

东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
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	11
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
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	39
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	39
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	40

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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12	投资组合报告附注	40
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>41</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末上市基金前十名持有人	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.4	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	41
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>42</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>42</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	其他重大事件	44
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>45</b>
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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	45
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>45</b>
12.1	备查文件目录	45
12.2	存放地点	45
12.3	查阅方式	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	东海祥龙混合 (LOF)
场内简称	东海祥龙 LOF
基金主代码	168301
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2016 年 12 月 21 日
基金管理人	东海基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,898,742.47 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 2 月 27 日

注:根据本基金合同约定,本基金的封闭期自 2016 年 12 月 21 日起至 2018 年 6 月 21 日止,自 2018 年 6 月 22 日起,本基金转换为上市开放式基金 (LOF)。自 2018 年 6 月 22 日起,本基金的基金名称由“东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金”变更为“东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制风险的前提下,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(1)类别资产配置策略本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别,对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。本基金采用多因素分析框架,将综合考量宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策,来动态调整大类资产的配置比例。(2)股票投资策略深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会,积极把握宏观经济和市场发展趋势,精选具有估值优势的公司股票进行投资。基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相结合的分析方法,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。本基金在进行个股筛选时,将从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司:1)定性分析:通过分析上市公司所处行业、主营业务、同行业竞争水平、公司内部管理水平、盈利能力、

	<p>资本负债结构、商誉。2) 定量分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备选成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等；ROE、ROIC、毛利率、净利率等；PE、PEG、PB、PS 等。(3) 股指期货投资策略本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。(4) 国债期货投资策略为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货提高投资组合的运作效率。(5) 债券投资策略根据流动性管理、资产配置等需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略、久期策略等，由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。(6) 权证投资策略权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的高科技公司发行的权证。(7) 资产支持证券投资策略本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。(8) 中小企业私募债券投资策略中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	牛锐	郭明
	联系电话	021-60586900	010-66105799
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-9595531	95588
传真		021-60586926	010-66105798
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200122	100140
法定代表人	严晓珺	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-1,850,699.14
本期利润	-901,830.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0616
本期加权平均净值利润率	-5.55%
本期基金份额净值增长率	-7.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	390,483.27
期末可供分配基金份额利润	0.0281
期末基金资产净值	14,289,225.74
期末基金份额净值	1.0281
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.81%

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)本基金于2018年6月22日正式转型为东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

### 3.2 基金净值表现

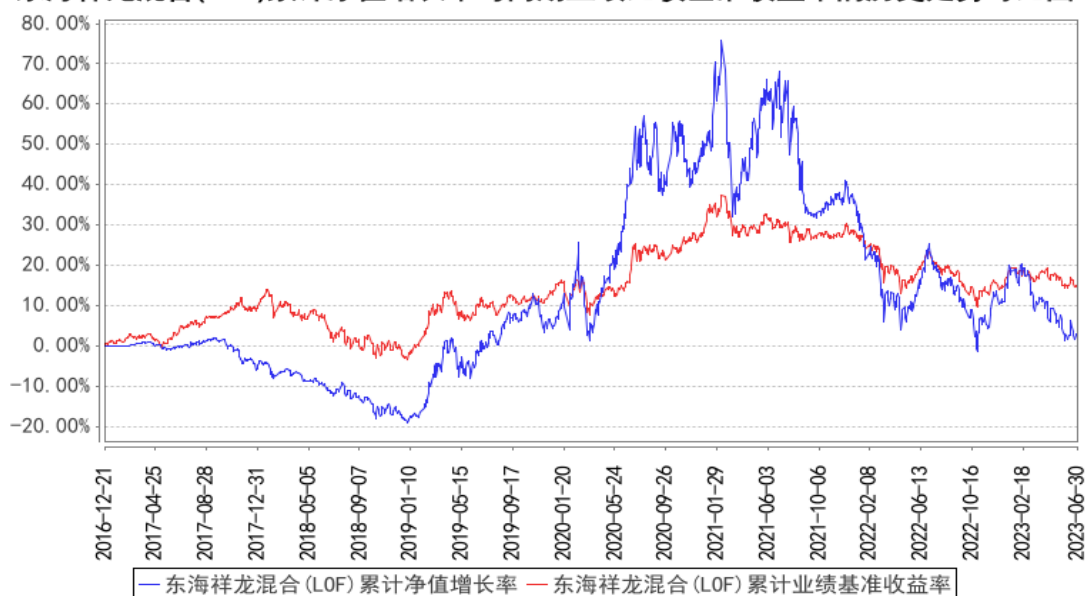
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.46%	0.91%	0.68%	0.43%	0.78%	0.48%
过去三个月	-8.30%	0.87%	-2.10%	0.41%	-6.20%	0.46%
过去六个月	-7.47%	0.97%	0.29%	0.42%	-7.76%	0.55%
过去一年	-16.99%	1.03%	-6.53%	0.49%	-10.46%	0.54%
过去三年	-28.69%	1.53%	-1.21%	0.60%	-27.48%	0.93%
自基金合同生效起至今	2.81%	1.24%	15.11%	0.59%	-12.30%	0.65%

