

东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	15
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
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	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
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	62
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东海数字经济混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东海数字经济混合发起式	
基金主代码	018886	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 15 日	
基金管理人	东海基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,834,445.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东海数字经济混合发起式 A	东海数字经济混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	018886	018887
报告期末下属分级基金的份额总额	10,170,179.61 份	664,265.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘潜在的数字经济主题相关投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。 （二）数字经济主题的界定及投资策略 据国家统计局 2021 年第 33 号令，《数字经济及其核心产业统计分类（2021）》（以下简称“《分类》”）于 2021 年 5 月 27 日起实施，根据《分类》中的概念界定，“数字经济是指以数据资源作为关键生产要素、以现代信息网络作为重要载体、以信息通信技术的有效使用作为效率提升和经济结构优化的重要推动力的一系列经济活动。” 本基金界定的数字经济主题相关领域具体如下：（1）数字产品制造业；（2）数字产品服务业；（3）数字技术应用业；（4）数字要素驱动业；（5）数字化效率提升业。 本基金投资的数字经济主题行业主要分布于申万一级行业中的电子、通信、计算机、传媒、银行、非银金融、社会服务、商贸零售、公用事业、环保、医药生物、农林牧渔、电力设备、机械设备、轻工制造、建筑装饰、汽车、交通运输、家用电器以及服务于电子、通信、计算机及汽车行业的基础化工、有色金属。

	未来随着经济发展、技术进步、产业升级及市场变化等，本基金定义的数字经济主题涉及到行业可能相应变动，本基金可在履行适当程序后对上述界定进行调整。 （三）股票投资策略 1、相关子行业的配置策略 在初步构建数字经济主题股票池之后，本基金将深入研究产业链细分子行业的行业空间、产业政策、技术壁垒、商业模式等因素，并结合估值水平，适时调整各子领域的配置比例。 2、个股精选策略 对于与数字经济主题相关的上市公司，本基金将采用定量分析与定性分析相结合的方法进行投资。 3、存托凭证投资策略 本基金将在充分了解存托凭证存托协议和相关规则的基础上，参照上述股票投资策略优选具有较高投资价值的存托凭证进行投资。 （四）债券投资策略 主要包括普通债券投资策略、可转换债券投资策略、可交换债券投资策略、息差策略等。此外本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，适当放大债券资产投资比例，追求债券资产的超额收益。 （五）资产支持证券投资策略 本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法，结合信用管理和流动性管理，重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等，采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。 （六）金融衍生产品投资策略 主要包括股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略等。 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标及风险收益特征的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在更新的招募说明书中公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证数字经济主题指数收益率×75%+中债综合指数（全价）收益率×25%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	牛锐	冯萌
	联系电话	021-60586900	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-9595531	95561
传真		021-60586926	021-62159217

注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200122	200120
法定代表人	严晓珺	吕家进

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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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	2024 年		2023 年 8 月 15 日 (基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	东海数字经济混合发起式 A	东海数字经济混合发起式 C	东海数字经济混合发起式 A	东海数字经济混合发起式 C
本期已实现收益	-217,983.89	44,970.42	-462,696.95	-5,325.10
本期利润	246,227.39	20,449.50	-24,853.01	-386.70
加权平均基金份额本期利润	0.0241	0.0935	-0.0024	-0.0034
本期加权平均净值利润率	2.64%	9.54%	-0.25%	-0.35%
本期基金份额净值增长率	2.29%	1.81%	-0.25%	-0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	-688,779.27	-48,952.44	-462,822.70	-5,397.04

期末可供分配基金份额利润	-0.0677	-0.0737	-0.0455	-0.0470
期末基金资产净值	10,377,102.04	673,567.34	10,140,192.64	114,464.69
期末基金份额净值	1.0203	1.0140	0.9975	0.9960
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	2.03%	1.40%	-0.25%	-0.40%

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

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

(4)本基金基金合同生效日为 2023 年 08 月 15 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东海数字经济混合发起式 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	6.90%	2.62%	13.28%	2.49%	-6.38%	0.13%
过去六个月	15.03%	2.43%	34.90%	2.25%	-19.87%	0.18%
过去一年	2.29%	2.13%	21.07%	1.86%	-18.78%	0.27%
自基金合同生效起至今	2.03%	1.82%	10.02%	1.66%	-7.99%	0.16%

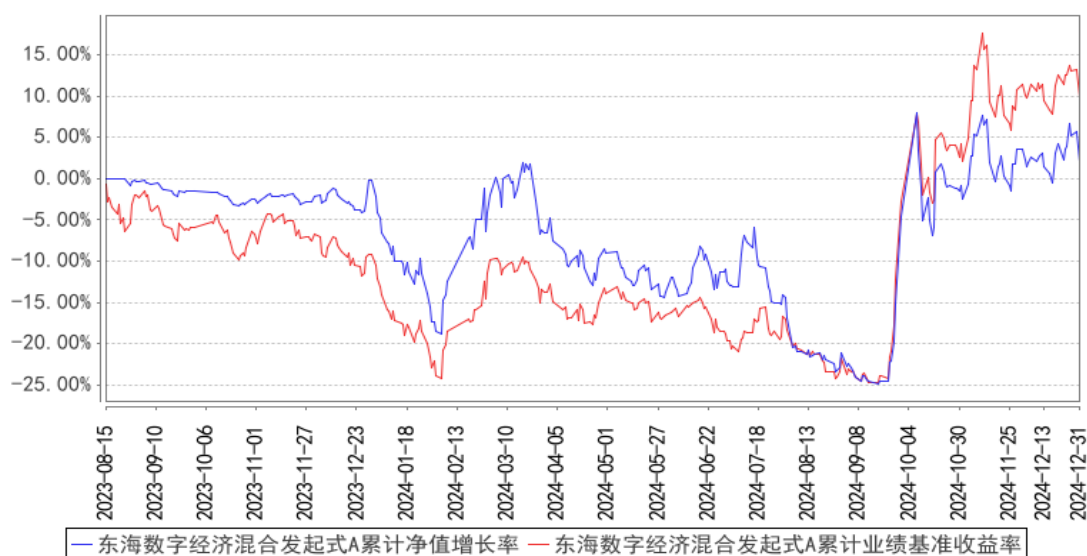
东海数字经济混合发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.82%	2.62%	13.28%	2.49%	-6.46%	0.13%

