

# 东海祥苏短债债券型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

<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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人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 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
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	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.11	投资组合报告附注	46
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>46</b>
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
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>47</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>48</b>
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	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	50
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>51</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	51
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	51
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>51</b>
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	东海祥苏短债债券型证券投资基金		
基金简称	东海祥苏短债		
基金主代码	008578		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020年3月12日		
基金管理人	东海基金管理有限责任公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,080,837,053.85份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	东海祥苏短债 A	东海祥苏短债 C	东海祥苏短债 E
下属分级基金的交易代码	008578	008579	015499
报告期末下属分级基金的份额总额	1,710,686,565.62份	379,343,924.87份	1,990,806,563.36份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在保持投资组合较高流动性的前提下，获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征的前提下，实现风险与收益的合理配比。将采取多种策略进行债券资产的组合投资管理，为投资者提供稳定的投资回报。
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率*80%+银行活期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	牛锐	方圆
	联系电话	021-60586900	95559
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-9595531	95559
传真		021-60586926	021-62701216
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200122	200336

法定代表人	严晓璐	任德奇
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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)		
	东海祥苏短债 A	东海祥苏短债 C	东海祥苏短债 E
本期已实现收益	31,889,193.43	5,790,457.39	47,258,175.33
本期利润	30,154,450.22	5,341,853.79	45,103,733.51
加权平均基金份额本期利润	0.0178	0.0160	0.0166
本期加权平均净值利润率	1.57%	1.42%	1.55%
本期基金份额净值增长率	1.60%	1.49%	1.54%
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	212,798,628.12	43,586,288.88	147,791,566.19
期末可供分配基金份额利润	0.1244	0.1149	0.0742
期末基金资产净值	1,949,154,086.03	428,601,834.48	2,148,130,660.34
期末基金份额净值	1.1394	1.1299	1.0790
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	13.94%	12.99%	7.90%

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 2020 年 03 月 12 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

东海祥苏短债 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	0.18%	0.01%	0.16%	0.01%	0.02%	0.00%
过去三个月	0.63%	0.01%	0.51%	0.01%	0.12%	0.00%
过去六个月	1.60%	0.01%	1.10%	0.01%	0.50%	0.00%
过去一年	3.59%	0.01%	2.07%	0.01%	1.52%	0.00%
过去三年	12.77%	0.02%	6.42%	0.01%	6.35%	0.01%
自基金合同生效起至今	13.94%	0.04%	9.32%	0.01%	4.62%	0.03%

东海祥苏短债 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

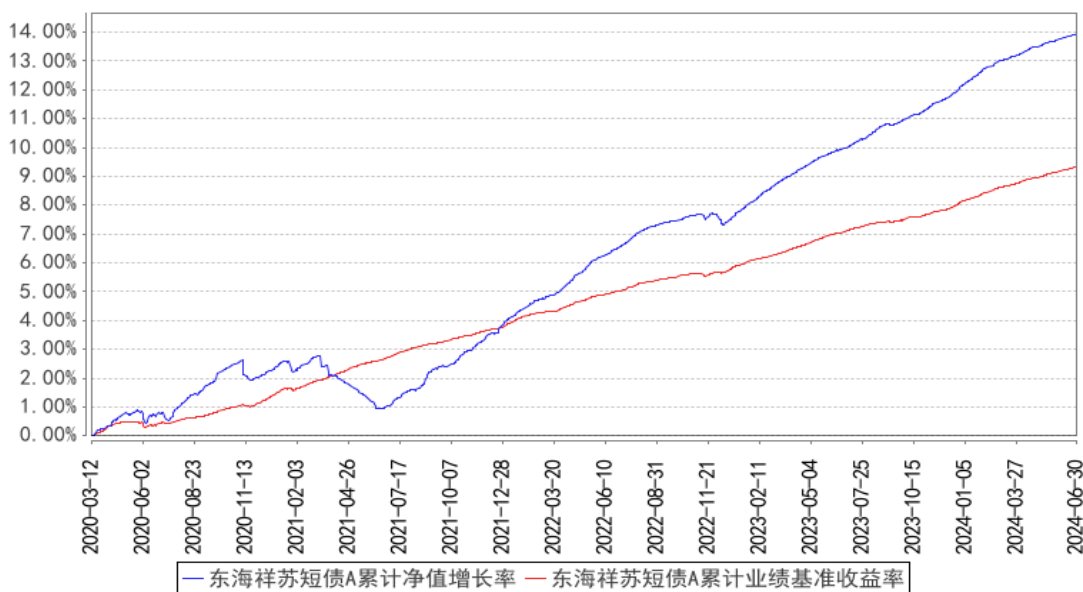
	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.16%	0.01%	0.16%	0.01%	0.00%	0.00%
过去三个月	0.57%	0.01%	0.51%	0.01%	0.06%	0.00%
过去六个月	1.49%	0.01%	1.10%	0.01%	0.39%	0.00%
过去一年	3.38%	0.01%	2.07%	0.01%	1.31%	0.00%
过去三年	12.10%	0.02%	6.42%	0.01%	5.68%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.99%	0.04%	9.32%	0.01%	3.67%	0.03%

