

东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 26 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
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	47
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	47
§ 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	49
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	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 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	10,672,167.62 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	10,159,031.98 份	513,135.64 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；（二）数字经济主题的界定及投资策略；（三）股票投资策略：1、相关子行业的配置策略 2、个股精选策略 3、存托凭证投资策略；（四）债券投资策略：1、普通债券投资策略 2、可转换债券投资策略 3、可交换债券投资策略 4、息差策略；（五）资产支持证券投资策略；（六）金融衍生品投资策略：1、股指期货交易策略 2、国债期货交易策略 3、股票期权投资策略。
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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 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
本期已实现收益	114,618.62	17,948.03
本期利润	-435,478.50	11,515.27
加权平均基金份 额本期利润	-0.0430	0.0348
本期加权平均净 值利润率	-4.21%	3.44%
本期基金份额净 值增长率	-4.19%	-4.38%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-575,227.88	-33,161.47
期末可供分配基 金份额利润	-0.0566	-0.0646

期末基金资产净值	9,931,955.01	497,542.85
期末基金份额净值	0.9776	0.9696
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-2.24%	-3.04%

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
过去一个月	4.51%	1.31%	3.90%	0.88%	0.61%	0.43%
过去三个月	-4.75%	1.53%	-0.56%	1.25%	-4.19%	0.28%
过去六个月	-4.19%	1.72%	0.42%	1.43%	-4.61%	0.29%
过去一年	10.21%	2.12%	35.46%	1.90%	-25.25%	0.22%
自基金合同生效起至今	-2.24%	1.79%	10.48%	1.60%	-12.72%	0.19%

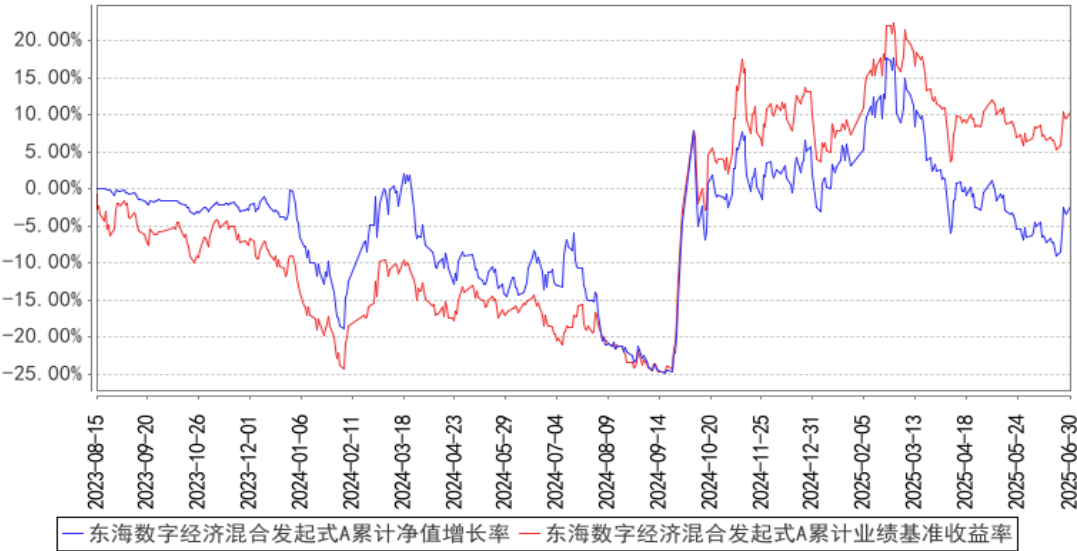
东海数字经济混合发起式 C

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
过去一个月	4.48%	1.31%	3.90%	0.88%	0.58%	0.43%
过去三个月	-4.85%	1.53%	-0.56%	1.25%	-4.29%	0.28%
过去六个月	-4.38%	1.72%	0.42%	1.43%	-4.80%	0.29%

