

东海核心价值精选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	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	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	投资组合报告附注	46
§ 8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§ 9	开放式基金份额变动	48
§ 10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12	备查文件目录	51
12.1	备查文件目录	51
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东海核心价值精选混合型证券投资基金
基金简称	东海核心价值
基金主代码	006538
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 23 日
基金管理人	东海基金管理有限责任公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,305,729.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>本基金强调自上而下的研究策略，根据各行业所处生命周期、行业竞争结构、行业景气度变动趋势等因素，对各行业的相对投资价值进行综合分析，挑选具有优势的行业和景气度趋于上行的行业进行重点布局投资，并通过行业内优势比较精选具有核心竞争力的企业作为优先配置对象。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金运用价值投资理念，按照经营质量、竞争优势评价和价值评估的股票选择流程，投资于经营稳健、具有核心竞争优势、价值被低估的大中型上市公司股票。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用放大操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。</p> <p>本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较</p>

	<p>差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p> <p>5、股指期货等投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>7、流通受限证券投资策略</p> <p>本基金可投资流通受限证券，即本基金可参与上市公司非公开发行股票的投资。从战略投资的角度评估参与增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的增发项目。</p> <p>随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东海基金管理有限责任公司	江苏银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	牛锐	田作全
	联系电话	021-60586900	025-58588321
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		400-9595531	95319
传真		021-60586926	025-58588155
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	南京市中华路 26 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼	南京市中华路 26 号
邮政编码		200122	210001
法定代表人		严晓珺	葛仁余

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东海基金管理有限责任公司	上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,162,379.46
本期利润	-1,157,563.41
加权平均基金份额本期利润	-0.2060
本期加权平均净值利润率	-17.85%
本期基金份额净值增长率	-14.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	746,585.98
期末可供分配基金份额利润	0.1407
期末基金资产净值	6,052,315.78
期末基金份额净值	1.1407
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.07%

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

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

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

(4) 本基金合同生效日为 2018 年 11 月 23 日。

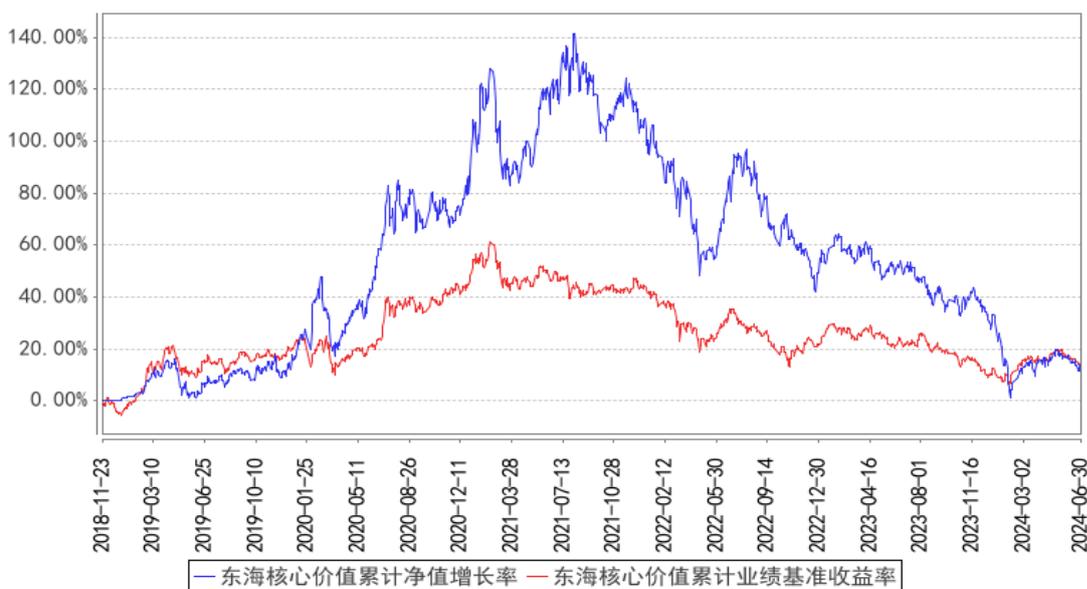
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.13%	1.00%	-2.32%	0.36%	0.19%	0.64%
过去三个月	0.09%	1.08%	-1.11%	0.56%	1.20%	0.52%
过去六个月	-14.26%	1.30%	1.74%	0.67%	-	0.63%
过去一年	-24.97%	1.15%	-6.09%	0.65%	-	0.50%
过去三年	-48.91%	1.42%	-23.43%	0.78%	-	0.64%
自基金合同生效起至今	14.07%	1.47%	14.33%	0.89%	-0.26%	0.58%