东海祥苏短债 E

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	0.17%	0.01%	0.16%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三个月	0.60%	0.01%	0.51%	0.01%	0.09%	0.00%
过去六个月	1.54%	0.01%	1.10%	0.01%	0.44%	0.00%
过去一年	3.48%	0.01%	2.07%	0.01%	1.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.90%	0.02%	4.64%	0.01%	3.26%	0.01%

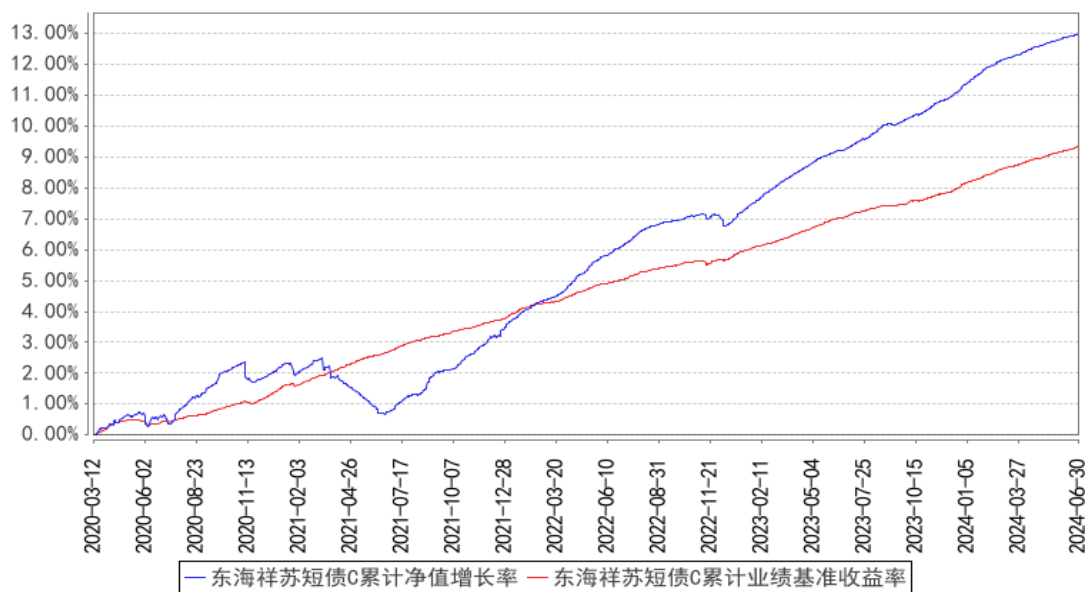
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东海祥苏短债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