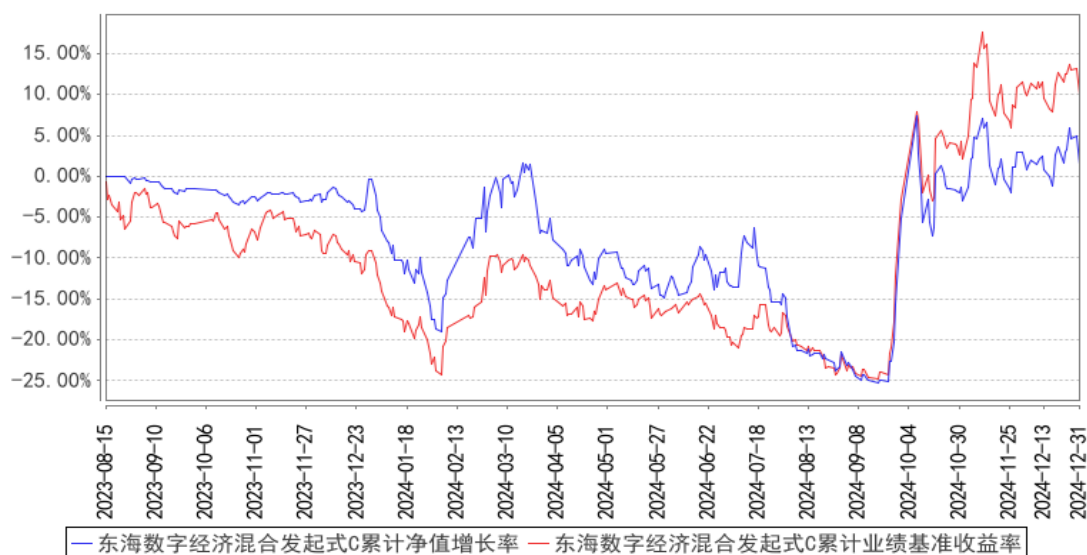
过去六个月	14.81%	2.43%	34.90%	2.25%	-20.09%	0.18%
过去一年	1.81%	2.13%	21.07%	1.86%	-19.26%	0.27%
自基金合同生效 起至今	1.40%	1.82%	10.02%	1.66%	-8.62%	0.16%

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

东海数字经济混合发起式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

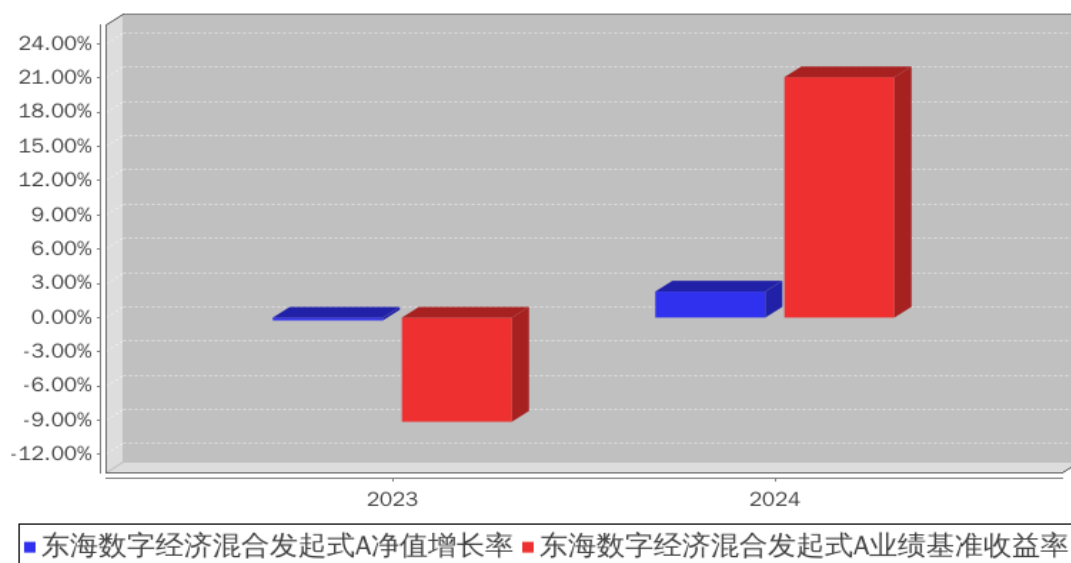


东海数字经济混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

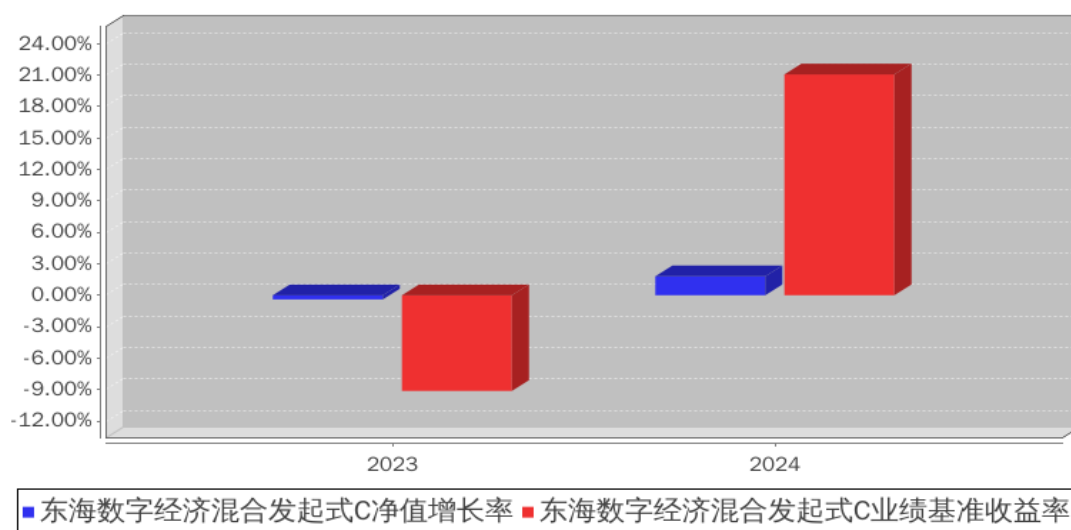


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东海数字经济混合发起式A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



东海数字经济混合发起式C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

本基金自生效日（2023年08月15日）至本报告期末成立不满三年且未发生利润分配。

§ 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，拥有公募基金管理、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，本基金管理人共管理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、东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金、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等 18 只公开募集证券投资基金。

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）	2023 年 8 月 15 日	—	9 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 日起担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的基金经理；2022 年 12 月 30 日起担任东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金的基金经理；2023 年 8 月 15 日起担任东海数字经济混合型发起式证券投资基金的基金经理；2024 年 8 月 21 日起担任东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。
王亦	本基金的	2023 年 8	—	6 年	国籍：中国。伦敦大学学院金融系统工程

琛	基金经理	月 22 日			硕士。曾担任普华永道商务咨询（上海）有限公司顾问、中银国际证券股份有限公司研究与交易部研究员。2022 年 1 月加入东海基金管理有限责任公司，担任研发策略部高级研究员职位，主要负责量化研究以及科技、传媒和通信等相关行业研究工作，2023 年 8 月调入基金投资部，现任权益投资部基金经理。2023 年 8 月 22 日起担任东海数字经济混合型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 8 月 12 日起担任东海科技动力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的基金经理。
---	------	--------	--	--	--

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

回首 2024 年，A 股市场在历经前三季度的起伏震荡后，迎来了令人振奋的反弹曙光。市场在人工智能的产业突破和宏观经济预期的向好下开启估值修复。在这一大背景下，数字经济领域仿若一艘破浪前行的巨轮，持续领航市场发展潮流，而人工智能作为这艘巨轮的核心引擎，迸发出前所未有的澎湃动力。

人工智能产业继续保持快速发展，政府政策的支持和投资的增加也为人工智能产业带来了发展机遇，是“新质生产力”中最重要的方向之一。

全球 AI 产业持续保持火热状态。在海外，ASIC 芯片的崛起对应了生成式 AI 的发展趋势从预训练堆参数正走向优化推理阶段；在国内，互联网大厂也正在紧锣密鼓的开始了新一轮 AI 的“军备竞赛”。ASIC 芯片具有高算力利用率、相对低的成本和低功耗的优势，是大模型推理的天然优选。