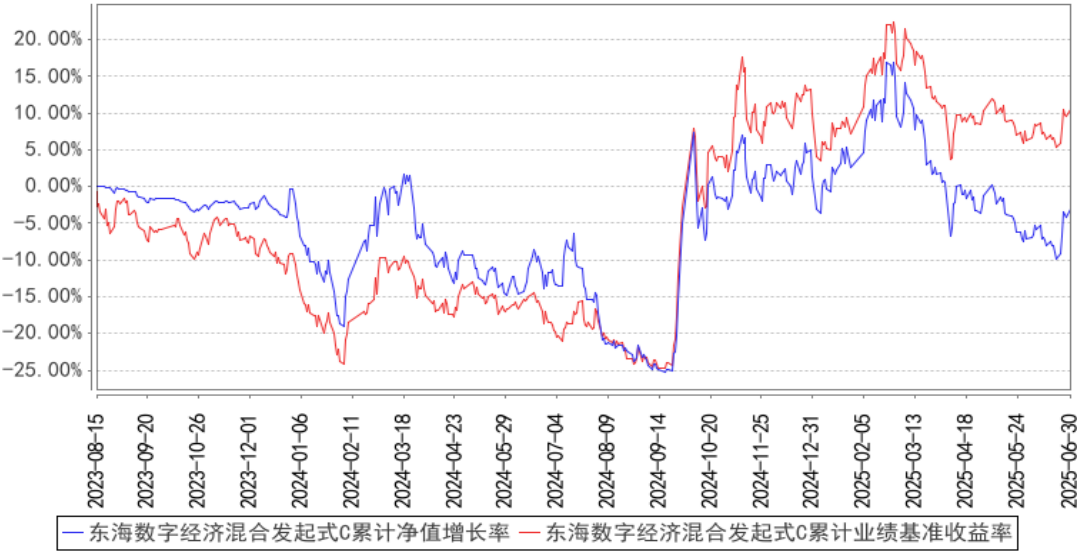
过去一年	9.78%	2.12%	35.46%	1.90%	— 25.68%	0.22%
自基金合同生效 起至今	-3.04%	1.79%	10.48%	1.60%	— 13.52%	0.19%

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



3.3 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，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 22 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 日至 2025 年 6 月 5 日担任东海核心价值精选混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 9 月 6 日起担任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；2025 年 8

					月 11 日起担任东海产业优选混合型发起式证券投资基金的基金经理。
王亦琛	本基金的基金经理	2023 年 8 月 22 日	-	6 年	国籍：中国。伦敦大学学院金融系统工程硕士。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 日至 2025 年 8 月 11 日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 日至 2025 年 8 月 11 日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；

（3）根据本基金管理人发布的基金经理变更公告，自 2025 年 8 月 12 日起，王亦琛先生不再担任本基金的基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2025 年上半年，A 股市场在全球流动性边际收紧与国内产业升级共振的环境下，呈现结构性分化特征。科技板块延续高景气度，人工智能作为“新质生产力”的核心载体，其技术迭代与产业化进程显著加速，成为驱动市场风险偏好的关键引擎。本基金重点聚焦 AI 产业链中技术壁垒高、边际变化大的环节，在选股中融入质量成长核心因子，形成对国产算力芯片和先进制程建设、金融科技以及 AI 应用方向的超配布局。

全球 AI 算力需求的爆发式增长与地缘政治驱动下，国产算力芯片进入“自主可控 + 生态融合”的黄金发展期：

随着通用算力与专用算力架构的持续演进，国产芯片在存算一体、能效优化等关键技术领域取得实质性进展，推动算力基础设施从单一依赖海外供应链向自主创新体系转型。国家战略明确

提升关键领域算力自主供给能力，叠加金融、能源、政务等行业国产化替代加速，国产算力芯片在规模化应用场景中实现从“可用”到“好用”的跨越，市场渗透率进入快速提升阶段。从芯片设计、晶圆制造到封装测试的全产业链技术协同不断加强，存储配套、散热方案等关联环节同步突破，形成具有自主知识产权的算力技术闭环，推动国产算力基础设施整体效能显著提升。