### 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

东海祥龙混合(LOF)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，在未来五年，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。

#### 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		
李珂	本基金的基金经理	2021 年 9 月 13 日	-	12 年	国籍：中国。产业经济学专业硕士，曾任职于海通证券股份有限公司研究所分析师，中银国际证券股份有限公司资产管理板块研究与交易部研究员，2021 年 2 月加入东海基金，现任研发策略部副总经理（主持工作）、基金经理。2021 年 9 月 13 日起任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金和东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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遵规守信情况的说明

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

2023 年上半年 A 股市场在年初上行之，二季度整体以震荡调整为主。一季度价值、低估值、成长轮番表现；二季度北向资金整体净流出，风格上北上持股较重的消费蓝筹和一季度上涨更为

明显的成长板块调整幅度更大，50 权重更为抗跌，行情的结构性特征体现的较为明显。今年以来消费板块行情，可谓一波三折，2022 年末放开后市场对交叉感染、居民恐慌等担忧较多，但 2023 年初疫情实现了超预期达峰，春节消费表现超预期，消费板块在一季度走出一波快速的上涨；进入 4 月，消费高频数据逐渐并不尽如人意，终端需求也开始逐渐走弱，从消费内部结构来看，分化开始明显，高端消费、大众消费仍能保持一定韧性，商务消费则偏弱。

产品保持对于消费整体的配置，拉长看三年疫情对于国内居民消费的影响，我们认为消费结构的分化仍可能延续较长一段时间，我们仍将坚持自下而上挖掘具备较强综合成本管理优势、出海竞争优势、平台能力及创新驱动的个股。我们认为消费作为居民生活不可或缺的重要组成部分，消费板块也是值得我们长期投资的重要赛道。

#### 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 1.0281 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场当前处于情绪较为低迷的阶段，长周期和短周期均有看似确定的负面压制；但是我们认为，历史上市场往往在基本面出现拐点前后会出现情绪的延续，尽管今年中观数据的低基数效应集中于上半年释放，不可忽视的是无论是价格还是库存，都有望在下半年迎来拐点。

站在当下，消费板块估值再度回落至去年刚放开时的低位，市场对消费的预期已经变的足够悲观，可谓现实与预期双弱。我们认为当下对大消费板块可以乐观起来：首先板块的估值已经回到近五年的低位，可选消费（汽车、家电）和新型消费（医药）已经在 EPS 和估值层面有所反应；其次在悲观预期下，经销商开始变的保守，去库存的现象明显，后面终端需求一旦略有好转叠加补库需求，会对消费板块形成较强刺激；第三是消费品的优质公司从来不是依靠行业增速快慢几个点来实现增长的，品类扩展、渠道扩张，份额提升、盈利能力提高远比行业增速快慢几个点更重要，在宏观经济从过去几年大起大落趋于平稳后，消费品的优质公司依然是长坡厚雪的优质资产。

#### 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 2023 年 1 月 3 日至报告期末均低于 5000 万元，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——东海基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人依法对东海基金管理有限责任公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	995,250.86	2,746,262.17
结算备付金		3,764.97	6,964.27
存出保证金		3,700.85	1,809.01
交易性金融资产	6.4.7.2	13,421,444.93	18,532,403.98
其中：股票投资		13,254,863.20	17,999,695.70
基金投资		-	-
债券投资		166,581.73	532,708.28
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	-	799,460.13
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		49,438.53	2,180,890.44
应收股利		-	-
应收申购款		533.22	2,442,512.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		14,474,133.36	26,710,302.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		65,459.14	663,898.24
应付赎回款		13.98	35,295.23
应付管理人报酬		17,739.25	23,356.39
应付托管费		2,956.52	3,892.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.16	0.42

