355.47	459,563.77
应支付基金管理人的净管理费	954,973.55	1,233,662.10

注：支付本集合计划管理人东海证券股份有限公司的管理人报酬按前一日集合计划资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日集合计划管理人报酬=前一日集合计划资产净值×1.20%÷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	231,404.62	324,535.02

注：支付集合计划托管人交通银行股份有限公司的集合计划托管费按前一日集合计划资产净值×0.23%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×0.23%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划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

注：本集合计划在本报告期内及上年度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

注：本集合计划在本报告期内及上年度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

注：本集合计划在本报告期内及上年度未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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固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	
	海睿进取 A	海睿进取 B
基金合同生效日（ 2021 年 6 月 7 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	6,166,129.14
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	1,620,474.67

报告期末持有的基金份额	-	4,545,654.47
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.37%
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	海睿进取 A	海睿进取 B
基金合同生效日（ 2021 年 6 月 7 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	6,166,129.14
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	6,166,129.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.83%

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

份额单位：份

海睿进取 A

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
关联自然人	-	-	0.00	0.00

份额单位：份

海睿进取 B

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
关联自然人	1,595,175.07	1.18	1,473,901.90	0.92

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
交通银行	6,338,576.73	123,589.48	17,673,957.51	99,599.13

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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，本集合计划无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

注：本集合计划在本报告期内未进行过利润分配。

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

注：于 2022 年 12 月 31 日，本集合计划未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流动受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末，本集合计划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

注：本报告期末，本集合计划未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本集合计划未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本报告期末，本集合计划无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

本集合计划在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了组织健全、职责边界清晰的风险管理组织架构体系，形成多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制。风险管理组织架构由董事会及其风险控制委员会、监事会、经营管理层及其下设的各专业委员会、风险管理部门（风险管理部及其他各类专业风险管理部门）、其他各部门、分支机构及子公司组成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本集合计划在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,650,515.51	10,100,074.93
合计	2,650,515.51	10,100,074.93

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要为国债、政策性金融债、超短期融资券及同业存单等。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有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

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有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

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有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

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有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

流动性风险是指集合计划所持金融工具变现的难易程度。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可在集合计划每个开放日要求赎回其持有的集合计划份额，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

本集合计划的集合计划管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全集合计划流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的集合计划管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的集合计划管理人在集合计划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带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

本集合计划所持证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此除在 7.4.12 中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

本集合计划本报告期内无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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。本集合计划的集合计划管理人定期对本集合计划面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,338,576.73	-	-	-	6,338,576.73
结算备付金	111,809.23	-	-	-	111,809.23
存出保证金	10,400.21	-	-	-	10,400.21
交易性金融资产	2,650,515.51	-	-	66,349,452.86	68,999,968.37
买入返售金融资产	-1,359.10	-	-	-	-1,359.10
应收清算款	-	-	-	9,090,689.00	9,090,689.00
资产总计	9,109,942.58	-	-	75,440,141.86	84,550,084.44

负债					
应付赎回款	-	-	-	11,057.20	11,057.20
应付管理人报酬	-	-	-	85,783.00	85,783.00
应付托管费	-	-	-	16,441.75	16,441.75
其他负债	-	-	-	287,509.41	287,509.41
负债总计	-	-	-	400,791.36	400,791.36
利率敏感度缺口	9,109,942.58	-	-	75,039,350.50	84,149,293.08
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,673,957.51	-	-	-	17,673,957.51
结算备付金	62,979.27	-	-	-	62,979.27
存出保证金	51,519.63	-	-	-	51,519.63
交易性金融资产	10,100,074.93	-	-	87,760,203.00	97,860,277.93
资产总计	27,888,531.34	-	-	87,760,203.00	115,648,734.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	728,904.30	728,904.30
应付管理人报酬	-	-	-	118,654.08	118,654.08
应付托管费	-	-	-	22,742.03	22,742.03
其他负债	-	-	-	289,985.22	289,985.22
负债总计	-	-	-	1,160,285.63	1,160,285.63
利率敏感度缺口	27,888,531.34	-	-	86,599,917.37	114,488,448.71

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点		
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 ）
	市场利率上升 25 个基点	-272.31	-898.99
	市场利率下降 25 个基点	272.31	898.83

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。本集合计划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

本集合计划其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指集合计划所持金融工具的

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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划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	66,349,452.86	78.85	87,760,203.00	76.65
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	2,650,515.51	3.15	10,100,074.93	8.82
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	68,999,968.37	82.00	97,860,277.93	85.48

注：由于四舍五入的原因,分项和合计项比例存在尾差.