与此同时，在 AI 应用领域，金融科技正在从 AI 辅助工具升级为业务必需基础设施：随着金融业务线上化率提升，基于 AI 的实时风险监测、反欺诈识别等技术成为防范系统性风险的核心手段，推动金融机构风控架构从规则驱动向数据智能驱动全面升级。资管投研的智能化变革也在逐步加速，AI 技术在海量数据处理、市场规律挖掘等方面的优势，促使智能投研平台覆盖范围不断扩展，从基础数据整合向策略生成、组合优化等核心环节延伸，重构金融机构投研决策范式。

跨境金融、普惠金融等业务场景的复杂化，对交易监测、合规审查的实时性与精准度提出更高要求，AI 驱动的智能合规系统实现监管规则自动化解析与业务流程无缝嵌入，成为金融科技领域增长最快的细分方向。

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，同时结合优质成长因子评估标的资产的业绩释放进程，均衡配置了相关细分方向。我们认为，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优质成长企业。

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 0.9776 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.19%；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 0.9696 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.38%；业绩比较基准收益率为 0.42%。

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 年下半年，数字经济将在 AI 技术的驱动下进入“算力筑基、应用爆发”的新阶段，优质成长因子的筛选作用将更加突出。国产算力芯片领域，随着先进制程突破与生态适配完善，市场渗透率有望快速提升，具备技术领先性与成本控制能力、订单增速快的企业将成为自主可控战略的核心抓手；金融科技领域，AI 在风控、投研、合规中的深度应用将重构行业效率，具备场景数据优势与算法能力、客户拓展速度快的企业或将领跑；AI 应用领域，端侧 AI、行业大模型的商业化落地可能催生“爆款”场景，推动技术价值向业绩转化，研发迭代效率高、商业化能力强的企业更易脱颖而出。本基金将继续聚焦 AI 产业链的核心环节，通过优质成长因子精选高成长标的，把握数字经济的长期投资机遇。

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，故本报告期内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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东海数字经济混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	607,953.80	1,645,621.08
结算备付金		29,985.70	44,676.10
存出保证金		19,396.61	15,896.91
交易性金融资产	6.4.7.2	9,884,666.42	8,920,455.00
其中：股票投资		9,783,769.10	8,920,455.00
基金投资		-	-
债券投资		100,897.32	-
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		-	486,132.84
应收股利		-	-
应收申购款		7,544.29	28,010.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		10,549,546.82	11,140,792.81
负债和净资产			
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		74,390.04	-
应付赎回款		3,317.90	40,664.91

应付管理人报酬		9,757.45	11,524.12
应付托管费		1,626.23	1,920.67
应付销售服务费		123.26	283.03
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	30,834.08	35,730.70
负债合计		120,048.96	90,123.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	10,672,167.62	10,834,445.32
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-242,669.76	216,224.06
净资产合计		10,429,497.86	11,050,669.38
负债和净资产总计		10,549,546.82	11,140,792.81

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，东海数字经济混合发起式 A 基金份额净值 0.9776 元，基金份额总额 10,159,031.98 份；东海数字经济混合发起式 C 基金份额净值 0.9696 元，基金份额总额 513,135.64 份；东海数字经济混合发起式分级总额合计为 10,672,167.62 份。

6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-345,165.21	-1,067,311.34
1. 利息收入		2,697.68	4,179.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,697.68	4,179.76
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）		205,771.03	-1,155,017.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	179,086.63	-1,239,446.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-212.24	-
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	26,896.64	84,429.10
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	-556,529.88	82,862.66
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	2,895.96	663.81
减：二、营业总支出		78,798.02	73,391.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	63,444.50	55,724.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,574.05	9,287.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	667.89	117.63
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	4,111.58	8,262.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-423,963.23	-1,140,703.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-423,963.23	-1,140,703.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-423,963.23	-1,140,703.15

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	10,834,445.32	-	216,224.06	11,050,669.38