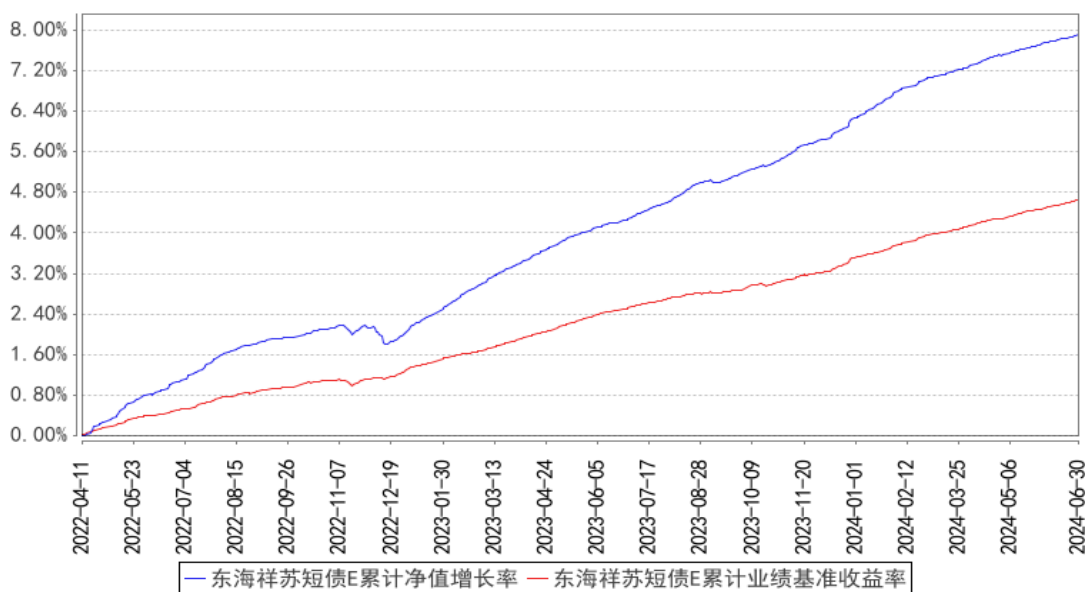




东海祥苏短债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东海祥苏短债E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，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		
邢焯	本基金的基金经理、公募固收投资总监	2021 年 4 月 16 日	-	12 年	国籍：中国。金融硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任职于德邦证券股份有限公司资产管理总部，先后担任交易员、投资经理、投资副总监等职务，主要负责固定收益投资、交易等工作。2020 年 7 月加入东海基金管理有限责任公司，现任公司公募固收投资总监，2021 年 3 月 5 日起担任东海祥泰三年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 4 月 16 日起担任东海祥苏短债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月 15 日起担任东海祥利纯债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 19 日起担任东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月 13 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 8 月 12 日起担任东海鑫宁利率债三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 7 月 18 日起担任东海中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，2023 年 3 月 17 日至 2024 年 4 月 17 日担任东海鑫乐一

					年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
张浩 硕	本基金的 基金经理	2022 年 3 月 14 日	-	7 年	国籍：中国。金融工程硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任职于上海新世纪资信评估投资服务有限公司，担任信用分析师职位。2018 年 12 月加入东海基金，现任资产配置部基金经理。2022 年 3 月 9 日起担任东海祥瑞债券型证券投资基金和东海祥泰三年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2022 年 3 月 14 日起担任东海祥苏短债债券型证券投资基金和东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月 17 日起担任东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2023 年 7 月 12 日起任东海美丽中国灵活配置混合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。

#### 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，债券市场总体走强。报告期内，10 年期国债收益率最低为 2.21%，最高为 2.56%，至报告期末收于 2.21%，较上年度末下行 35BP；一年期 AA+ 中短期票据收益率最低为 2.11%，最高为 2.65%，至报告期末收于 2.12%，较上年度末下行 51BP。