与此同时，AI 应用的加速也按下了“加速键”。海外的 AI+SaaS 应用开始为报表利润提供支持，而国内软硬件强耦合的生态下 AI 端侧也持续活跃，多款 AI 耳机、AI 眼镜、AI 手机等产品层

出不穷。随着 AI 技术全面进入临界点，算力基础设施有望得以进一步重构，推理算力的需求占比将可能水涨船高，而 AI 的使用成本则有望持续降低，从而推动 AI 应用全方位开花结果。

本报告期内，本基金配置方向集中于数字经济领域，并重点继续放在人工智能产业的加速发展上，同时考虑标的资产的业绩释放进程，本基金均衡配置了相关细分方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东海数字经济混合发起式 A 基金份额净值为 1.0203 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.29%；截至本报告期末，东海数字经济混合发起式 C 基金份额净值为 1.0140 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.81%；业绩比较基准收益率为 21.07%。

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 2025 年，中国 AI 产业会在互联网大厂的带动下进入真正的快车道，人工智能将深远且广泛的改变当前我国数字经济的应用范式，全方位提升全要素生产率。本基金将持续围绕“算力-应用-数据”的链路，挖掘科技创新所带来的投资机会，寻找具备持续创新能力的企业。

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）持续加强内控制度建设

报告期内，公司根据监管法规调整情况和业务开展实际情况，对公司制度进行持续评估与更新，确保制度的合规性、有效性和可操作性，进一步完善公司制度体系。

（二）强化新规学习和合规培训

公司持续密切关注法律法规、监管规范和行业自律规则变化，及时开展新规新政学习宣贯，并拟定落实方案，由相关部门及时落实。此外，公司多次组织面向新员工以及各业务条线的合规培训，持续宣导行业监管规范和自律要求，不断提升员工合规执业水平。

（三）系统梳理廉洁从业风险

本报告期内，公司系统梳理廉洁从业风险点，针对性制定风险控制策略，对于财经纪律、基金投资和销售等高危领域，以系统化手段和流程化管控方式加强廉洁从业管理，持续丰富公司廉洁从业管控手段。

（四）有效开展稽核审计

公司监察稽核部门针对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。此外公司还针

对员工投资、兼职、出国（境）、特定岗位人员移动通讯工具缴存等开展专项检查。通过稽核审计工作，督促各部门持续提升合规执业水平。

（五）严格开展合规考核评价

公司对全体员工开展合规考核评价，提升考核的导向作用。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）认真落实洗钱风险管控

公司认真学习新《反洗钱法》，积极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。公司还积极推动反洗钱管理系统采购升级，努力提升反洗钱管理效率，保障反洗钱监管要求有效落实。

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

本基金为发起式基金，截至本报告期末存续未满 3 年，故本报告期不存在需要说明的情况。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	容诚审字[2025]230Z1449 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	东海数字经济混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了东海数字经济混合型发起式证券投资基金（以下简称“东海数字经济混合型”）的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 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，公允反映了东海数字经济混合型 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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，我们独立于东海数字经济混合型，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	东海数字经济混合型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。 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	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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东海数字经济混合型的持续经营能力，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。 基金管理人治理层负责监督东海数字经济混合型的财务报告过程。
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。 （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，就可能导致对东海数字经济混合型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数字经济混合型不能持续经营。 （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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	汪玉寿	洪雁南
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2025年3月26日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东海数字经济混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,645,621.08	1,088,133.01
结算备付金		44,676.10	37,904.51
存出保证金		15,896.91	1,995.97
交易性金融资产	7.4.7.2	8,920,455.00	8,990,529.50
其中：股票投资		8,920,455.00	8,990,529.50
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		486,132.84	277,162.01
应收股利		-	-
应收申购款		28,010.88	1,998.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		11,140,792.81	10,397,723.50
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		-	37,892.31
应付赎回款		40,664.91	3.89
应付管理人报酬		11,524.12	10,212.12
应付托管费		1,920.67	1,702.00
应付销售服务费		283.03	37.91
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	35,730.70	93,217.94
负债合计		90,123.43	143,066.17
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	10,834,445.32	10,280,081.11
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	216,224.06	-25,423.78
净资产合计		11,050,669.38	10,254,657.33
负债和净资产总计		11,140,792.81	10,397,723.50

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，东海数字经济混合发起式 A 基金份额净值 1.0203 元，基金份额总额 10,170,179.61 份；东海数字经济混合发起式 C 基金份额净值 1.0140 元，基金份额总额 664,265.71 份；东海数字经济混合发起式分级总额合计为 10,834,445.32 份。

7.2 利润表

会计主体：东海数字经济混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		408,486.97	89,765.97
1. 利息收入		8,795.26	11,049.60
其中：存款利息收入	7.4.7.13	8,795.26	11,049.60
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-46,305.71	-364,132.12
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-144,669.27	-365,540.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-425.68	-
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	98,789.24	1,408.21
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	439,690.36	442,782.34
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	6,307.06	66.15
减：二、营业总支出		141,810.08	115,005.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	114,320.50	45,753.39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	19,053.41	7,625.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	816.17	166.71
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		-	-

8. 其他费用	7. 4. 7. 23	7, 620. 00	61, 460. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		266, 676. 89	-25, 239. 71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		266, 676. 89	-25, 239. 71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		266, 676. 89	-25, 239. 71

7.3 净资产变动表

会计主体：东海数字经济混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	10, 280, 081. 11	-	-25, 423. 78	10, 254, 657. 33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10, 280, 081. 11	-	-25, 423. 78	10, 254, 657. 33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	554, 364. 21	-	241, 647. 84	796, 012. 05
（一）、综合收益总额	-	-	266, 676. 89	266, 676. 89
（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）	554, 364. 21	-	-25, 029. 05	529, 335. 16
其中：1. 基金申购款	2, 873, 443. 30	-	-21, 385. 35	2, 852, 057. 95
2. 基金赎回款	-2, 319, 079. 09	-	-3, 643. 70	-2, 322, 722. 79
（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	10,834,445.32	-	216,224.06	11,050,669.38
项目	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,270,719.96	-	-	10,270,719.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,361.15	-	-25,423.78	-16,062.63
（一）、综合收益总额	-	-	-25,239.71	-25,239.71
（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）	9,361.15	-	-184.07	9,177.08
其中：1. 基金申购款	22,421.07	-	-540.22	21,880.85
2. 基金赎回款	-13,059.92	-	356.15	-12,703.77
（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	10,280,081.11	-	-25,423.78	10,254,657.33
-----------	---------------	---	------------	---------------

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：

严晓珺

宗华俊

黄河

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

东海数字经济混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2023]1316 号文《关于准予东海数字经济混合型发起式证券投资基金注册的批复》，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《东海数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》、《东海数字经济混合型发起式证券投资基金招募说明书》等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2023 年 8 月 15 日募集成立。本基金的基金管理人为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。基金合同生效日的基金份额总额为 10,270,719.96 份，有效认购户数为 71 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 1,082.65 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东海数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、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、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资（含存托凭证）占基金资产的比例范围为 60%-95%；投资于数字经济主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货