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

东海核心价值累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 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，注册资本 16480.3118 万元人民币，是中国证监会批准设立的第 78 家公募基金管理公司。公司第一大股东为东海证券股份有限公司，其他主要股东包括深圳鹏博实业集团有限公司和苏州市相城区江南化纤集团有限公司。

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

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金、东海祥瑞债券型证券投资基金、东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东海核心价值精选混合型证券投资基金、东海祥利纯债债券型证券投资基金、东海科技动力混合型证券投资基金、东海祥苏短债债券型证券投资基金、东海祥泰三年定期开放债券型发起式证券投资基金、东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金和东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金、东海鑫宁利率债三个月定期开放债券型证券投资基金、东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东海数字经济混合型发起式证券投资基金、东海消费臻选混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

					理。
邵炜	本基金的基金经理、公募投资总监、资产配置部总经理	2022年9月8日	-	12年	国籍：中国。政治经济学硕士，曾任职于德邦证券资产管理有限公司资产管理总部，先后担任债券交易员、交易主管、投资经理、投资部副总经理、总经理助理、董事总经理等职务。2020年7月加入东海基金，现任公司公募投资总监、资产配置部总经理、基金经理。2022年9月6日起担任东海启航6个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2022年9月8日起担任东海核心价值精选混合型证券投资基金基金经理。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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 公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。公司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

2024 年上半年，市场维持震荡走势，整体板块轮动仍然较快，投资主线经历了从涨价链到设备更新、地产链、红利资产再到科特估和苹果链的递进。风格上低估价值占优，成长股则更多表现为波段交易。

本报告期内，本基金继续围绕复苏线索在周期成长行业内配置。上半年经济呈现出“量升价跌”的复苏形态，信贷及地产数据的波动加剧了市场对于复苏的担忧。从上市公司报表数据来看，收入的拐点需要国内需求的进一步明确。从细分方向来说，在大规模设备更新的政策下，同时受益于国内及海外补库的行业表现较优。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值为 1.1407 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.26%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济仍处于新旧动能的转换期，从很多细分行业面临的周期看，已经处于触底反弹的趋势中。优秀的上市公司面临困境的情况下，积极平衡国内和海外的业务占比，国内这批优秀的企业在海外拥有很强的竞争优势。在微观企业上，我们看到了复苏力量的不断积聚，

宏观上的“顺势”和“逆势”最终影响的只是斜率。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。本基金资产净值于 2024 年 1 月 2 日至报告期末均低于 5000 万元，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的东海核心价值精选混合型证券投资基金半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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东海核心价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	754,750.02	1,204,113.82
结算备付金		-	8,176.73
存出保证金		-	36,724.20
交易性金融资产	6.4.7.2	5,312,405.00	6,916,906.00
其中：股票投资		5,312,405.00	6,916,906.00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		119.83	529.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,067,274.85	8,166,449.96
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	9.44
应付管理人报酬		6,001.74	8,375.87
应付托管费		1,000.29	1,395.98
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	6.4.7.9	7,957.04	34,793.28
负债合计		14,959.07	44,574.57
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	5,305,729.80	6,104,886.11
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	746,585.98	2,016,989.28
净资产合计		6,052,315.78	8,121,875.39
负债和净资产总计		6,067,274.85	8,166,449.96

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1407 元，基金份额总额 5,305,729.80 份。

6.2 利润表

会计主体：东海核心价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,104,469.09	542,878.63
1. 利息收入		1,472.95	3,987.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,472.95	3,987.03
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）		-1,110,979.72	-218,629.66

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,140,429.72	-248,994.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	29,450.00	30,365.00
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)	6.4.7.20	4,816.05	735,753.61
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	6.4.7.21	221.63	21,767.65
减：二、营业总支出		53,094.32	76,338.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,689.07	60,355.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,448.21	8,047.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	7,957.04	7,935.04
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		-1,157,563.41	466,540.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		-1,157,563.41	466,540.28
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,157,563.41	466,540.28