市场节奏方面，上半年我国经济延续复苏态势，但总体动能不强，主要体现为内需不足，债券利率中枢持续下移。一季度，市场预期偏弱，资本市场风险偏好降低，长端和超长端利率明显下行；二季度央行对长端利率提示风险后，长端利率下行趋势放缓，配置和交易力量推动中短端利率下行幅度更大。债券供需方面，上半年特别国债落地、地方债发行提速，但由于信贷走弱，银行、保险等机构的配置行为向债券倾斜，债券需求总体强于供给。经济政策方面，上半年地产宽松新政落地，政策从地产供需端及金融支持等多角度进行了优化，受此提振，部分城市的楼市活跃度有所提升，目前市场进入实质效果观察期。信用债方面，上半年“化债政策”持续推进，平台新增融资仍受限，信用债供给同比缩量，而银行“手工补息”叫停后，资金持续流入非银机

构，推升了对信用债的需求，供需错位下导致信用利差进一步压缩。

本报告期内，本基金采取了稳健的投资策略，主要配置利率债以及短久期中高等级信用债。在保证流动性的前提下通过适当的杠杆息差策略增厚收益，力争为投资人创造长期稳健的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东海祥苏短债 A 基金份额净值为 1.1394 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.60%；截至本报告期末，东海祥苏短债 C 基金份额净值为 1.1299 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.49%；截至本报告期末，东海祥苏短债 E 基金份额净值为 1.0790 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.54%；业绩比较基准收益率为 1.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济有望延续复苏，但边际趋弱。投资方面，制造业投资改善动能趋弱，下半年可能面临海外需求退潮压力；地产投资仍表现韧性，但融资端受限、新开工下滑及销售趋缓背景下，预计下半年地产投资走弱；基建投资短期趋弱，上半年专项债发行持续滞后，下半年关注财政政策是否提速。消费与出口方面，预计下半年国内消费低速修复，出口增速则可能回落。政策方面，关注政策切换。货币政策方面，鉴于下半年经济边际放缓且存在结构性问题，预计货币政策仍将维持稳健，流动性合理充裕，但是继续全面宽松的空间相对有限。同时，下半年财政政策发力空间相对较大，如果政策重心从“货币”切换到“财政”，则可能对债券市场形成干扰。基于上述对经济基本面和货币政策的判断，我们对下半年国内债市持中性观点。

#### 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 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### § 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，基金托管人在东海祥苏短债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，东海基金管理有限责任公司在东海祥苏短债债券型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由东海基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关东海祥苏短债债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：东海祥苏短债债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,298,891.77	21,841,798.65
结算备付金		313,605.51	919,440.05
存出保证金		33,437.84	12,432.55
交易性金融资产	6.4.7.2	4,138,977,720.05	4,799,183,778.43
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		4,138,977,720.05	4,799,183,778.43
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	357,297,201.51	-
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		52,221,639.34	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,610,023.89	68,218,206.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,567,752,519.91	4,890,175,655.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	430,190,248.22
应付清算款		-	2,601,341.10
应付赎回款		39,163,000.50	57,536,720.30
应付管理人报酬		1,243,087.48	987,800.39
应付托管费		331,490.00	263,413.43
应付销售服务费		292,719.10	226,877.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		637,645.06	707,893.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	197,996.92	306,530.43
负债合计		41,865,939.06	492,820,824.02
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	4,080,837,053.85	4,048,731,899.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	445,049,527.00	348,622,932.06
净资产合计		4,525,886,580.85	4,397,354,831.85
负债和净资产总计		4,567,752,519.91	4,890,175,655.87

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，东海祥苏短债 A 基金份额净值 1.1394 元，基金份额总额 1,710,686,565.62 份；东海祥苏短债 C 基金份额净值 1.1299 元，基金份额总额 379,343,924.87 份；东海祥苏短债 E 基金份额净值 1.0790 元，基金份额总额 1,990,806,563.36 份；东海祥苏短债分级总额合计为 4,080,837,053.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东海祥苏短债债券型证券投资基金

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 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
<b>一、营业总收入</b>		95,032,891.96	48,583,412.71
1. 利息收入		460,191.13	223,174.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	29,579.78	25,668.53
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		430,611.35	197,505.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		98,766,758.92	38,535,278.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	98,766,758.92	38,535,278.61
资产支持证券投资	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	-	-
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	-4,337,788.63	9,745,764.35
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	143,730.54	79,195.33