货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证数字经济主题指数收益率 $\times$ 75%+中债综合指数（全价）收益率 $\times$ 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 2024 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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业务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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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，本基金未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间，本基金未发生会计估计变更。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	1,645,621.08	1,088,133.01
等于：本金	1,645,364.55	1,087,528.37
加：应计利息	256.53	604.64
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	1,645,621.08	1,088,133.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,037,982.30	-	8,920,455.00	882,472.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,037,982.30	-	8,920,455.00	882,472.70
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,547,747.16	-	8,990,529.50	442,782.34
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	8,547,747.16	-	8,990,529.50	442,782.34

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.13	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	28,730.57	32,217.94
其中：交易所市场	28,730.57	32,217.94
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费用	7,000.00	16,000.00
预提信息披露费	-	45,000.00
合计	35,730.70	93,217.94

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东海数字经济混合发起式 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,165,161.15	10,165,161.15
本期申购	243,043.63	243,043.63
本期赎回（以“-”号填列）	-238,025.17	-238,025.17
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	10,170,179.61	10,170,179.61

东海数字经济混合发起式 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,919.96	114,919.96
本期申购	2,630,399.67	2,630,399.67
本期赎回（以“-”号填列）	-2,081,053.92	-2,081,053.92
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	664,265.71	664,265.71

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

东海数字经济混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-462,822.70	437,854.19	-24,968.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-462,822.70	437,854.19	-24,968.51
本期利润	-217,983.89	464,211.28	246,227.39
本期基金份额交易产生的变动数	-7,972.68	-6,363.77	-14,336.45
其中：基金申购款	-35,054.63	19,745.89	-15,308.74
基金赎回款	27,081.95	-26,109.66	972.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-688,779.27	895,701.70	206,922.43

东海数字经济混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,397.04	4,941.77	-455.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-5,397.04	4,941.77	-455.27
本期利润	44,970.42	-24,520.92	20,449.50
本期基金份额交易产生的变动数	-88,525.82	77,833.22	-10,692.60
其中：基金申购款	-288,352.00	282,275.39	-6,076.61
基金赎回款	199,826.18	-204,442.17	-4,615.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48,952.44	58,254.07	9,301.63

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,589.12	10,970.18
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	1,940.60	74.40
其他	265.54	5.02
合计	8,795.26	11,049.60

注：其他列示的是交易保证金利息收入及直销申购款利息收入。

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-144,669.27	-365,540.33
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	-144,669.27	-365,540.33

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	181,532,642.89	18,301,156.41
减：卖出股票成本总额	181,319,394.91	18,620,715.49
减：交易费用	357,917.25	45,981.25
买卖股票差价收入	-144,669.27	-365,540.33

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	109.32	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	-535.00	-

券到期兑付) 差价收入		
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	-425.68	-

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	402,478.08	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	400,875.00	-
减：应计利息总额	2,138.08	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-535.00	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	98,789.24	1,408.21
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	98,789.24	1,408.21

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	439,690.36	442,782.34
股票投资	439,690.36	442,782.34
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	439,690.36	442,782.34

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,307.06	66.15
合计	6,307.06	66.15

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	7,000.00	16,000.00
信息披露费	-	45,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	620.00	60.00
证券账户开户费	-	400.00
合计	7,620.00	61,460.00

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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
常州交通建设投资开发有限公司	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：（1）本报告期内，东海基金新增股东常州交通建设投资开发有限公司，于 2024 年 7 月 18 日完成工商变更登记；东海基金新增股东常州市城市建设（集团）有限公司，相应工商变更登记程序正在办理。

（2）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 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 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	269,913,591.08	74.49	45,469,619.06	100.00

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	196,191.87	80.43	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）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	33,915.03	100.00	32,217.94	100.00

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	114,320.50	45,753.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,939.11	464.66
应支付基金管理人的净管理费	112,381.39	45,288.73

注：支付基金管理人东海基金管理有限责任公司的基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,053.41	7,625.58

注：支付基金托管人兴业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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

东海数字经济混合发起式 A

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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（%）
东海证券股份有限公司	10,001,050.11	98.34	10,001,050.11	98.39

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 8 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 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
兴业银行	1,645,621.08	6,589.12	1,088,133.01	10,970.18

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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（2024 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 2024 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 2024 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 2024 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 2024 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 2024 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投资、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。本基金的货币资金存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无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公司的证券不得超过该证券 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可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、存出保证金等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的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 2024 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	1,645,621.08	-	-	-	-	-	1,645,621.08
结算备付金	44,676.10	-	-	-	-	-	44,676.10
存出保证金	15,896.91	-	-	-	-	-	15,896.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,920,455.00	8,920,455.00
应收申购款	-	-	-	-	-	28,010.88	28,010.88
应收清算款	-	-	-	-	-	486,132.84	486,132.84
资产总计	1,706,194.09	-	-	-	-	9,434,598.72	11,140,792.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,664.91	40,664.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,524.12	11,524.12
应付托管费	-	-	-	-	-	1,920.67	1,920.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	283.03	283.03
其他负债	-	-	-	-	-	35,730.70	35,730.70
负债总计	-	-	-	-	-	90,123.43	90,123.43
利率敏感度缺口	1,706,194.09	-	-	-	-	9,344,475.29	11,050,669.38
上年度末 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	1,088,133.01	-	-	-	-	-	1,088,133.01
结算备付金	37,904.51	-	-	-	-	-	37,904.51
存出保证金	1,995.97	-	-	-	-	-	1,995.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,990,529.50	8,990,529.50
应收申购款	-	-	-	-	-	1,998.50	1,998.50
应收清算款	-	-	-	-	-	277,162.01	277,162.01
资产总计	1,128,033.49	-	-	-	-	9,269,690.01	10,397,723.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3.89	3.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,212.12	10,212.12
应付托管费	-	-	-	-	-	1,702.00	1,702.00
应付清算款	-	-	-	-	-	37,892.31	37,892.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	37.91	37.91
其他负债	-	-	-	-	-	93,217.94	93,217.94

负债总计	-	-	-	-	-	143,066.17	143,066.17
利率敏感度缺口	1,128,033.49	-	-	-	-	-9,126,623.84	10,254,657.33

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，所面临的重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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	8,920,455.00	80.72	8,990,529.50	87.67
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	8,920,455.00	80.72	8,990,529.50	87.67

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 1%	92,397.30	21,596.54
	业绩比较基准减少 1%	-92,397.30	-21,596.54

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	8,920,455.00	8,990,529.50
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	8,920,455.00	8,990,529.50

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 2024 年 12 月 31 日，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况(2023 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 2024 年 12 月 31 日，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况(2023 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 2024 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(2023 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	8,920,455.00	80.07
	其中：股票	8,920,455.00	80.07
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	1,690,297.18	15.17
8	其他各项资产	530,040.63	4.76
9	合计	11,140,792.81	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	5,893,649.00	53.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,365,556.00	21.41
J	金融业	661,250.00	5.98
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	8,920,455.00	80.72

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通股票。

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	688256	寒武纪	1,200	789,600.00	7.15

