

东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告

2015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：2015年8月27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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月20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2015年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
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	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	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	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
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	45
§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	46
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	46
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47

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 .....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4	基金投资策略的改变 .....	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
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 .....	48
§11	备查文件目录 .....	52
11.1	备查文件目录 .....	52
11.2	存放地点 .....	52
11.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东海美丽中国灵活配置混合
场内简称	-
基金主代码	000822
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月14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	35,509,337.51份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过在股票、固定收益类资产、现金等资产的积极灵活配置,重点关注在建设美丽中国的主旋律下,受益经济结构转型和经济品质改善的个股,辅以衍生金融工具适度对冲系统风险,以获得中长期稳定且超越比较基准的投资回报。
投资策略	中国经济增长正处在从数量扩张向质量改善转变的过程中,中央政府提出的美丽中国概念不光重点关注生态文明建设,更是融入了经济建设、政治建设、文化建设、社会建设各方面和全过程。围绕美丽中国的概念,中国经济结构转型和经济品质的改善会在很长时期贯穿中国经济增长的主线,由此带来一系列的投资机遇,而与美丽中国相关联的行业及企业将蕴含极高的投资价值。同时,本基金通过对宏观环境和市场风险特征的分析研究,不断优化组合资产配置,控制仓位和采用衍生品套期保值等策略,实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50% + 上证国债指数收益率 × 50%

风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高预期收益的基金产品。
--------	--

### 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	刘清
	联系电话	021-60586900
	电子邮箱	service@donghaifunds.com
客户服务电话	4009595531或95531-3	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	葛伟忠	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.donghaifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	44,397,133.72
本期利润	64,223,217.28
加权平均基金份额本期利润	0.7397
本期加权平均净值利润率	59.17%
本期基金份额净值增长率	74.36%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2015年6月30日）
期末可供分配利润	23,982,939.59
期末可供分配基金份额利润	0.6754
期末基金资产净值	60,614,417.85
期末基金份额净值	1.707
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2015年6月30日）
基金份额累计净值增长率	70.70%

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2014年11月14日。

#### 3.2 基金净值表现

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

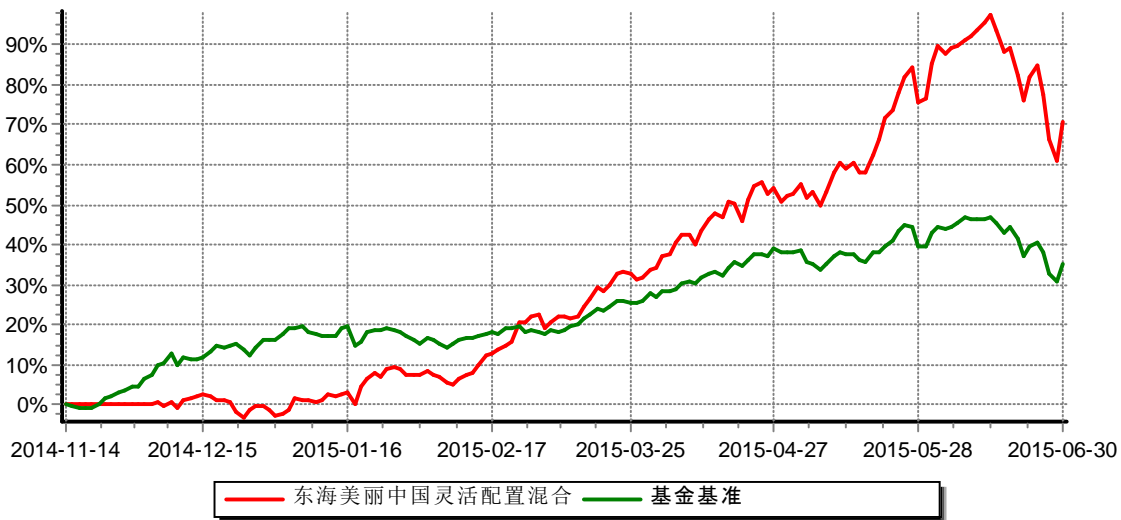
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.29%	3.07%	-3.34%	1.75%	0.05%	1.32%
过去三个月	27.10%	2.37%	6.22%	1.31%	20.88%	1.06%
过去六个月	74.36%	1.95%	14.90%	1.14%	59.46%	0.81%