<b>减：二、营业总支出</b>		14,432,854.44	5,911,832.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,764,203.41	3,030,548.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,070,454.21	808,146.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,913,064.93	620,094.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,137,491.83	1,073,183.62
其中：卖出回购金融资产支出		2,137,491.83	1,073,183.62
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		453,330.46	167,617.69
8. 其他费用	6.4.7.23	94,309.60	212,242.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		80,600,037.52	42,671,580.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		80,600,037.52	42,671,580.28
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		80,600,037.52	42,671,580.28

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东海祥苏短债债券型证券投资基金

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	4,048,731,899. 79	-	348,622,932.06	4,397,354,831.8 5
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,048,731,899. 79	-	348,622,932.06	4,397,354,831.8 5
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	32,105,154.06	-	96,426,594.94	128,531,749.00
(一)、综合收益	-	-	80,600,037.52	80,600,037.52

总额				
(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)	32,105,154.06	-	15,826,557.42	47,931,711.48
其中: 1. 基金申购款	8,120,544,360.00	-	718,627,181.82	8,839,171,541.82
2. 基金赎回款	- 8,088,439,205.94	-	- 702,800,624.40	- 8,791,239,830.34
(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	4,080,837,053.85	-	445,049,527.00	4,525,886,580.85
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	649,739,377.64	-	41,451,985.09	691,191,362.73
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	649,739,377.64	-	41,451,985.09	691,191,362.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,342,336,199.37	-	103,766,470.71	1,446,102,670.08
(一)、综合收益总额	-	-	42,671,580.28	42,671,580.28
(二)、本期基金	1,342,336,199.37	-	61,094,890.43	1,403,431,089.80

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	37			0
其中：1. 基金申购款	4,041,381,347.07	-	196,359,604.50	4,237,740,951.57
2. 基金赎回款	- 2,699,045,147.70	-	- 135,264,714.07	- 2,834,309,861.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,992,075,577.01	-	145,218,455.80	2,137,294,032.81

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

东海祥苏短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),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[2019]2494号文《关于准予东海祥苏短债债券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《东海祥苏短债债券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2020年3月12日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集规模为2亿份基金份额。本基金的基金管理人为东海基金,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《东海祥苏短债债券型证券投资基金基金合同》和更新的《东海祥苏短债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等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。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。本基金所投资的短期债券是指剩余期限不超过 397 天的债券资产，主要包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准：中债综合财富（1 年以下）指数收益率\*80%+银行活期存款利率（税后）\*20%。

#### 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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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	5,298,891.77
等于：本金	5,298,017.01
加：应计利息	874.76
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	5,298,891.77

##### 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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	206,312,432.08	5,394,206.36	214,045,292.66	2,338,654.22
	银行间市场	3,830,676,722.24	93,545,122.59	3,924,932,427.39	710,582.56
	合计	4,036,989,154.32	98,939,328.95	4,138,977,720.05	3,049,236.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,036,989,154.32	98,939,328.95	4,138,977,720.05	3,049,236.78	

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	357,297,201.51	-
合计	357,297,201.51	-

#### 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	241.62
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	82,870.70
其中：交易所市场	3,392.10
银行间市场	79,478.60
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费用	15,912.26
预提信息披露费	89,672.34
合计	197,996.92

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 东海祥苏短债 A

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	1,436,596,676.11	1,436,596,676.11
本期申购	1,820,892,785.70	1,820,892,785.70
本期赎回（以“-”号填列）	-1,546,802,896.19	-1,546,802,896.19
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	1,710,686,565.62	1,710,686,565.62

##### 东海祥苏短债 C

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	210,305,909.63	210,305,909.63
本期申购	543,359,064.51	543,359,064.51
本期赎回（以“-”号填列）	-374,321,049.27	-374,321,049.27
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	379,343,924.87	379,343,924.87