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,834,445.32	-	216,224.06	11,050,669.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-162,277.70	-	-458,893.82	-621,171.52
(一)、综合收益总额	-	-	-423,963.23	-423,963.23
(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)	-162,277.70	-	-34,930.59	-197,208.29
其中：1. 基金申购款	939,503.44	-	5,800.39	945,303.83
2. 基金赎回款	-1,101,781.14	-	-40,730.98	-1,142,512.12
(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	10,672,167.62	-	-242,669.76	10,429,497.86
项目	上年度可比期间			
	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	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	10,280,081.11	-	-25,423.78	10,254,657.33

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	38,166.18	-	-1,140,333.94	-1,102,167.76
(一)、综合收益总额	-	-	-1,140,703.15	-1,140,703.15
(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)	38,166.18	-	369.21	38,535.39
其中：1. 基金申购款	360,793.18	-	-28,832.80	331,960.38
2. 基金赎回款	-322,627.00	-	29,202.01	-293,424.99
(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	10,318,247.29	-	-1,165,757.72	9,152,489.57

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>宗华俊</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、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%。

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 2025 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 2025

年 06 月 30 日财务状况以及 2025 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》、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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	607,953.80
等于：本金	607,892.29
加：应计利息	61.51
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	607,953.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,457,834.28	-	9,783,769.10	325,934.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	99,982.00	907.32	100,897.32	8.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	99,982.00	907.32	100,897.32	8.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,557,816.28	907.32	9,884,666.42	325,942.82

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 2025 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	20,362.50
其中：交易所市场	20,362.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费用	10,471.58
合计	30,834.08

6.4.7.10 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,170,179.61	10,170,179.61
本期申购	141,858.63	141,858.63
本期赎回（以“-”号填列）	-153,006.26	-153,006.26
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	10,159,031.98	10,159,031.98

东海数字经济混合发起式 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	664,265.71	664,265.71
本期申购	797,644.81	797,644.81
本期赎回（以“-”号填列）	-948,774.88	-948,774.88
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	513,135.64	513,135.64

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

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	-688,779.27	895,701.70	206,922.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-688,779.27	895,701.70	206,922.43
本期利润	114,618.62	-550,097.12	-435,478.50
本期基金份额交易产生的变动数	-1,067.23	2,546.33	1,479.10
其中：基金申购款	-3,032.62	7,341.69	4,309.07
基金赎回款	1,965.39	-4,795.36	-2,829.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-575,227.88	348,150.91	-227,076.97

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	-48,952.44	58,254.07	9,301.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-48,952.44	58,254.07	9,301.63
本期利润	17,948.03	-6,432.76	11,515.27
本期基金份额交易产生的变动数	-2,157.06	-34,252.63	-36,409.69
其中：基金申购款	-27,950.40	29,441.72	1,491.32
基金赎回款	25,793.34	-63,694.35	-37,901.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-33,161.47	17,568.68	-15,592.79

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,526.68
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	141.20
其他	29.80
合计	2,697.68

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	179,086.63
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	179,086.63

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	56,235,398.41
减：卖出股票成本总额	55,965,463.59
减：交易费用	90,848.19
买卖股票差价收入	179,086.63

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 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	282.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-495.00
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	-212.24

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	604,718.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	600,440.00
减：应计利息总额	4,773.03
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-495.00

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	26,896.64
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	26,896.64

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-556,529.88
股票投资	-556,537.88
债券投资	8.00
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	-556,529.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,895.96
合计	2,895.96

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	3,471.58
信息披露费	—
证券出借违约金	—
银行汇划费	640.00
合计	4,111.58

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
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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	14,972,696.80	13.18	252,355,193.56	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	6,975.74	12.58	6,975.74	34.26
关联方名称	上年度可比期间 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	188,011.85	100.00	54,782.07	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。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	63,444.50	55,724.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,155.53	559.45
应支付基金管理人的净管理费	62,288.97	55,165.26

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,574.05	9,287.43

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：

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

6.4.10.2.3 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。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	10,001,050.11	98.44	10,001,050.11	98.34

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
兴业银行	607,953.80	2,526.68	1,114,092.11	2,673.33

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。

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（2025 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 2025 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 2025 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 2025 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 2025 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 2025 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。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	100,897.32	-
合计	100,897.32	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债。