自基金合同生效日起至今（2014年11月14日-2015年06月30日）	70.70%	1.78%	35.01%	1.11%	35.69%	0.67%
--------------------------------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：(1)上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)本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

### 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



注：（1）本基金基金合同生效日为2014年11月14日，截至报告期末未满一年；

（2）本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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的相关规定）。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产净值的比例为0%-95%；权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；任何交易日日终在扣除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不低于基金资产净值的5%；

（3）本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

## § 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，2013年2月25日正式成立。由东海证券股份有限公司、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共同发起成立。注册地上海，注册资本1.5亿元人民币。

公司现有员工60余人，业务骨干的平均从业年限在十年以上。公司秉承“基金份额持有人利益优先、管理创造价值、品质创造财富”的经营理念，在夯实基础上稳步推进创新发展步伐，努力建设成“运作稳健、专业精良、治理完善、诚信合规”在业内具有影响力的现代资产管理公司。

截至本报告期末，本基金管理人管理东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王庆仁	副总经理，本基金的基金经理	2014年11月14日	—	15年	金融学博士、加拿大MCMASTER大学博士后。历任华西证券有限责任公司证券投资部副总经理、东海证券上海自营分公司执行总经理、上海云腾投资管理有限公司投资总监等职。
杜斌	本基金的基金经理	2014年11月14日	—	16年	经济学学士，中级经济师。历任泰阳证券湘证基金管理部经理助理、泰阳证券资产管理总部投资交易部经理、方正证券资产管理部债券型集合计划投资主办人、东海基金管理有限责任公司专户理财部固定收益投资经理等职。

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定；

（3）截至本报告送出口，本基金基金经理王庆仁先生已辞去基金经理职位，相关公告已于2015年8月6日通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本公司官网

(www.donghaifunds.com)予以对外披露。

## 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生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

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策与执行、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

### 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，并定期分析组合间的同向交易。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。本报告期内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

本报告期内，经济基本面数据仍然延续低迷，经济增速下行有企稳迹象。

本报告期内，我们坚持建设美丽中国的投资主线，布局于信息安全、生态环保、医

药与医疗服务、先进制造、移动互联网、农业、新型消费（文体、健康等）、以提升效率为目的的国企改革及部分受益于上游资源（石油、矿石等）价格大幅下跌的行业，从这些行业中精选了估值相对较低的个股，根据市场状况采取了灵活操作策略。期间在6月份，我们减持了受益于稳增长政策后获利较多的金融个股，降低了仓位，在6月底市场回调中有效减少了回撤幅度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年上半年，本基金净值增长率为74.36%，业绩基准增长率为14.90%，跑赢业绩比较基准59.46%。自成立以来（2014年11月14日），本基金净值增长率为70.70%，业绩基准增长率为35.01%，跑赢业绩比较基准35.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济下行，对资金的需求减弱；CPI、PPI均处弱势；利率市场化改革是当前金融市场改革的重点工作，利率不能大幅扰动；基于货币政策的金融生态（利率、流动性等）仍是A股市场运行的主逻辑。中短期内市场将以宽幅震荡、收敛人气为主；鉴于估值短期内难以修复，有业绩的个股将成避风港，特别是近期中报的逐步披露，市场将强化公司业绩的主逻辑；后期，将循着两条主线寻找投资机会：一是能提估值的产业（继续看好国企改革、外延式并购、以及同改革、转型方向一致的成长股）；二是处于景气周期的产业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由总经理、督察长、投资总监和运营总监及公司相关业务部门工作人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的20%；

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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，本基金未有连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

### § 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

本报告期内，本基金托管人在对东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金的管理人——东海基金管理有限公司在东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东海基金管理有限公司编制和披露的东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告中财务指标、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：东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,390,706.53	13,702,972.25
结算备付金		—	—
存出保证金		138,055.21	—
交易性金融资产	6.4.7.2	51,392,908.24	189,470,183.00
其中：股票投资		51,392,908.24	189,470,183.00
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		963,938.33	—
应收利息	6.4.7.5	3,547.01	4,674.99
应收股利		—	—
应收申购款		257,001.28	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	46,463.64	92,171.57
资产总计		65,192,620.24	203,270,001.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		3,740,950.75	463,123.78
应付管理人报酬		83,868.22	402,989.83