2	300033	同花顺	2,300	661,250.00	5.98
3	601728	中国电信	90,000	649,800.00	5.88
4	688041	海光信息	3,900	584,181.00	5.29
5	002475	立讯精密	12,000	489,120.00	4.43
6	603893	瑞芯微	3,900	429,234.00	3.88
7	603986	兆易创新	4,000	427,200.00	3.87
8	603296	华勤技术	6,000	425,700.00	3.85
9	688111	金山办公	1,400	400,946.00	3.63
10	688608	恒玄科技	1,200	390,444.00	3.53
11	300866	安克创新	3,500	341,740.00	3.09
12	600563	法拉电子	2,800	332,976.00	3.01
13	688232	新点软件	11,000	318,890.00	2.89
14	600707	彩虹股份	38,000	312,360.00	2.83
15	000725	京东方 A	70,000	307,300.00	2.78
16	688385	复旦微电	8,000	307,120.00	2.78
17	300709	精研科技	7,500	301,275.00	2.73
18	688012	中微公司	1,400	264,824.00	2.40
19	002241	歌尔股份	10,000	258,100.00	2.34
20	605111	新洁能	7,000	237,370.00	2.15
21	002384	东山精密	5,000	146,000.00	1.32
22	002897	意华股份	3,500	144,725.00	1.31
23	002517	恺英网络	10,000	136,100.00	1.23
24	300433	蓝思科技	6,000	131,400.00	1.19
25	688259	创耀科技	2,000	70,220.00	0.64
26	688550	瑞联新材	2,000	62,580.00	0.57

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	300308	中际旭创	4,573,183.80	44.60
2	300502	新易盛	4,206,882.00	41.02
3	600941	中国移动	4,186,618.24	40.83
4	601728	中国电信	4,103,509.00	40.02
5	688256	寒武纪	3,529,124.61	34.41
6	688041	海光信息	3,513,785.52	34.27
7	300394	天孚通信	3,030,724.00	29.55
8	601138	工业富联	2,871,665.00	28.00
9	603501	韦尔股份	2,477,933.00	24.16
10	002475	立讯精密	2,184,429.44	21.30
11	300033	同花顺	2,137,515.00	20.84
12	600563	法拉电子	2,070,703.00	20.19
13	688608	恒玄科技	2,046,310.26	19.95

14	002241	歌尔股份	1,794,325.00	17.50
15	002027	分众传媒	1,786,100.00	17.42
16	002371	北方华创	1,741,909.00	16.99
17	605111	新洁能	1,607,147.44	15.67
18	002605	姚记科技	1,583,481.00	15.44
19	002517	恺英网络	1,577,129.00	15.38
20	600050	中国联通	1,564,311.00	15.25
21	688111	金山办公	1,526,985.04	14.89
22	688012	中微公司	1,502,633.77	14.65
23	002156	通富微电	1,452,108.00	14.16
24	300857	协创数据	1,351,632.00	13.18
25	300418	昆仑万维	1,349,903.00	13.16
26	601595	上海电影	1,342,980.00	13.10
27	600845	宝信软件	1,304,379.00	12.72
28	688981	中芯国际	1,266,772.69	12.35
29	002130	沃尔核材	1,231,510.00	12.01
30	600131	国网信通	1,228,516.00	11.98
31	002920	德赛西威	1,219,444.00	11.89
32	002415	海康威视	1,202,194.00	11.72
33	002463	沪电股份	1,199,663.39	11.70
34	300624	万兴科技	1,195,834.00	11.66
35	688270	臻镭科技	1,187,701.36	11.58
36	688036	传音控股	1,175,958.44	11.47
37	301391	卡莱特	1,144,958.00	11.17
38	002230	科大讯飞	1,098,049.74	10.71
39	002916	深南电路	1,096,480.00	10.69
40	301162	国能日新	1,085,282.00	10.58
41	300476	胜宏科技	1,030,930.00	10.05
42	300280	紫天科技	1,028,069.00	10.03
43	603019	中科曙光	1,014,649.00	9.89
44	603296	华勤技术	999,788.00	9.75
45	301153	中科江南	938,444.00	9.15
46	688418	震有科技	929,736.10	9.07
47	600707	彩虹股份	913,549.00	8.91
48	300136	信维通信	905,102.00	8.83
49	002897	意华股份	878,379.00	8.57
50	300803	指南针	875,214.00	8.53
51	688322	奥比中光	873,936.14	8.52
52	301308	江波龙	865,504.00	8.44
53	605117	德业股份	862,817.00	8.41
54	300133	华策影视	841,966.00	8.21
55	002384	东山精密	834,585.00	8.14
56	600536	中国软件	823,022.00	8.03

57	688279	峰岹科技	821,652.92	8.01
58	000100	TCL 科技	815,920.00	7.96
59	002484	江海股份	814,050.00	7.94
60	002938	鹏鼎控股	810,306.00	7.90
61	000977	浪潮信息	795,880.00	7.76
62	301285	鸿日达	789,712.00	7.70
63	688188	柏楚电子	779,811.96	7.60
64	301269	华大九天	768,375.00	7.49
65	002273	水晶光电	753,233.00	7.35
66	688590	新致软件	735,417.94	7.17
67	688037	芯源微	734,410.00	7.16
68	002947	恒铭达	723,574.00	7.06
69	300782	卓胜微	722,609.00	7.05
70	300364	中文在线	700,636.00	6.83
71	688047	龙芯中科	697,009.77	6.80
72	301031	中熔电气	692,547.00	6.75
73	603000	人民网	663,634.00	6.47
74	688183	生益电子	658,473.84	6.42
75	301236	软通动力	655,563.00	6.39
76	688118	普元信息	654,541.27	6.38
77	688095	福昕软件	637,313.94	6.21
78	001309	德明利	631,992.00	6.16
79	002635	安洁科技	619,676.00	6.04
80	300563	神宇股份	618,976.00	6.04
81	000725	京东方 A	605,850.00	5.91
82	300433	蓝思科技	605,636.00	5.91
83	688385	复旦微电	594,810.77	5.80
84	601689	拓普集团	588,372.00	5.74
85	688088	虹软科技	584,729.02	5.70
86	300793	佳禾智能	570,129.00	5.56
87	600522	中天科技	570,069.00	5.56
88	300373	扬杰科技	569,796.00	5.56
89	300628	亿联网络	568,215.00	5.54
90	603920	世运电路	566,295.00	5.52
91	300866	安克创新	563,324.70	5.49
92	603986	兆易创新	561,695.00	5.48
93	688475	萤石网络	554,863.12	5.41
94	600487	亨通光电	547,082.00	5.33
95	601019	山东出版	542,857.00	5.29
96	300709	精研科技	538,550.00	5.25
97	301095	广立微	530,558.00	5.17
98	300552	万集科技	520,809.00	5.08
99	301195	北路智控	517,885.00	5.05