东海祥苏短债 E

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	2,401,829,314.05	2,401,829,314.05
本期申购	5,756,292,509.79	5,756,292,509.79
本期赎回(以“-”号填列)	-6,167,315,260.48	-6,167,315,260.48
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	1,990,806,563.36	1,990,806,563.36

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

东海祥苏短债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	151,611,099.24	22,873,831.59	174,484,930.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	151,611,099.24	22,873,831.59	174,484,930.83
本期利润	31,889,193.43	-1,734,743.21	30,154,450.22
本期基金份额交易产生的变动数	29,298,335.45	4,529,803.91	33,828,139.36
其中：基金申购款	210,347,845.90	29,543,579.56	239,891,425.46
基金赎回款	-181,049,510.45	-25,013,775.65	-206,063,286.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	212,798,628.12	25,668,892.29	238,467,520.41

东海祥苏短债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,494,260.66	3,335,461.63	23,829,722.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	20,494,260.66	3,335,461.63	23,829,722.29
本期利润	5,790,457.39	-448,603.60	5,341,853.79

本期基金份额交易产生的变动数	17,301,570.83	2,784,762.70	20,086,333.53
其中：基金申购款	57,050,381.37	8,936,015.13	65,986,396.50
基金赎回款	-39,748,810.54	-6,151,252.43	-45,900,062.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,586,288.88	5,671,620.73	49,257,909.61

东海祥苏短债 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,759,942.70	13,548,336.24	150,308,278.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	136,759,942.70	13,548,336.24	150,308,278.94
本期利润	47,258,175.33	-2,154,441.82	45,103,733.51
本期基金份额交易产生的变动数	-36,226,551.84	-1,861,363.63	-38,087,915.47
其中：基金申购款	377,669,657.70	35,079,702.16	412,749,359.86
基金赎回款	-413,896,209.54	-36,941,065.79	-450,837,275.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	147,791,566.19	9,532,530.79	157,324,096.98

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	24,783.48
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	4,600.38
其他	195.92
合计	29,579.78

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

本报告期，本基金无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	162,614,594.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-63,847,835.93
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	98,766,758.92

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,777,675,262.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,528,717,007.48
减：应计利息总额	312,683,735.32
减：交易费用	122,355.76
买卖债券差价收入	-63,847,835.93

##### 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

本报告期，本基金无股利收益。

#### 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	-4,337,788.63
股票投资	-
债券投资	-4,337,788.63
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	-4,337,788.63

#### 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	143,730.54
合计	143,730.54

#### 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	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,600.00
其他	125.00
合计	94,309.60

#### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
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
东海瑞京资产管理(上海)有限公司	基金管理人的子公司

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

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	占当期债券 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例 (%)
东海证券	546,447,505.91	96.50	291,703,228.60	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
东海证券	275,700,000.00	93.87	364,200,000.00	97.85

#### 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	5,464.51	100.00	3,392.10	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 (%)
东海证券	2,917.06	100.00	916.63	100.00

## 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	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
当期发生的基金应支付的管理费	7,764,203.41	3,030,548.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,186,667.54	1,253,611.52
应支付基金管理人的净管理费	4,577,535.87	1,776,936.69

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 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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
当期发生的基金应支付的托管费	2,070,454.21	808,146.14

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东海祥苏短债 A	东海祥苏短债 C	东海祥苏短债 E	合计
东海基金	-	702.33	100,635.37	101,337.70
东海证券	-	414,044.52	-	414,044.52
合计	-	414,746.85	100,635.37	515,382.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东海祥苏短债 A	东海祥苏短债 C	东海祥苏短债 E	合计
东海基金	-	1,957.11	1,233.68	3,190.79

东海证券	-	91,226.91	-	91,226.91
合计	-	93,184.02	1,233.68	94,417.70

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类和 E 类基金份额收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额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。支付销售机构的基金销售服务费按 E 类基金份额前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：

$$C \text{ 类日基金销售服务费} = C \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

$$E \text{ 类日基金销售服务费} = E \text{ 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