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	98,738.57	119,835.42
负债合计		184,907.62	846,278.46
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	13,898,742.47	23,278,837.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	390,483.27	2,585,187.43
净资产合计		14,289,225.74	25,864,024.43
负债和净资产总计		14,474,133.36	26,710,302.89

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0281 元，基金份额总额 13,898,742.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-766,015.92	-1,872,234.24
1. 利息收入		4,523.22	3,330.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,994.14	3,330.54
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,529.08	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,789,951.55	-1,426,373.17
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,929,359.50	-1,542,736.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-13,071.05	12,840.49
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	152,479.00	103,523.28
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	948,868.83	-453,770.80
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	70,543.58	4,579.19
<b>减：二、营业总支出</b>		135,814.39	161,958.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	121,497.69	125,911.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	20,249.60	20,985.13
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		0.06	6.06
8. 其他费用	6.4.7.23	-5,932.96	15,056.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-901,830.31	-2,034,192.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-901,830.31	-2,034,192.91
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-901,830.31	-2,034,192.91

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	23,278,837.00	-	2,585,187.43	25,864,024.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	23,278,837.00	-	2,585,187.43	25,864,024.43
三、本期增减变	-9,380,094.53	-	-2,194,704.16	-11,574,798.69

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-901,830.31	-901,830.31
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-9,380,094.53	-	-1,292,873.85	-10,672,968.38
其中: 1. 基金申购款	297,740.70	-	42,261.15	340,001.85
2. 基金赎回款	-9,677,835.23	-	-1,335,135.00	-11,012,970.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	13,898,742.47	-	390,483.27	14,289,225.74
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	15,427,376.78	-	5,626,636.80	21,054,013.58
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	15,427,376.78	-	5,626,636.80	21,054,013.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,657,335.84	-	-2,341,724.54	-3,999,060.38
(一)、综合收益总额	-	-	-2,034,192.91	-2,034,192.91
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,657,335.84	-	-307,531.63	-1,964,867.47



(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	592,259.38	-	135,455.82	727,715.20
2. 基金赎回款	-2,249,595.22	-	-442,987.45	-2,692,582.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	13,770,040.94	-	3,284,912.26	17,054,953.20

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 由东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金转换而成。东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2016]2305 号文《关于准予东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册, 由东海基金管理有限责任公司 (以下简称“东海基金”) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”) 发售, 基金合同于 2016 年 12 月 21 日生效, 首次设立募集规模为 863,058,457.47 份基金份额, 本基金为契约型, 存续期限不定。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务, 但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额; 封闭期届满后, 本基金转换为上市开放式基金, 并更名为东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF), 投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。本基金的封闭期是指自基金合同生效之日起包括 (基金合同生效之日) 至第 18 个月后对应日 (含该日) 的期间, 如遇非工作日或无该对

应日，则顺延至下一个工作日。本基金的基金管理人为东海基金，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据基金合同的相关约定，东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金封闭期自 2016 年 12 月 21 日起至 2018 年 6 月 21 日止；自 2018 年 6 月 22 日起，东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金，基金名称变更为“东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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）。本基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金(LOF)后，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

#### 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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度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》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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	995,250.86
等于：本金	995,138.62
加：应计利息	112.24
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	995,250.86

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,554,547.09	-	13,254,863.20	-299,683.89
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	168,272.93	105.73	166,581.73	-1,796.93
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	168,272.93	105.73	166,581.73	-1,796.93
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		13,722,820.02	105.73	13,421,444.93	-301,480.82

#### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,803.48
其中：交易所市场	10,803.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费用	7,935.04
预提信息披露费	80,000.00
合计	98,738.57

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,278,837.00	23,278,837.00
本期申购	297,740.70	297,740.70
本期赎回（以“-”号填列）	-9,677,835.23	-9,677,835.23
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	13,898,742.47	13,898,742.47