应付托管费		13,978.04	67,164.96
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	567,501.76	312,876.60
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	171,903.62	24,067.11
负债合计		4,578,202.39	1,270,222.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	35,509,337.51	206,227,895.03
未分配利润	6.4.7.10	25,105,080.34	-4,228,115.50
所有者权益合计		60,614,417.85	201,999,779.53
负债和所有者权益总计		65,192,620.24	203,270,001.81

注：(1) 报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.707元，基金份额总额35,509,337.51份；

(2) 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日至2015年6月30日
<b>一、收入</b>		66,019,828.65
1. 利息收入		41,049.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	41,049.62
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）		45,291,506.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	45,040,148.63
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	251,358.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	19,826,083.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	861,188.83
<b>减：二、费用</b>		1,796,611.37
1. 管理人报酬		814,588.81
2. 托管费		135,764.78
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	663,252.06
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	183,005.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		64,223,217.28
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		64,223,217.28

注：（1）本基金基金合同生效日为2014年11月14日，无上年度可比期间的相关数据，因此利润表仅列示2015年1月1日至2015年6月30日的数据，特此说明；

（2）后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	206,227,895.03	-4,228,115.50	201,999,779.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	64,223,217.28	64,223,217.28
三、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)	-170,718,557.52	-34,890,021.44	-205,608,578.96
其中：1. 基金申购款	39,338,441.12	14,067,551.92	53,405,993.04
2. 基金赎回款	-210,056,998.64	-48,957,573.36	-259,014,572.00
四、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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	35,509,337.51	25,105,080.34	60,614,417.85

注：本基金基金合同生效日为2014年11月14日，无上年度可比期间的相关数据，因此所有者权益变动表仅列示2015年1月1日至2015年6月30日的的数据，特此说明；

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

基金管理人负责人 葛伟忠      主管会计工作负责人 葛伟忠      会计机构负责人 刘宇

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]934号文准予注册募集，由



基金管理人东海基金管理有限责任公司于2014年10月16日至2014年11月12日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第61047315\_B57号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年11月14日生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。募集期间净认购金额为人民币404,609,682.94元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币53,680.80元，以上实收基金（本息）合计为人民币404,663,363.74元，合计募集份额为404,663,363.74份。本基金的基金管理人为东海基金管理有限责任公司，注册登记机构为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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的相关规定）。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产净值的比例为0%-95%；权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；任何交易日日终在扣除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不低于基金资产净值的5%；

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×50% + 上证国债指数收益率 ×50%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2015年6月30日的财务状况以及2015上半年的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2015年1月1日至2015年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### 1) 股票投资

##### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

##### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算。

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

##### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值。

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取

得成本时，按中国证监会相关规定处理。

## 2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

## 3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

## 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值。

## 5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基

金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际

利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代



缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 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 2015年6月30日
活期存款	12,390,706.53
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	12,390,706.53

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,352,484.49	51,392,908.24	14,040,423.75
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—

	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	37,352,484.49	51,392,908.24	14,040,423.75

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	3,484.91
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	62.10
合计	3,547.01

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015年6月30日
其他应收款	—
待摊费用	46,463.64
合计	46,463.64

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	567,501.76
银行间市场应付交易费用	—
合计	567,501.76

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	11,294.54
其他负债合计	160,609.08
合计	171,903.62

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,227,895.03	206,227,895.03
本期申购	39,338,441.12	39,338,441.12
本期赎回（以“-”号填列）	-210,056,998.64	-210,056,998.64
本期末	35,509,337.51	35,509,337.51

注：本期申购含红利再投、转换入份额，本期赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	3,102,350.62	-7,330,466.12	-4,228,115.50
本期利润	44,397,133.72	19,826,083.56	64,223,217.28
本期基金份额交易产生的变动数	-23,516,544.75	-11,373,476.69	-34,890,021.44
其中：基金申购款	10,322,139.76	3,745,412.16	14,067,551.92
基金赎回款	-33,838,684.51	-15,118,888.85	-48,957,573.36
本期已分配利润	—	—	—
本期末	23,982,939.59	1,122,140.75	25,105,080.34