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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 ）
	权益投资公允价值增加 5%	4,060,184.94	6,188,336.88
	权益投资公允价值减少 5%	-4,060,184.94	-6,188,336.88

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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和金融负债，按照公允价值进行后续计量。

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，且本集合计划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；（3）该金融资产已转移，虽然本集合计划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。

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）等按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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

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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，集合计划管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

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	66,349,452.86	87,760,203.00
第二层次	2,650,515.51	10,100,074.93
第三层次	-	-
合计	68,999,968.37	97,860,277.93

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均无公允价值所属层次间的重大变动。

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

注：本集合计划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。

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

非持续的公允价值计量，是指其他相关会计准则要求或者允许集合计划管理人在特定情况下的资产负债表中以公允价值进行的计量。

在相关资产或负债初始确认后的资产负债表中，集合计划管理人至少应当在附注中披露非持续以公允价值计量的每组资产和负债的下列信息：

1）其他相关会计准则要求或者允许集合计划管理人在特定情况下非持续以公允价值计

量的项目和金额，以及以公允价值计量的原因。

2）公允价值计量的层次。

3）对于第二层次的公允价值计量，集合计划管理人应当披露使用的估值技术和输入值的描述性信息。当变更估值技术时，集合计划管理人还应当披露这一变更以及变更的原因。

4）对于第三层次的公允价值计量，集合计划管理人应当披露使用的估值技术、输入值和估值流程的描述性信息，当变更估值技术时，集合计划管理人还应当披露这一变更以及变更的原因。集合计划管理人应当披露公允价值计量中使用的重要不可观察输入值的量化信息。

5）当非金融资产的最佳用途与其当前用途不同时，集合计划管理人应当披露这一事实及其原因。

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资产和负债主要包括：货币资金、应收票据、应收账款、其他应收款、短期借款、应付票据、应付账款、其他应付款、一年内到期的长期借款、长期应付款、长期借款和应付债券等。除持有至到期投资、长期应收款、长期借款、应付债券、长期应付款、其他流动负债（不含递延收益）以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值通常相差很小。长期应收款、固定利率的长期借款以及不存在活跃市场的应付债券，通常以合同规定的未来现金流量按照市场上具有可比信用等级并在相同条件下提供几乎相同现金流量的市场收益率进行折现后的现值确定其公允价值。

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，本集合计划无有助于理解和分析财务报表需要说明的其他事项。

§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	66,349,452.86	78.47
	其中：股票	66,349,452.86	78.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,650,515.51	3.13
	其中：债券	2,650,515.51	3.13
	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	-1,359.10	-0.00
	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	6,450,385.96	7.63
8	其他各项资产	9,101,089.21	10.76
9	合计	84,550,084.44	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	6,192,522.00	7.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,010,905.86	64.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,146,025.00	7.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	66,349,452.86	78.85

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	603566	普莱柯	329,200	7,456,380.00	8.86
2	300760	迈瑞医疗	23,900	6,945,340.00	8.25
3	300498	温氏股份	308,700	6,192,522.00	7.36
4	300783	三只松鼠	340,500	6,146,025.00	7.30
5	002179	中航光电	154,830	6,038,370.00	7.18
6	002557	洽洽食品	150,200	5,229,964.00	6.22
7	300593	新雷能	337,370	4,982,954.90	5.92
8	600519	贵州茅台	2,420	4,176,920.00	4.96
9	000568	泸州老窖	23,200	4,162,544.00	4.95
10	600372	中航机载	272,084	3,586,067.12	4.26
11	300750	宁德时代	17,760	2,899,497.60	3.45
12	603998	方盛制药	250,400	2,744,384.00	3.26
13	300595	欧普康视	107,800	2,434,124.00	2.89
14	605338	巴比食品	87,200	1,873,056.00	2.23
15	688685	迈信林	49,842	1,481,304.24	1.76

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	603566	普莱柯	9,421,538.00	8.23
2	600372	中航机载	7,973,184.12	6.96
3	002557	洽洽食品	7,942,119.00	6.94
4	002179	中航光电	6,816,349.93	5.95
5	300498	温氏股份	6,750,687.00	5.90
6	300783	三只松鼠	6,527,315.00	5.70
7	300593	新雷能	5,663,877.39	4.95
8	002013	中航机电	4,634,507.00	4.05
9	601888	中国中免	4,283,530.00	3.74
10	300595	欧普康视	3,636,360.00	3.18
11	603998	方盛制药	2,856,340.98	2.49
12	688685	迈信林	2,512,585.48	2.19
13	605338	巴比食品	2,205,505.00	1.93
14	300760	迈瑞医疗	2,148,589.44	1.88
15	300014	亿纬锂能	1,976,341.00	1.73
16	300101	振芯科技	1,822,518.00	1.59
17	002624	完美世界	1,700,636.00	1.49
18	000403	派林生物	1,357,302.00	1.19
19	000568	泸州老窖	1,201,910.00	1.05
20	603833	欧派家居	666,809.00	0.58