#### 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	19,732,466.53	-17,147,279.10	2,585,187.43
本期利润	-1,850,699.14	948,868.83	-901,830.31
本期基金份额交易产生的变动数	-7,870,961.56	6,578,087.71	-1,292,873.85

其中：基金申购款	242,812.48	-200,551.33	42,261.15
基金赎回款	-8,113,774.04	6,778,639.04	-1,335,135.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,010,805.83	-9,620,322.56	390,483.27

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		2,658.83
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		306.69
其他		28.62
合计		2,994.14

注：其他列示的是交易保证金利息收入。

#### 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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,929,359.50
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		-1,929,359.50

##### 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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		16,644,278.34
减：卖出股票成本总额		18,531,449.19
减：交易费用		42,188.65
买卖股票差价收入		-1,929,359.50

##### 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	782.84
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-13,853.89
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	-13,071.05

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	535,860.48
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	546,894.77
减：应计利息总额	2,781.37
减：交易费用	38.23
买卖债券差价收入	-13,853.89

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	152,479.00
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	152,479.00

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	948,868.83
股票投资	934,475.99
债券投资	14,392.84
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	948,868.83

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	70,543.58
合计	70,543.58

**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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	-6,064.96
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	132.00
合计	-5,932.96

**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（“东海基金管理有限责任公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、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

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股票交易。

###### 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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

##### 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	121,497.69	125,911.09
其中：支付销售机构的客户维护费	52,462.87	50,688.13

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 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,249.60	20,985.13

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

###### 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,本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国工商银行	995,250.86	2,658.83	2,435,678.50	3,144.87

注:本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2023年06月30日的相关余额为人民币3,764.97元。(2022年06月30日:人民币0.00元)

### 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（2023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2023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2023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2023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2023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2023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此限定的范围之内，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。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	262,775.68
AAA 以下	166,581.73	269,932.60
未评级	-	-
合计	166,581.73	532,708.28

##### 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。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。

本基金所持有的证券在证券交易所上市交易。本报告期末，除完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。本报告期末，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购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银行存款、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，并按照合同约定的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 2023年6月30	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

日							
资产							
银行存款	995,250.86	-	-	-	-	-	995,250.86
结算备付金	3,764.97	-	-	-	-	-	3,764.97
存出保证金	3,700.85	-	-	-	-	-	3,700.85
交易性金融资产	-	-166,581.73	-	-	-13,254,863.20	-	13,421,444.93
应收申购款	-	-	-	-	533.22	-	533.22
应收清算款	-	-	-	-	49,438.53	-	49,438.53
资产总计	1,002,716.68	-166,581.73	-	-	-13,304,834.95	-	14,474,133.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	13.98	-	13.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	17,739.25	-	17,739.25
应付托管费	-	-	-	-	2,956.52	-	2,956.52
应付清算款	-	-	-	-	65,459.14	-	65,459.14
应交税费	-	-	-	-	0.16	-	0.16
其他负债	-	-	-	-	98,738.57	-	98,738.57
负债总计	-	-	-	-	184,907.62	-	184,907.62
利率敏感度缺口	1,002,716.68	-166,581.73	-	-	-13,119,927.33	-	14,289,225.74
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,746,262.17	-	-	-	-	-	2,746,262.17
结算备付金	6,964.27	-	-	-	-	-	6,964.27
存出保证金	1,809.01	-	-	-	-	-	1,809.01
交易性金融资产	-	-262,775.68	269,932.60	-	-17,999,695.70	-	18,532,403.98
买入返售金融资产	799,460.13	-	-	-	-	-	799,460.13
应收申购款	-	-	-	-	2,442,512.89	-	2,442,512.89
应收清算款	-	-	-	-	2,180,890.44	-	2,180,890.44
资产总计	3,554,495.58	-262,775.68	269,932.60	-	-22,623,099.03	-	26,710,302.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	35,295.23	-	35,295.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	23,356.39	-	23,356.39
应付托管费	-	-	-	-	3,892.76	-	3,892.76
应付清算款	-	-	-	-	663,898.24	-	663,898.24
应交税费	-	-	-	-	0.42	-	0.42
其他负债	-	-	-	-	119,835.42	-	119,835.42
负债总计	-	-	-	-	846,278.46	-	846,278.46