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均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均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均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均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均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公司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货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	607,953.80	-	-	-	-	-	607,953.80
结算备付金	29,985.70	-	-	-	-	-	29,985.70
存出保证金	19,396.61	-	-	-	-	-	19,396.61
交易性金融资产	-	-	100,897.32	-	-	9,783,769.10	9,884,666.42
应收申购款	-	-	-	-	-	7,544.29	7,544.29
资产总计	657,336.11	-	100,897.32	-	-	9,791,313.39	10,549,546.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,317.90	3,317.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,757.45	9,757.45
应付托管费	-	-	-	-	-	1,626.23	1,626.23
应付清算款	-	-	-	-	-	74,390.04	74,390.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	123.26	123.26
其他负债	-	-	-	-	-	30,834.08	30,834.08
负债总计	-	-	-	-	-	120,048.96	120,048.96
利率敏感度缺口	657,336.11	-	100,897.32	-	-	9,671,264.43	10,429,497.86
上年度末 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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末持有交易性债券投资公允价值占基金净值比例为 0.97%（上年度末：0.00%），持有的货币资金、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。

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

其他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，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	9,783,769.10	93.81	8,920,455.00	80.72
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	9,783,769.10	93.81	8,920,455.00	80.72

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。	
	对资产负债表日基金资产净值的	

分析	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 1%	113,695.64	92,397.30
	业绩比较基准减少 1%	-113,695.64	-92,397.30

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	9,783,769.10	8,920,455.00
第二层次	100,897.32	-
第三层次	-	-
合计	9,884,666.42	8,920,455.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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。(2024 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	9,783,769.10	92.74
	其中：股票	9,783,769.10	92.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,897.32	0.96
	其中：债券	100,897.32	0.96
	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	637,939.50	6.05
8	其他各项资产	26,940.90	0.26
9	合计	10,549,546.82	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	-	-
C	制造业	5,384,152.10	51.62

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	2,953,434.00	28.32
J	金融业	1,446,183.00	13.87
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	9,783,769.10	93.81

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	300059	东方财富	28,000	647,640.00	6.21
2	688981	中芯国际	7,000	617,190.00	5.92
3	688041	海光信息	3,500	494,515.00	4.74
4	688256	寒武纪	800	481,200.00	4.61
5	300803	指南针	5,500	443,630.00	4.25
6	002371	北方华创	1,000	442,210.00	4.24
7	300124	汇川技术	6,000	387,420.00	3.71
8	300033	同花顺	1,300	354,913.00	3.40
9	603019	中科曙光	4,800	337,920.00	3.24
10	300738	奥飞数据	16,000	334,880.00	3.21
11	688012	中微公司	1,800	328,140.00	3.15
12	688008	澜起科技	3,900	319,800.00	3.07
13	600570	恒生电子	8,400	281,736.00	2.70
14	002230	科大讯飞	5,500	263,340.00	2.52
15	300857	协创数据	3,000	258,180.00	2.48
16	603986	兆易创新	2,000	253,060.00	2.43

17	688111	XD 金山办	800	224,040.00	2.15
18	603296	华勤技术	2,000	161,360.00	1.55
19	300339	润和软件	2,800	142,324.00	1.36
20	603501	豪威集团	1,100	140,415.00	1.35
21	300687	赛意信息	5,000	138,900.00	1.33
22	688318	财富趋势	1,200	137,904.00	1.32
23	688082	盛美上海	1,200	136,728.00	1.31
24	300454	深信服	1,400	131,852.00	1.26
25	002049	紫光国微	2,000	131,720.00	1.26
26	301269	华大九天	1,000	123,880.00	1.19
27	688072	拓荆科技	800	122,968.00	1.18
28	600588	用友网络	9,000	120,330.00	1.15
29	000066	中国长城	8,000	118,400.00	1.14
30	688521	芯原股份	1,200	115,800.00	1.11
31	000938	紫光股份	4,500	107,955.00	1.04
32	301308	江波龙	1,200	104,988.00	1.01
33	300661	圣邦股份	1,430	104,061.10	1.00
34	002920	德赛西威	1,000	102,130.00	0.98
35	000977	浪潮信息	2,000	101,760.00	0.98
36	600536	中国软件	2,000	93,540.00	0.90
37	300378	鼎捷数智	2,500	91,500.00	0.88
38	688777	中控技术	2,000	89,820.00	0.86
39	600699	均胜电子	5,000	87,200.00	0.84
40	688502	茂莱光学	300	86,298.00	0.83
41	688126	沪硅产业	4,500	84,240.00	0.81
42	688047	龙芯中科	600	80,034.00	0.77
43	002236	大华股份	5,000	79,400.00	0.76
44	688220	翱捷科技	1,000	78,300.00	0.75
45	603893	瑞芯微	500	75,930.00	0.73
46	300496	中科创达	1,100	62,942.00	0.60
47	300442	润泽科技	1,200	59,436.00	0.57
48	688568	中科星图	1,000	36,010.00	0.35
49	002065	东华软件	2,500	24,000.00	0.23
50	688728	格科微	1,400	21,560.00	0.21
51	688249	晶合集成	1,000	20,270.00	0.19