6.3 净资产变动表

会计主体：东海核心价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	6,104,886.11	-	2,016,989.28	8,121,875.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,104,886.11	-	2,016,989.28	8,121,875.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-799,156.31	-	-1,270,403.30	-2,069,559.61
(一)、综合收益总额	-	-	-1,157,563.41	-1,157,563.41
(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)	-799,156.31	-	-112,839.89	-911,996.20
其中：1. 基金申购款	73,276.85	-	9,829.17	83,106.02
2. 基金赎回款	-872,433.16	-	-122,669.06	-995,102.22
(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	5,305,729.80	-	746,585.98	6,052,315.78
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,846,518.13	-	3,864,691.57	11,711,209.70
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,846,518.13	-	3,864,691.57	11,711,209.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,250,334.48	-	-431,905.32	-1,682,239.80
(一)、综合收益总额	-	-	466,540.28	466,540.28
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,250,334.48	-	-898,445.60	-2,148,780.08
其中：1. 基金申购款	2,835,372.74	-	1,434,115.37	4,269,488.11
2. 基金赎回款	-4,085,707.22	-	-2,332,560.97	-6,418,268.19
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,596,183.65	-	3,432,786.25	10,028,969.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东海核心价值精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1566 号文《关于准予东海核心价值精选混合型证券

投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人东海基金管理有限责任公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2018 年 11 月 23 日正式生效。首次设立募集规模为 271,630,618.22 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及注册登记机构均为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年中期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的 2024 年 06 月 30 日财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期间，本基金无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间，本基金无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	66,170.76
等于：本金	66,159.42
加：应计利息	11.34
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	688,579.26
等于：本金	688,519.73
加：应计利息	59.53
减：坏账准备	-
合计	754,750.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,433,632.53	-	5,312,405.00	-121,227.53
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		5,433,632.53	-	5,312,405.00	-121,227.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末，本基金未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末，本基金未持有任何黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期末，本基金无债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期末，本基金无其他债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金均未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费用	7,957.04
合计	7,957.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,104,886.11	6,104,886.11
本期申购	73,276.85	73,276.85
本期赎回（以“-”号填列）	-872,433.16	-872,433.16
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	5,305,729.80	5,305,729.80

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,212,568.91	-2,195,579.63	2,016,989.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差	-	-	-

错更正			
其他	-	-	-
本期期初	4,212,568.91	-2,195,579.63	2,016,989.28
本期利润	-1,162,379.46	4,816.05	-1,157,563.41
本期基金份额交易产生的变动数	-399,422.88	286,582.99	-112,839.89
其中：基金申购款	40,248.57	-30,419.40	9,829.17
基金赎回款	-439,671.45	317,002.39	-122,669.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,650,766.57	-1,904,180.59	746,585.98

6.4.7.13 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6月30日
活期存款利息收入	345.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,032.80
结算备付金利息收入	2.92
其他	92.16
合计	1,472.95

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,140,429.72
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,140,429.72

6.4.7.14.2 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	70,892,647.20
减：卖出股票成本总额	71,885,553.74
减：交易费用	147,523.18
买卖股票差价收入	-1,140,429.72

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

本报告期，本基金无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期，本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 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，本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	29,450.00
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	29,450.00

6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	4,816.05
股票投资	4,816.05
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	4,816.05

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	221.63
合计	221.63

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期，本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	7,957.04
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	7,957.04

6.4.7.24 分部报告

本报告期，本基金无分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东海基金管理有限责任公司（“东海基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人、基金代销机构
东海证券股份有限公司（“东海证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	141,168,883.89	100.00	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东海证券	101,880.09	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金管理人选择东海证券作为证券经纪商进行股票、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。券商结算模式豁免单个券商的交易佣金比例限制。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	38,689.07	60,355.88
其中：应支付销售机构的客户维护	11,628.93	28,095.17

费		
应支付基金管理人的净管理费	27,060.14	32,260.71

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 1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,448.21	8,047.43

注：支付基金托管人江苏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期，本基金无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本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。

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

本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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

基金合同生效日（2018 年 11 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	991,288.55
报告期间因拆分变动份额	-	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	991,288.55
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	15.03%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
江苏银行	66,170.76	345.07	771,812.38	3,133.10
东海证券	688,519.73	1,032.80	-	-

注：1. 本基金托管户的银行存款由基金托管人江苏银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2. 本基金证券资金户的存款为本基金存放于东海证券股份有限公司的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2024 年 06 月 30 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2024 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2024 年 06 月 30 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的货币资金

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 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无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 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无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 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无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 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无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，建立流动性风险监控与预警机制，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券 10%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金的基金管理人每日对基金组合资产

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

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	754,750.02	-	-	-	-	-	754,750.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,312,405.00	5,312,405.00
应收申购款	-	-	-	-	-	119.83	119.83