利率敏感度缺口	3,554,495.58	-262,775.68	269,932.60	-21,776,820.57	25,864,024.43
---------	--------------	-------------	------------	----------------	---------------

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况，该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；银行存款、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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-2,037.60	-3,696.25
	市场利率下降 25 个基点	2,068.47	3,748.96

#### 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的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	13,254,863.20	92.76	17,999,695.70	69.59
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	13,254,863.20	92.76	17,999,695.70	69.59

#### 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准减少1%	-222,164.76	-350,748.59
	业绩比较基准增加1%	222,164.76	350,748.59

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	13,421,444.93	18,532,403.98
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	13,421,444.93	18,532,403.98

##### 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 2023 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(2022 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	13,254,863.20	91.58
	其中：股票	13,254,863.20	91.58

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	166,581.73	1.15
	其中：债券	166,581.73	1.15
	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	999,015.83	6.90
8	其他各项资产	53,672.60	0.37
9	合计	14,474,133.36	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	1,656,950.00	11.60
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,235,455.00	71.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,240.00	0.22
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	28,912.20	0.20
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	63,186.00	0.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,239,120.00	8.67
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	13,254,863.20	92.76

### 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	600887	伊利股份	40,000	1,132,800.00	7.93
2	600519	贵州茅台	600	1,014,600.00	7.10
3	000858	五粮液	6,000	981,420.00	6.87
4	600415	小商品城	114,000	972,420.00	6.81
5	002548	金新农	105,000	804,300.00	5.63
6	603477	巨星农牧	24,000	800,400.00	5.60
7	600975	新五丰	80,000	764,800.00	5.35
8	600559	老白干酒	28,100	688,731.00	4.82
9	600276	恒瑞医药	14,000	670,600.00	4.69
10	603076	乐惠国际	14,000	669,340.00	4.68
11	603345	安井食品	4,400	645,920.00	4.52
12	300138	晨光生物	34,000	608,600.00	4.26
13	002311	海大集团	12,000	562,080.00	3.93
14	002594	比亚迪	2,000	516,540.00	3.61
15	000860	顺鑫农业	9,000	303,210.00	2.12
16	000785	居然之家	70,000	266,700.00	1.87
17	605338	巴比食品	8,000	202,000.00	1.41
18	002840	华统股份	10,000	156,400.00	1.09
19	300151	昌红科技	7,000	126,700.00	0.89
20	002100	天康生物	15,000	123,750.00	0.87
21	000333	美的集团	2,000	117,840.00	0.82
22	600211	西藏药业	1,700	100,980.00	0.71
23	688266	泽璟制药	2,000	93,100.00	0.65
24	603309	维力医疗	6,000	92,820.00	0.65
25	300498	温氏股份	5,000	91,750.00	0.64
26	000521	长虹美菱	12,000	91,680.00	0.64
27	000651	格力电器	2,000	73,020.00	0.51
28	603517	绝味食品	1,800	66,870.00	0.47
29	600399	抚顺特钢	6,000	61,200.00	0.43
30	002422	科伦药业	2,000	59,360.00	0.42
31	300418	昆仑万维	1,200	48,336.00	0.34
32	000921	海信家电	1,600	43,120.00	0.30
33	300003	乐普医疗	1,600	36,176.00	0.25
34	002424	贵州百灵	4,000	35,920.00	0.25
35	600509	天富能源	4,000	31,240.00	0.22
36	300760	迈瑞医疗	100	29,980.00	0.21
37	600285	羚锐制药	1,600	25,696.00	0.18
38	000999	华润三九	400	24,264.00	0.17
39	000423	东阿阿胶	400	21,380.00	0.15
40	600332	白云山	500	15,940.00	0.11

41	688566	吉贝尔	400	15,604.00	0.11
42	600998	九州通	1,490	15,466.20	0.11
43	300302	同有科技	1,000	14,850.00	0.10
44	601607	上海医药	600	13,446.00	0.09
45	600129	太极集团	200	11,898.00	0.08
46	600566	济川药业	400	11,616.00	0.08