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	688608	恒玄科技	1,758,859.16	15.92
2	300033	同花顺	1,719,848.00	15.56
3	300738	奥飞数据	1,634,589.00	14.79

4	688981	中芯国际	1,606,196.76	14.53
5	300442	润泽科技	1,379,605.00	12.48
6	603728	鸣志电器	1,135,036.00	10.27
7	600536	中国软件	1,059,353.00	9.59
8	688012	中微公司	1,048,584.31	9.49
9	688521	芯原股份	1,044,482.96	9.45
10	300803	指南针	890,806.00	8.06
11	300124	汇川技术	865,606.00	7.83
12	688111	XD 金山办	856,943.89	7.75
13	688017	绿的谐波	843,414.22	7.63
14	300059	东方财富	820,916.00	7.43
15	002371	北方华创	785,370.00	7.11
16	688041	海光信息	784,830.17	7.10
17	000066	中国长城	769,698.00	6.97
18	688279	峰昭科技	759,893.92	6.88
19	300253	卫宁健康	746,200.00	6.75
20	603019	中科曙光	736,777.00	6.67
21	300661	圣邦股份	726,955.00	6.58
22	601728	中国电信	688,300.00	6.23
23	301269	华大九天	679,796.00	6.15
24	002335	科华数据	676,279.00	6.12
25	300454	深信服	650,419.00	5.89
26	688018	乐鑫科技	631,420.08	5.71
27	300383	光环新网	615,805.00	5.57
28	688256	寒武纪	613,519.70	5.55
29	300339	润和软件	587,975.00	5.32
30	603893	瑞芯微	572,306.00	5.18
31	603501	豪威集团	560,687.00	5.07
32	600588	用友网络	556,346.00	5.03
33	600570	恒生电子	551,013.00	4.99
34	301236	软通动力	545,812.00	4.94
35	000063	中兴通讯	543,957.00	4.92
36	688322	奥比中光	530,599.16	4.80
37	300377	赢时胜	526,880.00	4.77
38	300007	汉威科技	525,711.00	4.76
39	301308	江波龙	514,347.00	4.65
40	688047	龙芯中科	502,814.00	4.55
41	688536	思瑞浦	491,083.25	4.44
42	000938	紫光股份	479,820.00	4.34
43	003021	兆威机电	477,143.00	4.32
44	002230	科大讯飞	460,306.00	4.17
45	688800	瑞可达	448,627.51	4.06
46	688008	澜起科技	447,264.96	4.05