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	34,764.32
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	6,285.30
其他	—
合计	41,049.62

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	45,040,148.63
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	45,040,148.63

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	303,310,103.37
减：卖出股票成本总额	258,269,954.74
买卖股票差价收入	45,040,148.63

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内，本基金未投资债券，债券收益为零。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内，本基金未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	251,358.01
基金投资产生的股利收益	—
合计	251,358.01

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	19,826,083.56
——股票投资	19,826,083.56
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—

2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	19,826,083.56

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	861,188.83
合计	861,188.83

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	663,252.06
银行间市场交易费用	—
合计	663,252.06

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	—
信息披露费	183,005.72
合计	183,005.72

#### 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2015年6月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

**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，本基金未发生需要披露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**

本基金本报告期不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。

**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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
深圳鹏博实业集团有限公司	基金管理人的股东
苏州市相城区江南化纤集团有限公司	基金管理人的股东
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
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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东海证券	74,189,477.00	18.38%

注：本基金本报告期为2015年1月1日至2015年6月30日，本基金基金合同于2014年11月14日正式生效，无同期对比数据。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	67,542.10	21.48%	380,418.70	67.03%

注：（1）本基金本报告期为2015年1月1日至2015年6月30日，本基金基金合同于2014年11月14日正式生效，无同期对比数据。

（2）上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

（3）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	814,588.81
其中：支付销售机构的客户维护费	237,474.31

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。



6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	135,764.78

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	12,390,706.53	34,764.32

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

（2）本基金成立于2014年11月14日，无上年可比期间数据。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期本基金未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2015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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600217	*ST 秦岭	2015-06-10	重大事项停牌	15.36	2015-08-05	14.59	173,684	1,552,189.53	2,667,786.24
300012	华测检测	2015-06-15	筹划重大事项停牌	30.80	2015-07-27	38.76	94,000	1,609,013.93	2,895,200.00

**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**

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因交易所债券正回购交易而作为抵押的债券。

**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监察稽核工作。总经理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，公司设独立的监察稽核部对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，按银行同业利率计息，与该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与中国证券登记结算有限责任公司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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的股票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的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此均能及时变现。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。

#### 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受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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							
银行存款	12,390,706.53	—	—	—	—	—	12,390,706.53
交易性金	—	—	—	—	—	51,392,908.24	51,392,908.24

融资产							
应收证券清算款	—	—	—	—	—	963,938.33	963,938.33
应收利息	—	—	—	—	—	3,547.01	3,547.01
应收申购款	—	—	—	—	—	257,001.28	257,001.28
其他资产	—	—	—	—	—	46,463.64	46,463.64
资产总计	12,390,706.53	—	—	—	—	52,663,858.50	65,054,565.03
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	3,740,950.75	3,740,950.75
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	83,868.22	83,868.22
应付托管费	—	—	—	—	—	13,978.04	13,978.04
应付交易费用	—	—	—	—	—	567,501.76	567,501.76
其他负债	—	—	—	—	—	171,903.62	171,903.62
负债总计	—	—	—	—	—	4,578,202.39	4,578,202.39
利率敏感度缺口	12,390,706.53	—	—	—	—	48,085,656.11	60,476,362.64
上年度末 2014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	13,702,972.25	—	—	—	—	—	13,702,972.25
交易性金融资产	—	—	—	—	—	189,470,183.00	189,470,183.00
应收利息	—	—	—	—	—	4,674.99	4,674.99
其他资产	—	—	—	—	—	92,171.57	92,171.57
资产总计	13,702,972.25	—	—	—	—	189,567,029.56	203,270,001.81

负债								
应付赎回款		—	—	—	—	—	463,123.78	463,123.78
应付管理人报酬		—	—	—	—	—	402,989.83	402,989.83
应付托管费		—	—	—	—	—	67,164.96	67,164.96
应付交易费用		—	—	—	—	—	312,876.60	312,876.60
其他负债		—	—	—	—	—	24,067.11	24,067.11
负债总计		—	—	—	—	—	1,270,222.28	1,270,222.28
利率敏感度缺口	13,702,972.25	—	—	—	—	—	188,296,807.28	201,999,779.53