## 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	600975	新五丰	800,887.00	3.10
2	603477	巨星农牧	780,363.00	3.02
3	600276	恒瑞医药	671,410.00	2.60
4	002548	金新农	661,500.00	2.56
5	600415	小商品城	643,710.00	2.49
6	300138	晨光生物	620,966.00	2.40
7	000858	五粮液	388,584.00	1.50
8	600399	抚顺特钢	361,000.00	1.40
9	000661	长春高新	330,476.00	1.28
10	000860	顺鑫农业	312,704.00	1.21
11	000785	居然之家	307,830.00	1.19
12	301078	孩子王	227,754.09	0.88
13	688266	泽璟制药	175,360.88	0.68
14	000625	长安汽车	174,450.00	0.67
15	002840	华统股份	165,839.00	0.64
16	601127	赛力斯	156,741.40	0.61
17	603076	乐惠国际	151,076.00	0.58
18	600211	西藏药业	143,609.00	0.56
19	688235	百济神州	132,260.00	0.51
20	603816	顾家家居	132,052.00	0.51

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	600132	重庆啤酒	644,868.00	2.49
2	000333	美的集团	538,510.00	2.08
3	600882	妙可蓝多	472,741.00	1.83
4	688202	美迪西	438,658.00	1.70
5	600905	三峡能源	431,690.00	1.67
6	688266	泽璟制药	377,332.64	1.46

7	301058	中粮科工	365,398.00	1.41
8	600399	抚顺特钢	313,996.00	1.21
9	603259	药明康德	311,081.00	1.20
10	601899	紫金矿业	303,700.00	1.17
11	605338	巴比食品	299,328.00	1.16
12	000858	五粮液	296,732.00	1.15
13	605016	百龙创园	295,420.00	1.14
14	600436	片仔癀	281,011.00	1.09
15	000661	长春高新	272,850.00	1.05
16	002508	老板电器	270,820.00	1.05
17	300896	爱美客	268,414.00	1.04
18	601101	昊华能源	266,976.00	1.03
19	600256	广汇能源	264,940.00	1.02
20	603260	合盛硅业	244,580.00	0.95

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	12,852,140.70
卖出股票收入（成交）总额	16,644,278.34

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	166,581.73	1.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	166,581.73	1.17

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113648	巨星转债	1,200	166,581.73	1.17

**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**

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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	3,700.85
2	应收清算款	49,438.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	533.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,672.60

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元



序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113648	巨星转债	166,581.73	1.17

### 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 (%)
987	14,081.81	-	-	13,898,742.47	100.00

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	狄艳平	1,568,365.74	11.28
2	李强	1,126,146.00	8.10
3	陈颖华	500,000.00	3.60
4	郭改妞	494,116.15	3.56
5	钱建中	494,093.65	3.56
6	王梦云	494,093.65	3.56
7	丁银凤	460,031.00	3.31
8	吴亚萍	407,506.61	2.93
9	陈少强	345,119.00	2.48
10	刘杨	300,174.00	2.16

### 8.3 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	16,120.21	0.12

### 8.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0~10
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（2016年12月21日） 基金份额总额	863,058,457.47
本报告期期初基金份额总额	23,278,837.00
本报告期基金总申购份额	297,740.70
减：本报告期基金总赎回份额	9,677,835.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,898,742.47

## § 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

本报告期内，本基金管理人、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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023年4月14日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	股东深圳鹏博实业集团有限公司股权质押未能按期完成整改

管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	股东方已提交整改报告
其他	-

### 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 (%)	
德邦证券	2	20,226,837.01	68.57	14,589.48	62.80	-
海通证券	2	9,269,582.03	31.43	8,642.79	37.20	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注: 1、本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为华鑫证券有限责任公司和恒泰证券股份有限公司。

2、本基金管理人负责选择证券经营机构, 租用其交易单元作为本基金的交易单元。选择租用证券公司基金交易单元的选择标准如下:

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

3、基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据对券商交易单元的选择标准并结合对券商研究服务工作的评分结果，确定选用交易单元的所属券商；

(2) 由研发策略部负责交易席位的租用、调整分配、退租等管理工作，交易席位的租用或退租经公司审批后执行。

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 (%)
德邦证券	535,860.48	76.09	3,000,000.00	100.00	-	-
海通证券	168,373.40	23.91	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
2	东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 31 日
3	东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 04 月 21 日
4	东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增上海长量基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 25 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祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- 2、《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.donghaifunds.com](http://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

2023 年 8 月 31 日