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	605111	新洁能	9,123,044.57	7.97
2	002032	苏泊尔	8,851,147.50	7.73
3	002508	老板电器	8,322,132.35	7.27
4	002013	中航机电	7,973,184.12	6.96
5	600519	贵州茅台	6,743,236.80	5.89
6	300595	欧普康视	5,749,021.00	5.02
7	000333	美的集团	5,304,508.00	4.63
8	300450	先导智能	4,126,126.00	3.60
9	300750	宁德时代	4,055,655.96	3.54
10	300014	亿纬锂能	3,970,266.00	3.47
11	002371	北方华创	3,614,945.00	3.16
12	300724	捷佳伟创	3,569,114.00	3.12
13	601888	中国中免	2,943,295.97	2.57
14	603218	日月股份	2,752,729.00	2.40
15	600372	中航机载	2,663,401.80	2.33
16	688685	迈信林	1,762,520.00	1.54
17	000403	派林生物	1,755,408.00	1.53
18	300101	振芯科技	1,702,778.00	1.49
19	000568	泸州老窖	1,631,379.00	1.42
20	002624	完美世界	1,540,897.00	1.35

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	82,760,241.34
卖出股票收入（成交）总额	91,828,269.35

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,650,515.51	3.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,650,515.51	3.15

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	26,000	2,650,515.51	3.15

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本集合计划在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本集合计划管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

本集合计划的投资范围不包括国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划的投资范围不包括国债期货。

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

-本报告期内，本集合计划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受到公开谴责、处罚的情况。

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

本集合计划投资的前十名股票没有超出集合计划合同规定的备选股票库。

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	10,400.21
2	应收清算款	9,090,689.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,101,089.21

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：期末前十名股票中未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

-由于计算中四舍五入的原因，本报告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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
海睿进取 A	227	160987.24	1190668.70	3.26	35353435.26	96.74
海睿进取 B	1,474	66731.33	14722753.71	14.97	83639232.05	85.03
合计	1,701	79309.87	15913422.41	11.80	118992667.31	88.20

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	海睿进取 A	75,230.42	0.21
	海睿进取 B	4,162,979.48	4.23
	合计	4,238,209.90	3.14

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海睿进取 A	0
	海睿进取 B	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海睿进取 A	-
	海睿进取 B	50~100
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海睿进取 A	海睿进取 B
基金合同生效日（2021 年 6 月 7 日）基金份额总额	64,148,715.58	-
本报告期期初基金份额总额	38,820,998.05	122,180,978.08
本报告期基金总申购份额	-	420,617.98
减：本报告期基金总赎回份额	2,276,894.09	24,239,610.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,544,103.96	98,361,985.76

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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、集合计划管理人 2023 年 2 月 1 日发布公告，自 2023 年 1 月 18 日起新任蔡志勇先生为集合计划管理人财务总监，郭晋炜因人事调整，不再担任公司财务总监。

2、集合计划管理人 2023 年 10 月 12 日发布公告，自 2023 年 10 月 11 日起新任高宇先生为集合计划管理人执行委会委员。

3、集合计划管理人 2023 年 10 月 13 日发布公告，自 203 年 10 月 11 日起新任高宇先生

为集合计划管理人资产管理部分管领导，杨明先生不再担任资产管理部分管领导。

4、集合计划管理人 2023 年 12 月 7 日发布公告，自 2023 年 12 月 4 日起新任韩冬先生为集合计划管理人执行委员会委员。

5、本报告期内集合计划托管人的专门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管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划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

本报告期内集合计划管理人未改聘为其审计的会计师事务所。本集合计划本年度应支付给审计机构天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用为 1.8 万元，其已提供审计服务的连续年限为 3 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

注：本报告期内未发生集合计划管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生集合计托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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(%)	
东海证券	2	158,652,932.17	100.00	148,242.53	100.00	-

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

						(%)
东海证券	9,604,564.00	100.00	94,456,000.00	100.00	-	-

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	东海证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 1 日
2	东海证券股份有限公司关于调整旗下部分集合计划在上海好买基金销售有限公司的费率优惠和开通转托管业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
3	东海证券股份有限公司基金行业高级管理人员任命公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 12 日
4	东海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 13 日
5	东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 17 日
6	东海证券股份有限公司基金行业高级管理人员任命公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 7 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

注：本报告期内，不存在单一投资者持有集合计划份额比例达到或者超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等法规对照公募基金对本集合计划进行了规范改造，并在收到中国证监会准予本集合计划合同变更生效的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。改造后的集合计划合同已于 2021 年 6 月 07 日变更生效。

本集合计划于 2023 年 11 月 15 日投资经理变更为刘迟到，席红辉不再担任本集合计划投资经理，该项已按有关规定在中国证券投资基金业协会完成注册手续。并报中国证券监督管理委员会江苏监管局备案。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会关于准予东风 5 号集合资产管理计划合同变更的回函（机构部函〔2021〕957 号）；

2、东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划产品资料概要；

3、《东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

4、《东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照

6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告

8、法律法规及中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

本集合计划管理人的办公场所（地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 7 楼）

13.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人的网站（http://www.longone.com.cn）查询，或在营业时间内至集合计划管理人办公场所免费查阅。

东海证券股份有限公司

2024 年 3 月 30 日