资产总计	754,750.02	-	-	-	-	-5,312,524.83	6,067,274.85
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,001.74	6,001.74
应付托管费	-	-	-	-	-	1,000.29	1,000.29
其他负债	-	-	-	-	-	7,957.04	7,957.04
负债总计	-	-	-	-	-	14,959.07	14,959.07
利率敏感度缺口	754,750.02	-	-	-	-	-5,297,565.76	6,052,315.78
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	1,204,113.82	-	-	-	-	-	-1,204,113.82
结算备付金	8,176.73	-	-	-	-	-	8,176.73
存出保证金	36,724.20	-	-	-	-	-	36,724.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-6,916,906.00	6,916,906.00
应收申购款	-	-	-	-	-	529.21	529.21
资产总计	1,249,014.75	-	-	-	-	-6,917,435.21	8,166,449.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9.44	9.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,375.87	8,375.87
应付托管费	-	-	-	-	-	1,395.98	1,395.98
其他负债	-	-	-	-	-	34,793.28	34,793.28
负债总计	-	-	-	-	-	44,574.57	44,574.57
利率敏感度缺口	1,249,014.75	-	-	-	-	-6,872,860.64	8,121,875.39

6.4.13.4.1.2 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、存出保证金、结算备付金以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	5,312,405.00	87.77	6,916,906.00	85.16
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	5,312,405.00	87.77	6,916,906.00	85.16

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。以下分析中，除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准增加1%	75,426.18	59,794.44
	业绩比较基准减少1%	-75,426.18	-59,794.44

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	5,312,405.00	6,916,906.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	5,312,405.00	6,916,906.00

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 06 月 30 日：同）。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,312,405.00	87.56
	其中：股票	5,312,405.00	87.56
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	754,750.02	12.44
8	其他各项资产	119.83	0.00
9	合计	6,067,274.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	714,050.00	11.80
C	制造业	3,672,495.00	60.68
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	171,150.00	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	170,810.00	2.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	134,960.00	2.23
J	金融业	387,680.00	6.41
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	61,260.00	1.01
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	5,312,405.00	87.77

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600150	中国船舶	9,000	366,390.00	6.05
2	601989	中国重工	72,000	354,960.00	5.86
3	600685	中船防务	12,000	334,800.00	5.53
4	688522	纳睿雷达	6,000	281,280.00	4.65
5	600583	海油工程	40,000	236,400.00	3.91
6	601601	中国太保	8,000	222,880.00	3.68
7	601899	紫金矿业	11,000	193,270.00	3.19
8	601766	中国中车	25,000	187,750.00	3.10
9	603225	新凤鸣	12,000	187,080.00	3.09
10	688009	中国通号	30,000	180,000.00	2.97
11	300627	华测导航	6,000	179,100.00	2.96
12	600710	苏美达	21,000	171,150.00	2.83
13	600029	南方航空	29,000	170,810.00	2.82
14	603993	洛阳钼业	20,000	170,000.00	2.81
15	601319	中国人保	32,000	164,800.00	2.72
16	600038	中直股份	4,000	164,440.00	2.72
17	300762	上海瀚讯	9,000	161,190.00	2.66
18	600482	中国动力	8,000	155,840.00	2.57
19	300775	三角防务	5,000	153,000.00	2.53
20	600131	国网信通	8,000	134,960.00	2.23
21	000768	中航西飞	5,500	132,165.00	2.18
22	000630	铜陵有色	35,000	126,350.00	2.09
23	600988	赤峰黄金	7,000	114,380.00	1.89
24	002465	海格通信	11,000	113,960.00	1.88
25	300698	万马科技	3,000	105,390.00	1.74
26	002149	西部材料	7,500	104,700.00	1.73