注：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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金无交易性债券投资，因此利率风险因素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

其他价格风险主要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股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于股票资产的比例占基金资产的0%~95%，本基金的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，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 2015年6月30日		上年度末 2014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	51,392,908.24	84.79	189,470,183.00	93.80
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	51,392,908.24	84.79	189,470,183.00	93.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、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。		
假设	2、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。		
假设	3、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。		
假设	4、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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	业绩比较基准增加1%	476,699.93	1,153,595.19
	业绩比较基准减少1%	-476,699.93	-1,153,595.19

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无需要说明的其他事项。

## §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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	51,392,908.24	78.83
	其中：股票	51,392,908.24	78.83
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	12,390,706.53	19.01
7	其他各项资产	1,409,005.47	2.16
8	合计	65,192,620.24	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	33,002,950.24	54.45
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	2,018,750.00	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	5,484,100.00	9.05
H	住宿和餐饮业	—	—



I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	7,991,908.00	13.18
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	2,895,200.00	4.78
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	51,392,908.24	84.79

### 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	600703	三安光电	189,000	5,915,700.00	9.76
2	600009	上海机场	173,000	5,484,100.00	9.05
3	601318	中国平安	61,000	4,998,340.00	8.25
4	600329	中新药业	196,000	4,937,240.00	8.15
5	600388	龙净环保	232,700	4,418,973.00	7.29
6	002450	康得新	113,000	3,457,800.00	5.70
7	600699	均胜电子	87,100	3,336,801.00	5.50
8	300073	当升科技	118,300	3,175,172.00	5.24
9	300012	华测检测	94,000	2,895,200.00	4.78
10	600217	*ST秦岭	173,684	2,667,786.24	4.40
11	600677	航天通信	62,500	2,018,750.00	3.33
12	600517	置信电气	121,100	1,895,215.00	3.13
13	600143	金发科技	142,600	1,699,792.00	2.80
14	601601	中国太保	50,000	1,509,000.00	2.49

15	601777	力帆股份	94,900	1,498,471.00	2.47
16	601628	中国人寿	47,400	1,484,568.00	2.45

#### 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	600388	龙净环保	8,112,018.19	4.02
2	600009	上海机场	6,945,449.22	3.44
3	601318	中国平安	5,630,960.00	2.79
4	600699	均胜电子	5,478,746.00	2.71
5	600517	置信电气	5,205,684.00	2.58
6	600584	长电科技	4,848,227.00	2.40
7	601288	农业银行	3,310,000.00	1.64
8	601601	中国太保	3,282,643.00	1.63
9	600383	金地集团	3,235,647.00	1.60
10	600999	招商证券	3,179,877.00	1.57
11	601328	交通银行	3,145,000.00	1.56
12	600015	华夏银行	3,067,732.00	1.52
13	600837	海通证券	3,063,000.00	1.52
14	600036	招商银行	2,987,049.00	1.48
15	000402	金融街	2,958,000.00	1.46
16	601998	中信银行	2,936,000.00	1.45
17	600057	象屿股份	2,921,807.40	1.45
18	601939	建设银行	2,920,000.00	1.45
19	601628	中国人寿	2,911,018.00	1.44
20	600016	民生银行	2,826,000.00	1.40

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	600703	三安光电	17,932,562.99	8.88
2	600057	象屿股份	15,836,528.87	7.84
3	300012	华测检测	13,624,255.33	6.74
4	600329	中新药业	12,343,628.09	6.11
5	600388	龙净环保	11,383,365.27	5.64
6	002422	科伦药业	9,959,961.22	4.93
7	600309	万华化学	8,920,413.92	4.42
8	600143	金发科技	8,917,212.93	4.41
9	002023	海特高新	8,014,514.07	3.97
10	600459	贵研铂业	7,901,733.76	3.91
11	300007	汉威电子	7,185,316.46	3.56
12	300207	欣旺达	7,129,310.32	3.53
13	300165	天瑞仪器	6,948,164.50	3.44
14	002450	康得新	6,750,493.15	3.34
15	002470	金正大	6,685,107.31	3.31
16	600690	青岛海尔	6,046,600.00	2.99
17	300203	聚光科技	5,787,361.32	2.87
18	600584	长电科技	5,620,565.67	2.78
19	000977	浪潮信息	5,137,005.78	2.54
20	600526	菲达环保	5,125,257.00	2.54
21	601777	力帆股份	5,025,022.31	2.49
22	002022	科华生物	4,974,832.71	2.46
23	600699	均胜电子	4,822,403.42	2.39
24	000826	桑德环境	4,502,160.49	2.23
25	601328	交通银行	4,379,857.30	2.17
26	300262	巴安水务	4,274,892.30	2.12
27	000919	金陵药业	4,209,118.67	2.08
28	600015	华夏银行	4,190,894.91	2.07
29	600999	招商证券	4,114,066.54	2.04