#### 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

份额单位：份

东海祥苏短债 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)



东海瑞京资产管理(上海)有限公司	487,764.91	0.03	487,764.91	0.03
------------------	------------	------	------------	------

份额单位：份

东海祥苏短债 C

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东海瑞京资产管理(上海)有限公司	490,773.46	0.13	490,773.46	0.23

份额单位：份

东海祥苏短债 E

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东海证券股份有限公司	188,572,506.13	9.47	188,572,506.13	7.85

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
交通银行	5,298,891.77	24,783.48	447,738.00	19,997.22

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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（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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	104,515,285.24	10,175,644.81
A-1 以下	-	-
未评级	544,589,448.78	1,427,983,083.61
合计	649,104,734.02	1,438,158,728.42

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为短期融资券、超短期融资券。

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,992,260.32
合计	-	9,992,260.32

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,892,425,758.88	944,335,584.47

AAA 以下	381,688,686.74	812,061,962.21
未评级	1,215,758,540.41	1,594,635,243.01
合计	3,489,872,986.03	3,351,032,789.69

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为政策性金融债及无第三方评级机构评级的债券。

#### 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、买入返售金融资产等。

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 202 4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	5,298,891.77	-	-	-	-	-	5,298,891.77
结算备付金	313,605.51	-	-	-	-	-	313,605.51
存出	33,437.84	-	-	-	-	-	33,437.84

保证金						
交易性金融资产	372,261,148.65	1,829,387,433.43	1,463,204,435.98	474,124,701.99	-	4,138,977,720.05
买入返售金融资产	357,297,201.51	-	-	-	-	-357,297,201.51
应收申购款	-	-	-	-	13,610,023.89	13,610,023.89
应收清算款	-	-	-	-	52,221,639.34	52,221,639.34
资产总计	735,204,285.28	1,829,387,433.43	1,463,204,435.98	474,124,701.99	65,831,663.23	4,567,752,519.91
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	39,163,000.50	39,163,000.50
应付管理人报	-	-	-	-	1,243,087.48	1,243,087.48

酬							
应付托管费						331,490.00	331,490.00
应付销售服务费						292,719.10	292,719.10
应交税费						637,645.06	637,645.06
其他负债						197,996.92	197,996.92
负债总计						41,865,939.06	41,865,939.06
利率敏感度缺口	735,204,285.28	1,829,387,433.43	1,463,204,435.98	474,124,701.99		23,965,724.17	4,525,886,580.85
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	21,841,798.6						21,841,798.65

币资金	5					
结算备付金	919,440.05	-	-	-	-	919,440.05
存出保证金	12,432.55	-	-	-	-	12,432.55
交易性金融资产	351,459,870.43	1,064,968,080.70	2,389,240,606.10	993,515,221.20	-	4,799,183,778.43
应收申购款	-	-	-	-	68,218,206.19	68,218,206.19
资产总计	374,233,541.68	1,064,968,080.70	2,389,240,606.10	993,515,221.20	68,218,206.19	4,890,175,655.87
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	57,536,720.30	57,536,720.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	987,800.39	987,800.39
应付	-	-	-	-	263,413.43	263,413.43



托管费						
应付清算款	-	-	-	-	2,601,341.10	2,601,341.10
卖出回购金融资产款	430,190,248.22	-	-	-	-	430,190,248.22
应付销售服务费	-	-	-	-	226,877.15	226,877.15
应交税费	-	-	-	-	707,893.00	707,893.00
其他负债	-	-	-	-	306,530.43	306,530.43
负债总计	430,190,248.22	-	-	-	62,630,575.80	492,820,824.02
利率敏感度缺口	55,956,706.54	1,064,968,080.70	2,389,240,606.10	993,515,221.20	5,587,630.39	4,397,354,831.85

#### 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；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。		
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）
	市场利率下降 25 个基点	4,215,972.45	7,315,774.45
	市场利率上升 25 个基点	-4,200,132.77	-7,282,958.20