27	002625	光启技术	6,000	104,100.00	1.72
28	600961	株冶集团	10,000	94,400.00	1.56
29	002993	奥海科技	2,500	93,000.00	1.54
30	000039	中集集团	10,000	92,600.00	1.53
31	300859	西域旅游	2,000	61,260.00	1.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603993	洛阳钼业	1,386,866.00	17.08
2	600975	新五丰	1,203,326.00	14.82
3	601601	中国太保	1,118,288.00	13.77
4	600150	中国船舶	1,091,898.00	13.44
5	600011	华能国际	1,060,219.00	13.05
6	601899	紫金矿业	1,047,265.00	12.89
7	600685	中船防务	1,003,426.00	12.35
8	000630	铜陵有色	961,090.00	11.83
9	000657	中钨高新	924,179.00	11.38
10	601628	中国人寿	898,921.00	11.07
11	601600	中国铝业	887,900.00	10.93
12	605117	德业股份	869,507.00	10.71
13	601336	新华保险	677,998.00	8.35
14	603225	新凤鸣	604,336.00	7.44
15	600583	海油工程	604,119.00	7.44
16	300629	新劲刚	579,600.00	7.14
17	000807	云铝股份	572,820.00	7.05
18	601100	恒立液压	569,437.00	7.01
19	600737	中粮糖业	560,010.00	6.90
20	600362	江西铜业	556,316.00	6.85
21	688676	金盘科技	553,369.77	6.81
22	605389	长龄液压	537,831.00	6.62
23	601717	郑煤机	536,422.00	6.60
24	300475	香农芯创	534,033.00	6.58
25	601989	中国重工	532,450.00	6.56
26	000100	TCL 科技	522,450.00	6.43
27	601211	国泰君安	520,552.00	6.41
28	002230	科大讯飞	519,110.00	6.39
29	600483	福能股份	514,693.40	6.34
30	000403	派林生物	513,254.00	6.32
31	600988	赤峰黄金	512,035.00	6.30
32	002608	江苏国信	510,296.00	6.28
33	002601	龙佰集团	504,890.00	6.22

34	002756	永兴材料	491,915.00	6.06
35	000858	五粮液	481,217.00	5.92
36	002371	北方华创	480,849.00	5.92
37	600482	中国动力	478,714.00	5.89
38	300775	三角防务	475,740.00	5.86
39	600031	三一重工	472,916.00	5.82
40	688166	博瑞医药	471,992.83	5.81
41	000543	皖能电力	471,450.00	5.80
42	002039	黔源电力	470,279.00	5.79
43	000400	许继电气	468,563.00	5.77
44	000923	河钢资源	466,541.00	5.74
45	301345	涛涛车业	465,373.00	5.73
46	000060	中金岭南	459,523.00	5.66
47	000425	徐工机械	449,689.00	5.54
48	605296	神农集团	443,615.00	5.46
49	603201	常润股份	438,215.40	5.40
50	000725	京东方 A	432,500.00	5.33
51	600161	天坛生物	422,824.00	5.21
52	000155	川能动力	413,065.00	5.09
53	002714	牧原股份	413,060.00	5.09
54	688041	海光信息	410,460.51	5.05
55	688408	中信博	405,722.72	5.00
56	300761	立华股份	400,407.00	4.93
57	600961	株冶集团	382,425.00	4.71
58	002840	华统股份	381,057.00	4.69
59	600027	华电国际	380,200.00	4.68
60	603079	圣达生物	379,284.00	4.67
61	000738	航发控制	376,122.00	4.63
62	600864	哈投股份	375,931.00	4.63
63	000951	中国重汽	362,419.00	4.46
64	300455	航天智装	356,760.00	4.39
65	601788	光大证券	354,285.00	4.36
66	300699	光威复材	345,828.00	4.26
67	600480	凌云股份	338,960.00	4.17
68	600131	国网信通	337,026.00	4.15
69	002947	恒铭达	335,516.00	4.13
70	002780	三夫户外	333,390.00	4.10
71	300747	锐科激光	333,255.00	4.10
72	688636	智明达	332,561.08	4.09
73	002567	唐人神	330,800.00	4.07
74	601118	海南橡胶	324,279.00	3.99
75	603338	浙江鼎力	316,866.00	3.90
76	000801	四川九洲	311,390.00	3.83

77	000426	兴业银锡	309,910.00	3.82
78	600236	桂冠电力	305,500.00	3.76
79	002517	恺英网络	305,200.00	3.76
80	003006	百亚股份	304,523.00	3.75
81	688176	亚虹医药	302,272.18	3.72
82	002236	大华股份	301,888.60	3.72
83	601838	成都银行	297,120.00	3.66
84	603388	ST 元成	296,391.00	3.65
85	603897	长城科技	294,702.00	3.63
86	600809	山西汾酒	293,626.00	3.62
87	600021	上海电力	292,756.00	3.60
88	600998	九州通	292,149.50	3.60
89	603365	水星家纺	289,632.00	3.57
90	002465	海格通信	286,350.00	3.53
91	688522	纳睿雷达	284,695.00	3.51
92	688525	佰维存储	265,500.00	3.27
93	300762	上海瀚讯	261,884.00	3.22
94	301030	仕净科技	261,263.00	3.22
95	688121	卓然股份	260,922.27	3.21
96	000768	中航西飞	255,388.00	3.14
97	002625	光启技术	253,890.00	3.13
98	000589	贵州轮胎	249,200.00	3.07
99	000528	柳工	236,408.00	2.91
100	600428	中远海特	221,580.00	2.73
101	000001	平安银行	218,550.00	2.69
102	603466	风语筑	217,630.00	2.68
103	600926	杭州银行	216,129.00	2.66
104	600061	国投资本	211,556.00	2.60
105	002738	中矿资源	204,000.00	2.51
106	601825	沪农商行	202,950.00	2.50
107	002466	天齐锂业	201,620.00	2.48
108	601163	三角轮胎	201,592.00	2.48
109	000831	中国稀土	201,155.00	2.48
110	002993	奥海科技	200,621.00	2.47
111	002176	江特电机	200,580.00	2.47
112	603300	华铁应急	198,900.00	2.45
113	300947	德必集团	195,828.00	2.41
114	600559	老白干酒	194,909.00	2.40
115	300729	乐歌股份	191,358.00	2.36
116	002858	力盛体育	190,144.00	2.34
117	300280	紫天科技	190,000.00	2.34
118	300624	万兴科技	189,653.00	2.34
119	600062	华润双鹤	189,496.00	2.33