47	000997	新大陆	435,427.00	3.94
48	002410	广联达	435,138.00	3.94
49	002415	海康威视	431,488.00	3.90
50	688318	财富趋势	395,325.86	3.58
51	600941	中国移动	389,053.00	3.52
52	300570	太辰光	376,817.00	3.41
53	603986	兆易创新	375,325.00	3.40
54	000977	浪潮信息	367,940.00	3.33
55	300782	卓胜微	358,889.00	3.25
56	300133	华策影视	358,063.00	3.24
57	300857	协创数据	334,093.00	3.02
58	600845	宝信软件	330,401.00	2.99
59	300687	赛意信息	323,354.00	2.93
60	300364	中文在线	322,807.00	2.92
61	603063	禾望电气	321,880.00	2.91
62	002222	福晶科技	316,511.00	2.86
63	600183	生益科技	305,541.00	2.76
64	002624	完美世界	296,780.00	2.69
65	002605	姚记科技	295,900.00	2.68
66	002049	紫光国微	291,765.00	2.64
67	002851	麦格米特	287,448.00	2.60
68	002929	润建股份	286,536.00	2.59
69	603583	捷昌驱动	285,303.00	2.58
70	002649	博彦科技	280,588.00	2.54
71	002236	大华股份	272,520.00	2.47
72	603000	人民网	267,000.00	2.42
73	688072	拓荆科技	264,434.62	2.39
74	300433	蓝思科技	257,640.00	2.33
75	300058	蓝色光标	252,065.00	2.28
76	600699	均胜电子	251,463.00	2.28
77	002065	东华软件	228,200.00	2.07
78	300666	江丰电子	227,078.00	2.05
79	000681	视觉中国	224,850.00	2.03
80	002920	德赛西威	221,380.00	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	688608	恒玄科技	2,090,783.07	18.92
2	300033	同花顺	1,901,334.00	17.21
3	601728	中国电信	1,347,350.00	12.19
4	300442	润泽科技	1,205,970.00	10.91

5	300738	奥飞数据	1,194,379.00	10.81
6	603728	鸣志电器	1,103,150.00	9.98
7	603893	瑞芯微	1,068,699.00	9.67
8	600536	中国软件	990,995.00	8.97
9	688012	中微公司	986,512.45	8.93
10	688111	XD 金山办	969,827.29	8.78
11	688981	中芯国际	956,717.80	8.66
12	688521	芯原股份	906,584.00	8.20
13	688256	寒武纪	895,804.00	8.11
14	688041	海光信息	855,021.25	7.74
15	688017	绿的谐波	804,593.50	7.28
16	688279	峰昭科技	723,039.70	6.54
17	300253	卫宁健康	723,000.00	6.54
18	300661	圣邦股份	643,110.00	5.82
19	000066	中国长城	630,570.00	5.71
20	002335	科华数据	621,175.00	5.62
21	688018	乐鑫科技	607,783.44	5.50
22	603986	兆易创新	604,882.00	5.47
23	301269	华大九天	585,108.00	5.29
24	300454	深信服	563,571.00	5.10
25	300383	光环新网	561,715.00	5.08
26	002475	立讯精密	552,847.00	5.00
27	300803	指南针	532,609.00	4.82
28	300007	汉威科技	514,491.00	4.66
29	000063	中兴通讯	513,737.00	4.65
30	301236	软通动力	498,495.00	4.51
31	688536	思瑞浦	490,588.00	4.44
32	688322	奥比中光	483,854.66	4.38
33	688800	瑞可达	479,076.00	4.34
34	300339	润和软件	478,878.00	4.33
35	300124	汇川技术	471,243.00	4.26
36	603296	华勤技术	464,652.00	4.20
37	000997	新大陆	456,245.00	4.13
38	003021	兆威机电	452,510.00	4.09
39	300377	赢时胜	450,831.00	4.08
40	603501	豪威集团	440,701.00	3.99
41	300570	太辰光	436,800.00	3.95
42	688385	复旦微电	433,880.00	3.93
43	000725	京东方 A	428,638.00	3.88
44	600588	用友网络	423,808.00	3.84
45	002410	广联达	422,225.00	3.82
46	002415	海康威视	412,977.00	3.74
47	688047	龙芯中科	406,820.00	3.68