100	688777	中控技术	517,745.00	5.05
101	688521	芯原股份	515,472.19	5.03
102	300442	润泽科技	514,752.00	5.02
103	600373	中文传媒	514,605.00	5.02
104	002456	欧菲光	511,538.00	4.99
105	002869	金溢科技	509,363.00	4.97
106	688100	威胜信息	494,264.59	4.82
107	300843	胜蓝股份	482,458.00	4.70
108	300031	宝通科技	480,444.00	4.69
109	300762	上海瀚讯	471,943.00	4.60
110	600602	云赛智联	469,033.80	4.57
111	300494	盛天网络	462,860.00	4.51
112	603893	瑞芯微	462,733.00	4.51
113	688213	思特威	460,158.13	4.49
114	300735	光弘科技	449,622.00	4.38
115	688260	昀冢科技	447,324.81	4.36
116	688595	芯海科技	446,128.46	4.35
117	601928	凤凰传媒	442,449.00	4.31
118	601900	南方传媒	439,800.00	4.29
119	688629	华丰科技	433,115.24	4.22
120	001270	铖昌科技	420,116.00	4.10
121	300790	宇瞳光学	417,503.00	4.07
122	300781	因赛集团	417,414.00	4.07
123	301589	诺瓦星云	416,075.00	4.06
124	688318	财富趋势	411,420.00	4.01
125	300661	圣邦股份	410,197.00	4.00
126	601231	环旭电子	406,141.00	3.96
127	300017	网宿科技	406,130.00	3.96
128	600757	长江传媒	399,879.00	3.90
129	603108	润达医疗	397,572.00	3.88
130	002152	广电运通	394,750.00	3.85
131	688498	源杰科技	393,207.29	3.83
132	603160	汇顶科技	388,950.00	3.79
133	002922	伊戈尔	377,738.00	3.68
134	603890	春秋电子	377,597.00	3.68
135	300570	太辰光	377,462.00	3.68
136	300002	神州泰岳	376,747.00	3.67
137	688391	钜泉科技	374,561.84	3.65
138	301280	珠城科技	370,442.00	3.61
139	601801	皖新传媒	367,775.00	3.59
140	300750	宁德时代	367,296.00	3.58
141	601098	中南传媒	364,779.00	3.56
142	688248	南网科技	364,707.96	3.56

143	688120	华海清科	361,372.00	3.52
144	000625	长安汽车	352,375.00	3.44
145	002955	鸿合科技	351,365.00	3.43
146	301052	果麦文化	351,103.00	3.42
147	600183	生益科技	346,290.00	3.38
148	688031	星环科技	343,231.57	3.35
149	300525	博思软件	342,029.00	3.34
150	603327	福蓉科技	338,109.00	3.30
151	300698	万马科技	334,622.00	3.26
152	002322	理工能科	334,351.00	3.26
153	688232	新点软件	331,650.54	3.23
154	688668	鼎通科技	331,014.40	3.23
155	603516	淳中科技	329,639.00	3.21
156	688259	创耀科技	319,670.88	3.12
157	002600	领益智造	319,380.00	3.11
158	688072	拓荆科技	318,355.60	3.10
159	688123	聚辰股份	315,735.00	3.08
160	000034	神州数码	313,475.00	3.06
161	601811	新华文轩	309,324.00	3.02
162	300820	英杰电气	308,269.00	3.01
163	002446	盛路通信	298,720.00	2.91
164	300059	东方财富	298,656.00	2.91
165	603236	移远通信	297,385.00	2.90
166	300475	香农芯创	296,839.00	2.89
167	300738	奥飞数据	295,713.00	2.88
168	002436	兴森科技	294,771.00	2.87
169	001330	博纳影业	292,179.00	2.85
170	003019	宸展光电	291,840.00	2.85
171	688800	瑞可达	290,797.00	2.84
172	688153	唯捷创芯	290,109.00	2.83
173	603721	中广天择	287,894.00	2.81
174	301180	万祥科技	286,473.00	2.79
175	688150	莱特光电	285,133.66	2.78
176	688507	索辰科技	279,630.60	2.73
177	688052	纳芯微	278,126.00	2.71
178	603228	景旺电子	277,691.00	2.71
179	000063	中兴通讯	276,194.00	2.69
180	002056	横店东磁	275,303.00	2.68
181	688083	中望软件	275,128.00	2.68
182	605296	神农集团	270,585.00	2.64
183	300620	光库科技	265,993.00	2.59
184	600584	长电科技	264,070.00	2.58
185	688766	普冉股份	264,056.22	2.57

186	300212	易华录	262,806.00	2.56
187	002050	三花智控	260,760.00	2.54
188	300251	光线传媒	259,546.00	2.53
189	688589	力合微	258,474.24	2.52
190	000938	紫光股份	257,068.00	2.51
191	300339	润和软件	257,040.00	2.51
192	000503	国新健康	256,610.00	2.50
193	688568	中科星图	254,776.13	2.48
194	600118	中国卫星	251,803.00	2.46
195	688503	聚和材料	251,780.00	2.46
196	300975	商络电子	251,735.00	2.45
197	600827	百联股份	249,500.00	2.43
198	605277	新亚电子	244,720.60	2.39
199	002049	紫光国微	243,226.00	2.37
200	002236	大华股份	242,938.00	2.37
201	300165	ST 天瑞	240,650.00	2.35
202	002555	三七互娱	240,640.00	2.35
203	601921	浙版传媒	239,495.00	2.34
204	300663	科蓝软件	238,850.00	2.33
205	002153	石基信息	238,050.00	2.32
206	688066	航天宏图	237,133.66	2.31
207	688525	佰维存储	233,562.00	2.28
208	300590	移为通信	232,700.00	2.27
209	300991	创益通	232,172.00	2.26
210	300548	博创科技	230,860.00	2.25
211	300226	上海钢联	230,663.00	2.25
212	002292	奥飞娱乐	229,004.00	2.23
213	002465	海格通信	227,756.00	2.22
214	603444	吉比特	226,987.00	2.21
215	688209	英集芯	225,744.82	2.20
216	688187	时代电气	225,220.00	2.20
217	603688	石英股份	223,479.00	2.18
218	688018	乐鑫科技	219,987.99	2.15
219	002859	洁美科技	219,811.00	2.14
220	300115	长盈精密	215,180.00	2.10
221	600633	浙数文化	209,124.00	2.04
222	000628	高新发展	207,885.00	2.03
223	300454	深信服	205,475.00	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	300308	中际旭创	4,810,730.20	46.91
2	300502	新易盛	4,328,956.65	42.21
3	600941	中国移动	4,161,442.00	40.58
4	601728	中国电信	3,468,370.00	33.82
5	688256	寒武纪	3,379,080.86	32.95
6	688041	海光信息	3,129,745.48	30.52
7	601138	工业富联	3,082,478.00	30.06
8	300394	天孚通信	3,066,470.00	29.90
9	603501	韦尔股份	2,390,185.00	23.31
10	002475	立讯精密	2,368,316.00	23.10
11	688608	恒玄科技	1,854,700.92	18.09
12	002027	分众传媒	1,782,650.00	17.38
13	600563	法拉电子	1,782,202.00	17.38
14	600845	宝信软件	1,781,355.00	17.37
15	002371	北方华创	1,712,468.00	16.70
16	300033	同花顺	1,707,893.00	16.65
17	002241	歌尔股份	1,684,327.00	16.42
18	002605	姚记科技	1,671,611.00	16.30
19	300857	协创数据	1,657,550.00	16.16
20	600050	中国联通	1,602,550.00	15.63
21	688111	金山办公	1,557,879.50	15.19
22	002517	恺英网络	1,446,981.00	14.11
23	002156	通富微电	1,431,688.00	13.96
24	688270	臻镭科技	1,410,840.78	13.76
25	605111	新洁能	1,362,643.00	13.29
26	300418	昆仑万维	1,350,766.00	13.17
27	002463	沪电股份	1,295,977.00	12.64
28	688981	中芯国际	1,294,218.37	12.62
29	601595	上海电影	1,272,867.00	12.41
30	002130	沃尔核材	1,272,803.00	12.41
31	002415	海康威视	1,262,129.00	12.31
32	688036	传音控股	1,192,600.31	11.63
33	002920	德赛西威	1,189,021.80	11.59
34	600131	国网信通	1,181,195.00	11.52
35	688012	中微公司	1,178,741.98	11.49
36	300136	信维通信	1,174,643.00	11.45
37	002230	科大讯飞	1,169,599.00	11.41
38	688418	震有科技	1,160,336.06	11.32
39	301162	国能日新	1,160,025.00	11.31
40	300624	万兴科技	1,134,302.00	11.06
41	002916	深南电路	1,130,687.00	11.03
42	301391	卡莱特	1,130,438.00	11.02
43	688322	奥比中光	1,090,904.74	10.64