120	300049	福瑞股份	189,496.00	2.33
121	601179	中国西电	188,560.00	2.32
122	603682	锦和商管	188,389.00	2.32
123	600030	中信证券	187,830.00	2.31
124	300001	特锐德	187,110.00	2.30
125	300873	海晨股份	187,073.00	2.30
126	603081	大丰实业	186,302.00	2.29
127	300124	汇川技术	184,968.00	2.28
128	603330	天洋新材	184,615.00	2.27
129	601156	东航物流	183,918.00	2.26
130	001309	德明利	182,422.00	2.25
131	000625	长安汽车	182,031.00	2.24
132	603051	鹿山新材	182,019.00	2.24
133	000166	申万宏源	182,000.00	2.24
134	600032	浙江新能	181,974.00	2.24
135	603477	巨星农牧	181,821.00	2.24
136	688608	恒玄科技	181,657.20	2.24
137	600111	北方稀土	181,530.00	2.24
138	300100	双林股份	181,516.00	2.23
139	600710	苏美达	181,240.00	2.23
140	300360	炬华科技	180,876.00	2.23
141	300627	华测导航	180,806.00	2.23
142	600318	新力金融	180,400.00	2.22
143	600621	华鑫股份	180,000.00	2.22
144	688568	中科星图	179,060.15	2.20
145	688009	中国通号	177,920.00	2.19
146	688523	航天环宇	177,117.62	2.18
147	605377	华旺科技	177,100.00	2.18
148	002984	森麒麟	176,364.00	2.17
149	300433	蓝思科技	176,340.00	2.17
150	601766	中国中车	175,740.00	2.16
151	601319	中国人保	175,160.00	2.16
152	301117	佳缘科技	174,978.00	2.15
153	600029	南方航空	173,460.00	2.14
154	300679	电连技术	171,884.00	2.12
155	688100	威胜信息	170,539.62	2.10
156	002469	三维化学	170,370.00	2.10
157	600409	三友化工	169,200.00	2.08
158	601890	亚星锚链	168,600.00	2.08
159	603416	信捷电气	168,448.00	2.07
160	300765	新诺威	167,990.00	2.07
161	000977	浪潮信息	167,740.00	2.07
162	603505	金石资源	166,162.00	2.05

163	600038	中直股份	166,136.00	2.05
164	002675	东诚药业	165,183.00	2.03
165	002613	北玻股份	165,163.00	2.03
166	688488	艾迪药业	164,670.00	2.03
167	688027	国盾量子	164,111.60	2.02
168	603920	世运电路	163,530.00	2.01
169	601108	财通证券	162,600.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	603993	洛阳钼业	1,364,283.00	16.80
2	600975	新五丰	1,201,078.00	14.79
3	601601	中国太保	1,101,114.00	13.56
4	600011	华能国际	1,066,516.00	13.13
5	000657	中钨高新	973,271.70	11.98
6	601899	紫金矿业	958,817.00	11.81
7	601600	中国铝业	917,847.00	11.30
8	601628	中国人寿	902,816.00	11.12
9	000630	铜陵有色	884,870.00	10.89
10	605117	德业股份	843,634.00	10.39
11	002840	华统股份	823,128.00	10.13
12	300629	新劲刚	799,250.00	9.84
13	600150	中国船舶	760,910.00	9.37
14	605389	长龄液压	689,046.00	8.48
15	002567	唐人神	677,200.00	8.34
16	601336	新华保险	676,670.00	8.33
17	600685	中船防务	669,382.00	8.24
18	688166	博瑞医药	645,737.38	7.95
19	688676	金盘科技	603,520.00	7.43
20	000807	云铝股份	584,820.00	7.20
21	601100	恒立液压	582,255.00	7.17
22	600362	江西铜业	576,170.00	7.09
23	300699	光威复材	571,463.00	7.04
24	600737	中粮糖业	566,713.00	6.98
25	688636	智明达	564,471.50	6.95
26	601717	郑煤机	542,539.00	6.68
27	300475	香农芯创	531,350.00	6.54
28	002230	科大讯飞	529,910.00	6.52
29	601211	国泰君安	527,220.00	6.49
30	002608	江苏国信	519,910.00	6.40
31	600483	福能股份	515,296.50	6.34