48	603019	中科曙光	397,185.00	3.59
49	301308	江波龙	396,314.00	3.59
50	002371	北方华创	384,168.00	3.48
51	300433	蓝思科技	383,511.00	3.47
52	600941	中国移动	376,660.00	3.41
53	300133	华策影视	375,609.00	3.40
54	002241	歌尔股份	374,843.00	3.39
55	000938	紫光股份	368,525.00	3.33
56	300866	安克创新	361,287.00	3.27
57	300782	卓胜微	357,411.00	3.23
58	300364	中文在线	353,366.00	3.20
59	600570	恒生电子	351,925.00	3.18
60	002222	福晶科技	339,437.00	3.07
61	600845	宝信软件	326,578.00	2.96
62	002624	完美世界	325,082.00	2.94
63	600563	法拉电子	321,757.00	2.91
64	688232	新点软件	304,879.17	2.76
65	603063	禾望电气	301,319.00	2.73
66	600707	彩虹股份	299,260.00	2.71
67	603583	捷昌驱动	293,375.00	2.65
68	600183	生益科技	291,572.00	2.64
69	002929	润建股份	290,518.00	2.63
70	300709	精研科技	283,739.00	2.57
71	002517	恺英网络	282,937.00	2.56
72	002649	博彦科技	278,382.00	2.52
73	688318	财富趋势	273,139.00	2.47
74	002605	姚记科技	271,575.00	2.46
75	002851	麦格米特	267,966.00	2.42
76	000977	浪潮信息	265,576.00	2.40
77	603000	人民网	264,000.00	2.39
78	002065	东华软件	247,410.00	2.24
79	002987	京北方	240,150.00	2.17
80	300674	宇信科技	236,366.00	2.14
81	300666	江丰电子	235,564.00	2.13
82	300058	蓝色光标	233,500.00	2.11
83	605111	新洁能	222,600.00	2.01
84	688588	凌志软件	222,292.00	2.01

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	57,385,315.57
卖出股票收入（成交）总额	56,235,398.41

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	100,897.32	0.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,897.32	0.97

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	019758	24 国债 21	1,000	100,897.32	0.97

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本报告期内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。

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	19,396.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,544.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,940.90

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

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	113	89,902.94	10,001,050.11	98.44	157,981.87	1.56

发起式 A						
东海数字经济混合发起式 C	420	1,221.75	0.00	0.00	513,135.64	100.00
合计	533	20,022.83	10,001,050.11	93.71	671,117.51	6.29

8.2 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	17,763.52	0.1749
	东海数字经济混合发起式 C	310.01	0.0604
	合计	18,073.53	0.1694

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）。

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	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

8.4 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	93.71	10,001,050.11	93.71	不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,050.11	93.71	10,001,050.11	93.71	不少于 3 年

§ 9 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) 基金份额总额	10,159,084.11	111,635.85
本报告期期初基金份额总额	10,170,179.61	664,265.71
本报告期基金总申购份额	141,858.63	797,644.81
减：本报告期基金总赎回份额	153,006.26	948,774.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	10,159,031.98	513,135.64

§ 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

- 基金管理人 2025 年 4 月 30 日发布公告，袁忠先生自 2025 年 4 月 29 日起担任基金管理人董事长，杨明先生自 2025 年 4 月 29 日起不再担任基金管理人董事长。
- 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，为容诚会计师事务所（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

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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 (%)	
广发证券	1	52,261,384.81	46.00	24,348.53	43.91	-
国海证券	2	46,386,632.37	40.83	24,121.48	43.50	-
东海证券	2	14,972,696.80	13.18	6,975.74	12.58	-

注：1、本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

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。

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(%)
广发证券	1,300,367.00	100.00	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
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	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 21 日
2	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增上海云湾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	2025 年 2 月 15 日
3	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	2025 年 3 月 8 日
4	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务及转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 14 日
5	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 14 日
6	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 29 日
7	东海基金管理有限责任公司关于旗	中国证监会指定报刊及	2025 年 4 月 11 日

	下部分基金新增中信建投证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务、转换业务及参加费率优惠的公告	网站	
8	东海数字经济混合型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 21 日
9	东海基金管理有限责任公司董事长变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 30 日
10	东海数字经济混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 27 日
11	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）2025 年第 1 号	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 27 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

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	2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日	10,001,050.11	0.00	0.00	10,001,050.11	93.71
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。							

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。

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

2025 年 8 月 30 日