44	603019	中科曙光	1,062,375.00	10.36
45	300280	紫天科技	1,045,658.00	10.20
46	300476	胜宏科技	1,042,607.81	10.17
47	301153	中科江南	998,284.00	9.73
48	301269	华大九天	945,879.00	9.22
49	600536	中国软件	900,888.00	8.79
50	002897	意华股份	897,287.00	8.75
51	000100	TCL 科技	889,177.00	8.67
52	605117	德业股份	851,885.00	8.31
53	301236	软通动力	851,845.56	8.31
54	002938	鹏鼎控股	833,119.00	8.12
55	300803	指南针	828,764.00	8.08
56	301308	江波龙	824,140.00	8.04
57	002484	江海股份	815,053.00	7.95
58	300782	卓胜微	804,241.00	7.84
59	688279	峰昭科技	801,326.00	7.81
60	688183	生益电子	796,878.78	7.77
61	300133	华策影视	796,683.00	7.77
62	002273	水晶光电	794,746.00	7.75
63	000977	浪潮信息	770,351.00	7.51
64	688188	柏楚电子	767,786.75	7.49
65	300563	神宇股份	742,424.00	7.24
66	301285	鸿日达	719,905.00	7.02
67	688590	新致软件	714,059.67	6.96
68	300793	佳禾智能	710,621.00	6.93
69	688037	芯源微	693,182.23	6.76
70	002384	东山精密	689,727.00	6.73
71	300661	圣邦股份	684,401.00	6.67
72	002947	恒铭达	667,971.00	6.51
73	301031	中熔电气	665,439.00	6.49
74	300364	中文在线	660,157.00	6.44
75	688047	龙芯中科	656,371.54	6.40
76	688118	普元信息	648,503.65	6.32
77	300628	亿联网络	638,060.00	6.22
78	603296	华勤技术	634,382.80	6.19
79	300552	万集科技	626,751.00	6.11
80	603000	人民网	624,847.00	6.09
81	688475	萤石网络	610,642.46	5.95
82	001309	德明利	605,823.00	5.91
83	601689	拓普集团	599,865.00	5.85
84	002635	安洁科技	597,267.00	5.82
85	688095	福昕软件	583,282.76	5.69
86	688777	中控技术	579,320.19	5.65

87	600707	彩虹股份	578,544.00	5.64
88	688088	虹软科技	573,418.03	5.59
89	603920	世运电路	568,107.00	5.54
90	300433	蓝思科技	557,474.00	5.44
91	300373	扬杰科技	546,333.00	5.33
92	688209	英集芯	543,784.79	5.30
93	600522	中天科技	536,514.00	5.23
94	601019	山东出版	529,953.00	5.17
95	301095	广立微	525,609.00	5.13
96	301195	北路智控	525,263.00	5.12
97	600487	亨通光电	521,797.00	5.09
98	002869	金溢科技	519,517.00	5.07
99	688498	源杰科技	512,300.08	5.00
100	002446	盛路通信	509,620.00	4.97
101	300115	长盈精密	502,419.67	4.90
102	600373	中文传媒	499,151.00	4.87
103	688521	芯原股份	488,015.88	4.76
104	688100	威胜信息	486,218.81	4.74
105	002456	欧菲光	483,464.00	4.71
106	688031	星环科技	481,323.60	4.69
107	688052	纳芯微	476,396.00	4.65
108	300442	润泽科技	476,177.00	4.64
109	300494	盛天网络	471,957.00	4.60
110	600602	云赛智联	470,932.00	4.59
111	688260	昀冢科技	467,333.93	4.56
112	300031	宝通科技	461,815.00	4.50
113	300762	上海瀚讯	458,266.00	4.47
114	002465	海格通信	454,956.00	4.44
115	688629	华丰科技	435,973.24	4.25
116	688213	思特威	432,582.73	4.22
117	601900	南方传媒	429,857.00	4.19
118	001270	铖昌科技	428,205.00	4.18
119	601928	凤凰传媒	424,759.00	4.14
120	300017	网宿科技	420,674.00	4.10
121	300843	胜蓝股份	420,002.00	4.10
122	300735	光弘科技	417,855.00	4.07
123	688595	芯海科技	414,884.21	4.05
124	603108	润达医疗	413,140.00	4.03
125	301589	诺瓦星云	404,049.00	3.94
126	002922	伊戈尔	403,423.00	3.93
127	300781	因赛集团	396,175.00	3.86
128	603160	汇顶科技	394,802.00	3.85
129	002600	领益智造	391,025.00	3.81

130	300790	宇瞳光学	390,896.00	3.81
131	688391	钜泉科技	384,075.00	3.75
132	300002	神州泰岳	382,640.00	3.73
133	601231	环旭电子	381,757.00	3.72
134	600757	长江传媒	379,940.00	3.71
135	688248	南网科技	379,900.74	3.70
136	000625	长安汽车	379,240.00	3.70
137	002152	广电运通	368,690.00	3.60
138	300750	宁德时代	368,485.00	3.59
139	300570	太辰光	367,974.00	3.59
140	601801	皖新传媒	365,850.00	3.57
141	603890	春秋电子	362,202.00	3.53
142	301280	珠城科技	359,676.00	3.51
143	688668	鼎通科技	357,971.63	3.49
144	601098	中南传媒	357,614.00	3.49
145	688318	财富趋势	357,535.65	3.49
146	688120	华海清科	357,519.29	3.49
147	002955	鸿合科技	356,524.00	3.48
148	300339	润和软件	354,057.00	3.45
149	300698	万马科技	342,396.00	3.34
150	301052	果麦文化	342,375.00	3.34
151	002322	理工能科	341,362.00	3.33
152	000725	京东方 A	341,200.00	3.33
153	600183	生益科技	338,273.00	3.30
154	688800	瑞可达	332,632.50	3.24
155	300366	创意信息	325,160.00	3.17
156	001330	博纳影业	324,161.00	3.16
157	688123	聚辰股份	323,836.25	3.16
158	300525	博思软件	321,518.00	3.14
159	603516	淳中科技	320,012.00	3.12
160	603327	福蓉科技	318,108.00	3.10
161	300820	英杰电气	310,715.00	3.03
162	000034	神州数码	309,262.00	3.02
163	002739	万达电影	307,851.00	3.00
164	688072	拓荆科技	303,319.19	2.96
165	300866	安克创新	301,776.70	2.94
166	301180	万祥科技	300,520.00	2.93
167	002436	兴森科技	292,250.00	2.85
168	300738	奥飞数据	287,999.00	2.81
169	601811	新华文轩	287,290.00	2.80
170	688507	索辰科技	285,749.92	2.79
171	003019	宸展光电	285,446.00	2.78
172	600584	长电科技	280,610.00	2.74