32	002601	龙佰集团	514,238.00	6.33
33	600031	三一重工	514,003.00	6.33
34	000403	派林生物	513,312.00	6.32
35	002039	黔源电力	493,017.00	6.07
36	603388	ST 元成	490,968.32	6.05
37	002371	北方华创	490,630.00	6.04
38	000858	五粮液	484,731.00	5.97
39	000425	徐工机械	481,890.00	5.93
40	000923	河钢资源	480,880.00	5.92
41	000543	皖能电力	478,750.00	5.89
42	000100	TCL 科技	478,050.00	5.89
43	301345	涛涛车业	477,336.00	5.88
44	000400	许继电气	470,360.00	5.79
45	605296	神农集团	468,669.64	5.77
46	000060	中金岭南	465,400.00	5.73
47	002756	永兴材料	454,615.64	5.60
48	603225	新凤鸣	438,163.00	5.39
49	002714	牧原股份	429,028.00	5.28
50	000725	京东方 A	428,000.00	5.27
51	600988	赤峰黄金	424,101.00	5.22
52	688408	中信博	416,765.00	5.13
53	600161	天坛生物	414,660.00	5.11
54	002100	天康生物	403,000.00	4.96
55	300761	立华股份	399,702.88	4.92
56	688041	海光信息	395,040.00	4.86
57	600027	华电国际	394,505.00	4.86
58	603201	常润股份	391,904.40	4.83
59	600864	哈投股份	388,244.78	4.78
60	000155	川能动力	386,080.00	4.75
61	002465	海格通信	385,000.00	4.74
62	000738	航发控制	381,164.00	4.69
63	688523	航天环宇	375,906.15	4.63
64	000951	中国重汽	368,837.00	4.54
65	688270	臻镭科技	365,351.89	4.50
66	600583	海油工程	361,669.00	4.45
67	300775	三角防务	358,990.00	4.42
68	300455	航天智装	355,272.00	4.37
69	601788	光大证券	352,920.00	4.35
70	600480	凌云股份	341,427.00	4.20
71	002780	三夫户外	337,709.00	4.16
72	002947	恒铭达	333,718.24	4.11
73	003006	百亚股份	333,251.00	4.10
74	300747	锐科激光	328,978.40	4.05

75	000426	兴业银锡	321,710.00	3.96
76	688776	国光电气	320,946.70	3.95
77	601118	海南橡胶	317,440.00	3.91
78	603338	浙江鼎力	316,500.00	3.90
79	000801	四川九洲	314,590.00	3.87
80	600236	桂冠电力	314,210.00	3.87
81	600482	中国动力	311,740.00	3.84
82	600021	上海电力	310,550.00	3.82
83	688176	亚虹医药	305,637.10	3.76
84	603079	圣达生物	304,727.00	3.75
85	601838	成都银行	299,828.00	3.69
86	600809	山西汾酒	296,530.00	3.65
87	603897	长城科技	293,972.00	3.62
88	300589	江龙船艇	293,140.00	3.61
89	002517	恺英网络	293,054.00	3.61
90	002236	大华股份	285,411.04	3.51
91	600961	株冶集团	283,434.00	3.49
92	603365	水星家纺	283,035.00	3.48
93	301030	仕净科技	262,851.00	3.24
94	688525	佰维存储	255,794.99	3.15
95	688121	卓然股份	250,444.19	3.08
96	000528	柳工	242,360.00	2.98
97	600998	九州通	241,920.90	2.98
98	000589	贵州轮胎	230,000.00	2.83
99	600428	中远海特	226,840.00	2.79
100	688123	聚辰股份	223,087.02	2.75
101	600926	杭州银行	214,200.00	2.64
102	301308	江波龙	212,917.00	2.62
103	601825	沪农商行	207,890.00	2.56
104	000001	平安银行	206,800.00	2.55
105	688333	铂力特	205,974.00	2.54
106	688439	振华风光	200,951.33	2.47
107	300100	双林股份	198,000.00	2.44
108	000048	京基智农	198,000.00	2.44
109	600399	抚顺特钢	197,390.00	2.43
110	601179	中国西电	195,760.00	2.41
111	002977	天箭科技	195,650.00	2.41
112	600061	国投资本	195,170.00	2.40
113	688008	澜起科技	193,680.00	2.38
114	000831	中国稀土	193,674.00	2.38
115	300049	福瑞股份	193,580.00	2.38
116	300001	特锐德	192,235.00	2.37
117	300624	万兴科技	191,262.00	2.35