#### 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

本报告期末及上年度末，本基金均无其他价格风险敞口。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末及上年度末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

## 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	-	-
第二层次	4,138,977,720.05	4,799,183,778.43
第三层次	-	-
合计	4,138,977,720.05	4,799,183,778.43

#### 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。

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

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,138,977,720.05	90.61
	其中：债券	4,138,977,720.05	90.61
	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	357,297,201.51	7.82
	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	5,612,497.28	0.12
8	其他各项资产	65,865,101.07	1.44
9	合计	4,567,752,519.91	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

本报告期末，本基金未持有股票投资。

#### 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

本报告期末，本基金未持有股票投资。

### 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

本报告期，本基金未持有股票投资。

#### 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

本报告期，本基金未持有股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本报告期，本基金未持有股票投资。

### 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	2,014,656,785.34	44.51
	其中：政策性金融债	470,221,408.88	10.39
4	企业债券	331,381,828.18	7.32
5	企业短期融资券	649,104,734.02	14.34
6	中期票据	1,143,834,372.51	25.27
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,138,977,720.05	91.45

### 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

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	180401	18 农发 01	1,200,000	124,892,065.57	2.76
2	102101719	21 铁塔股份 MTN001	1,200,000	123,288,000.00	2.72
3	101901141	19 广州国资 MTN001	1,200,000	123,080,013.11	2.72
4	200203	20 国开 03	1,200,000	122,840,098.36	2.71
5	092318003	23 农发清发 03	1,200,000	120,831,649.32	2.67

### 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金未投资国债期货。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.11.3 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	33,437.84
2	应收清算款	52,221,639.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,610,023.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,865,101.07

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末，本基金未持有股票投资。

### 7.11.6 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 (%)
东海祥	55,947	30,576.91	677,979,158.13	39.63	1,032,707,407.49	60.37

苏短债 A						
东海祥苏短债 C	2,768	137,046.22	60,451,772.53	15.94	318,892,152.34	84.06
东海祥苏短债 E	38,456	51,768.43	297,136,465.77	14.93	1,693,670,097.59	85.07
合计	97,171	41,996.45	1,035,567,396.43	25.38	3,045,269,657.42	74.62

### 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	东海祥苏短债 A	475,826.40	0.0278
	东海祥苏短债 C	1,009.65	0.0003
	东海祥苏短债 E	65,621.47	0.0033
	合计	542,457.52	0.0133

### 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	东海祥苏短债 A	0~10
	东海祥苏短债 C	0
	东海祥苏短债 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东海祥苏短债 A	10~50
	东海祥苏短债 C	0
	东海祥苏短债 E	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东海祥苏短债 A	东海祥苏短债 C	东海祥苏短债 E
基金合同生效日（2020年3月12日）基金份额总额	890,073,731.49	109,931,543.06	-
本报告期初基金份额总额	1,436,596,676.11	210,305,909.63	2,401,829,314.05
本报告期基金总申购份额	1,820,892,785.70	543,359,064.51	5,756,292,509.79
减：本报告期	1,546,802,896.19	374,321,049.27	6,167,315,260.48

基金总赎回份 额			
本报告期基金 拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	1,710,686,565.62	379,343,924.87	1,990,806,563.36

## § 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	1	-	-	5,464.51	100.00	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

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、个股分析的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 (%)
东海证 券	546,447,50 5.91	96.50	275,700,000. 00	93.87	-	-
恒泰证	19,800,000	3.50	18,000,000.0	6.13	-	-

券	.00		0		
---	-----	--	---	--	--

### 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	东海祥苏短债债券型证券投资基金 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	东海祥苏短债债券型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 31 日
4	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
5	东海祥苏短债债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
6	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
7	东海祥苏短债债券型证券投资基金 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
8	东海祥苏短债债券型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 25 日
9	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司并开通定投业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 4 日
10	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 19 日
11	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
12	东海祥苏短债债券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
13	东海祥苏短债债券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祥苏短债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东海祥苏短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东海祥苏短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《东海祥苏短债债券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