173	688153	唯捷创芯	279,746.09	2.73
174	300251	光线传媒	277,600.00	2.71
175	603228	景旺电子	275,258.00	2.68
176	300059	东方财富	274,100.00	2.67
177	002050	三花智控	274,050.00	2.67
178	688083	中望软件	273,953.61	2.67
179	300475	香农芯创	273,497.00	2.67
180	002056	横店东磁	272,003.00	2.65
181	688150	莱特光电	270,694.00	2.64
182	000503	国新健康	269,141.00	2.62
183	301360	荣旗科技	269,116.00	2.62
184	603236	移远通信	268,110.00	2.61
185	603721	中广天择	267,502.00	2.61
186	000810	创维数字	266,220.00	2.60
187	688766	普冉股份	264,543.81	2.58
188	605296	神农集团	262,327.00	2.56
189	688259	创耀科技	261,036.00	2.55
190	000063	中兴通讯	260,798.00	2.54
191	002049	紫光国微	260,139.00	2.54
192	300620	光库科技	259,702.00	2.53
193	600118	中国卫星	256,830.00	2.50
194	688066	航天宏图	254,046.53	2.48
195	688568	中科星图	251,363.21	2.45
196	688589	力合微	246,233.00	2.40
197	000938	紫光股份	245,625.00	2.40
198	300975	商络电子	245,234.00	2.39
199	688503	聚和材料	243,060.00	2.37
200	600775	南京熊猫	242,000.00	2.36
201	002236	大华股份	238,840.00	2.33
202	002555	三七互娱	238,077.00	2.32
203	688636	智明达	237,737.04	2.32
204	688018	乐鑫科技	236,304.27	2.30
205	002292	奥飞娱乐	235,443.00	2.30
206	605277	新亚电子	235,350.00	2.30
207	688385	复旦微电	234,969.75	2.29
208	600827	百联股份	234,415.00	2.29
209	688525	佰维存储	232,491.00	2.27
210	601921	浙版传媒	231,355.00	2.26
211	300226	上海钢联	229,260.00	2.24
212	300548	博创科技	228,728.18	2.23
213	002153	石基信息	227,400.00	2.22
214	300212	易华录	227,361.00	2.22
215	300663	科蓝软件	227,000.00	2.21

216	300991	创益通	222,780.00	2.17
217	300590	移为通信	220,947.00	2.15
218	300709	精研科技	219,942.00	2.14
219	603444	吉比特	219,817.00	2.14
220	688187	时代电气	216,967.55	2.12
221	603688	石英股份	216,854.00	2.11
222	300165	ST 天瑞	214,040.00	2.09
223	002859	洁美科技	210,871.00	2.06
224	300976	达瑞电子	210,480.00	2.05
225	600633	浙数文化	207,939.00	2.03

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	180,809,630.05
卖出股票收入（成交）总额	181,532,642.89

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	15,896.91
2	应收清算款	486,132.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,010.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	530,040.63

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
东海数字经济混合	136	74,780.73	10,001,050.11	98.34	169,129.50	1.66

发起式 A						
东海数字经济混合发起式 C	516	1,287.34	0.00	0.00	664,265.71	100.00
合计	652	16,617.25	10,001,050.11	92.31	833,395.21	7.69

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	东海数字经济混合发起式 A	18,273.98	0.1797
	东海数字经济混合发起式 C	310.01	0.0467
	合计	18,583.99	0.1715

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	东海数字经济混合发起式 A	0~10
	东海数字经济混合发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东海数字经济混合发起式 A	0~10
	东海数字经济混合发起式 C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,001,050.11	92.31	10,001,050.11	92.31	不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,050.11	92.31	10,001,050.11	92.31	不少于 3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东海数字经济混合发起式 A	东海数字经济混合发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 8 月 15 日)	10,159,084.11	111,635.85
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	10,165,161.15	114,919.96
本报告期基金总申购份额	243,043.63	2,630,399.67
减：本报告期基金总赎回份额	238,025.17	2,081,053.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,170,179.61	664,265.71

§ 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 2024 年 6 月 22 日发布公告，自 2024 年 6 月 21 日起，周华成先生因退休不再担任公司副总经理、首席信息官、财务负责人，公司首席信息官、财务负责人由公司现任其他高级管理人员兼任。
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

经东海基金管理有限责任公司董事会审议通过，本基金于 2024 年 09 月 09 日将为其审计的会计师事务所由天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）更换为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

本基金本年度应支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的基金审计费用为 0.7 万元，其已提供审计服务的连续年限为 1 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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未因本基金受到监管部门的稽查或处罚。

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	269,913,591.08	74.49	196,191.87	80.43	-
国海证券	2	86,212,562.61	23.79	44,830.90	18.38	-
广发证券	1	6,216,119.25	1.72	2,896.04	1.19	-

注：1、本报告期内本基金增加交易单元的证券公司为国海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商。证券经纪商的选择标准如下：

- （1）证券公司财务状况良好、经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- （2）证券公司具有较强的研究能力，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；
- （3）证券公司承诺研究服务不包含内幕信息；

(4) 证券公司具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足代理各投资组合进行证券交易的需
要；

(5) 合作证券公司收取的佣金费率符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等
相关规定。

3、基金选择证券公司交易单元的程序如下：

本基金管理人根据上述券商选择标准并结合对券商研究服务工作的评分结果，确定合作券商
以及交易席位的租用、调整分配、退租等管理工作，经公司督察长、总经理审批后与被选择的券
商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致。本公司将按规定在网站披露《东海基
金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》，报告期
为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

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	-	-	-	-	-	-
国海证 券	801,215.00	100.00	-	-	-	-
广发证 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	东海数字经济混合型发起式证券投资 基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及 网站	2024 年 1 月 20 日
2	东海基金管理有限责任公司关于旗下 部分基金新增宜信普泽（北京）基金 销售有限公司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	2024 年 1 月 26 日
3	东海基金管理有限责任公司关于旗下 部分基金新增兴业银行股份有限公司 银银平台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	2024 年 3 月 12 日
4	东海数字经济混合型发起式证券投资	中国证监会指定报刊及	2024 年 3 月 29 日

	基金 2023 年年度报告	网站	
5	东海基金管理有限责任公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 30 日
6	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司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	2024 年 4 月 17 日
7	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 20 日
8	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增北京雪球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	2024 年 5 月 22 日
9	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司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	2024 年 6 月 4 日
10	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 12 日
11	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任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	2024 年 6 月 19 日
12	东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 22 日
13	东海数字经济混合型发起式证券投资基金招募说明书更新(2024 年第 1 号)	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 28 日
14	东海数字经济混合型发起式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	2024 年 6 月 28 日
15	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增江苏天鼎证券投资咨询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	2024 年 07 月 04 日
16	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 07 月 19 日
17	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增泰信财富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	2024 年 08 月 02 日
18	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务、转换业	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 08 月 20 日

	务及参加费率优惠的公告		
19	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 08 月 30 日
20	东海基金管理有限责任公司基金改聘会计师事务所公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 09 月 10 日
21	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 24 日
22	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术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	2024 年 10 月 30 日
23	关于提示投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 06 日
24	关于关闭网上直销交易平台相关业务服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 20 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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(%)
机构	1	2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 12 月 31 日	10,001,050.11	0.00	0.00	10,001,050.11	92.31
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，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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数字经济混合型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《东海数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《东海数字经济混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《东海数字经济混合型发起式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

2025 年 3 月 29 日