118	603466	风语筑	191,256.00	2.35
119	688311	盟升电子	190,519.08	2.35
120	600030	中信证券	189,030.00	2.33
121	600062	华润双鹤	188,820.00	2.32
122	601989	中国重工	188,200.00	2.32
123	601156	东航物流	188,000.00	2.31
124	300280	紫天科技	187,874.00	2.31
125	600559	老白干酒	187,680.00	2.31
126	001309	德明利	186,000.00	2.29
127	601163	三角轮胎	185,400.00	2.28
128	000625	长安汽车	185,400.00	2.28
129	600318	新力金融	185,167.00	2.28
130	300124	汇川技术	184,890.00	2.28
131	688608	恒玄科技	183,272.87	2.26
132	000166	申万宏源	183,200.00	2.26
133	300360	炬华科技	182,516.00	2.25
134	600111	北方稀土	182,340.00	2.25
135	002176	江特电机	182,250.00	2.24
136	688100	威胜信息	182,100.23	2.24
137	002466	天齐锂业	181,220.00	2.23
138	600621	华鑫股份	180,840.00	2.23
139	002738	中矿资源	180,537.00	2.22
140	600032	浙江新能	180,400.00	2.22
141	300433	蓝思科技	179,910.00	2.22
142	688383	新益昌	178,309.84	2.20
143	301117	佳缘科技	178,130.00	2.19
144	300729	乐歌股份	178,067.00	2.19
145	603505	金石资源	174,772.00	2.15
146	603300	华铁应急	173,700.00	2.14
147	603477	巨星农牧	173,595.00	2.14
148	605377	华旺科技	171,870.00	2.12
149	002469	三维化学	171,180.00	2.11
150	002675	东诚药业	170,650.00	2.10
151	300765	新诺威	170,405.00	2.10
152	603416	信捷电气	168,720.00	2.08
153	600409	三友化工	168,600.00	2.08
154	688170	德龙激光	168,235.89	2.07
155	300719	安达维尔	168,012.00	2.07
156	603920	世运电路	167,140.00	2.06
157	002984	森麒麟	166,320.00	2.05
158	300679	电连技术	166,120.00	2.05
159	688488	艾迪药业	164,860.00	2.03
160	603330	天洋新材	163,724.00	2.02

161	600893	航发动力	163,260.00	2.01
162	600023	浙能电力	162,784.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	70,276,236.69
卖出股票收入（成交）总额	70,892,647.20

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末，本基金未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末，本基金未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末，本基金未持有资产支持证券投资。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末，本基金未持有权证投资。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国太平洋保险（集团）股份有限公司在报告编制前一年内受到国家外汇管理局上海市分局的处罚，中国船舶重工股份有限公司在报告编制前一年内受到中国证监会北京监管局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	119.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119.83

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
796	6,665.49	991,386.96	18.69	4,314,342.84	81.31

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)

基金管理人所有从业人员持有本基金	480,441.67	9.0551
------------------	------------	--------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年11月23日) 基金份额总额	271,630,618.22
本报告期期初基金份额总额	6,104,886.11
本报告期基金总申购份额	73,276.85
减：本报告期基金总赎回份额	872,433.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5,305,729.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人 2024 年 6 月 22 日发布公告，周华成先生因到龄退休，于 2024 年 6 月 21 日离任公司副总经理、首席信息官、财务负责人。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东海证券	2	141,168,883.89	100.00	101,880.09	100.00	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，本报告期内本基金选择东海证券作为证券经纪商。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例

						(%)
东海证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东海核心价值精选混合型证券投资基金 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	东海核心价值精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
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	东海核心价值精选混合型证券投资基金 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
7	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
8	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
9	东海核心价值精选混合型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
10	东海核心价值精选混合型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

东海基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 30 日