30	600036	招商银行	4,102,001.92	2.03
----	--------	------	--------------	------

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

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	100,366,596.42
卖出股票的收入（成交）总额	303,310,103.37

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以投资组合的套期保值为目的，适当参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

在基于对证券市场总体行情的研判下，根据风险资产的规模和风险系数应用股指期货对风险资产进行对冲投资，在市场面临下跌时择机卖出期指合约对持有股票进行套期保值，对冲基金投资面临的系统风险。其次，在面临基金大额申购或者大额赎回造成的

基金规模急剧变化下，利用股指期货及时调整投资组合的风险度，对基金的流动性风险进行对冲。

## 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

本基金暂不投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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	138,055.21
2	应收证券清算款	963,938.33
3	应收股利	—
4	应收利息	3,547.01
5	应收申购款	257,001.28
6	其他应收款	—
7	待摊费用	46,463.64
8	其他	—
9	合计	1,409,005.47

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300012	华测检测	2,895,200.00	4.78	停牌
2	600217	*ST秦岭	2,667,786.24	4.40	停牌

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
985	36,050.09	—	—	35,509,337.51	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	863,557.65	2.43%

注：(1) 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为10万份至50万份（含）；

(2) 本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为10万份至50万份（含）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年11月14日)基金份额总额	404,663,363.74
本报告期期初基金份额总额	206,227,895.03
本报告期基金总申购份额	39,338,441.12
减：本报告期基金总赎回份额	210,056,998.64
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	35,509,337.51

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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、经本基金管理人股东会决议，同意刘化军先生辞去公司董事职务，任命汪劲松先生担任公司股东董事。

### 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，为安永华明会计师事务所（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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

## 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东海证券	2	74,189,477	18.38%	67,542.1	21.48%	—
华鑫证券	2	90,924,011.83	22.53%	82,776.8	26.33%	—
太平洋证券	1	238,542,830.96	59.09%	164,092.07	52.19%	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2) 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证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2) 中央交易室与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3) 基金业务部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

## 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	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金合同内容摘要》、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金发售公告》、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》	2014-10-13
2	《东海美丽中国灵活配置混合型	基金管理人网站	2014-10-13



	证券投资基金合同》、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金合同内容摘要》、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金发售公告》、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》	(www.donghaifunds.com )	
3	《关于旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金新增江苏江南农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2014-10-22
4	《关于旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2014-10-30
5	《东海基金管理有限责任公司关于网上交易通联支付新增支持银行卡的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2014-11-05
6	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2014-11-15
7	《东海基金管理有限责任公司东	《中国证券报》、《上海	2014-12-11

	海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》	证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	
8	《东海基金管理有限责任公司关于旗下开放式基金2014年年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-01-05
9	《关于旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金新增兴业证券股份有限公司为销售机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-01-29
10	《关于旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金新增杭州数米基金销售有限公司为销售机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-02-11
11	《东海基金管理有限责任公司关于旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金参加代销机构申购费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-03-06
12	《东海基金管理有限责任公司关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-03-31

		)	
13	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年第1季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-04-20
14	《东海基金管理有限责任公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-04-22
15	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金通过华鑫证券有限责任公司自助式交易系统开展基金申购费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-05-27
16	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金对长期停牌股票变更估值方法的提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-06-03
17	《关于旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金新增一路财富（北京）信息科技有限公司为销售机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-06-16
18	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金对长期停牌股票变更估值方法的提示性公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-06-19

		)	
19	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书全文及摘要》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2015-06-27

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 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

二〇一五年八月二十七日