

东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

2015年12月31日

基金管理人：东兴证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016年3月26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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月21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。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者仔细阅读。

本报告期自2015年9月8日（基金合同生效日）起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	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	过去三年基金的利润分配情况	9
§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	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	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	14
§7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	19
§8	投资组合报告	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	错误！未定义书签。
8.3	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	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	44
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
8.6	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	48
8.7	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	48
8.8	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	48
8.9	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	48
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	489
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12	投资组合报告附注	49
§9	基金份额持有人信息	50
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

9.3 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 .....	50
§10 开放式基金份额变动 .....	50
§11 重大事件揭示 .....	51
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
11.2 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 .....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
11.4 基金投资策略的改变 .....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
11.8 其他重大事件 .....	53
§12 备查文件目录 .....	55
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东兴改革精选混合
基金主代码	001708
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月8日
基金管理人	东兴证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	107,288,483.26
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票，精选其中具有竞争优势和估值优势的上市公司，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以中国全面深化改革过程中产生的各类投资机遇作为主线，并通过“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建基金资产组合。一方面，本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关改革政策深入研究的基础上，从“自上而下”的角度对大类资产进行优化配置，并优选受益行业；另一方面，本基金从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发，“自下而上”精选受益改革相关证券中具有竞争优势和估值优势的优质上市公司，力求在严格控制风险的前提下，获取长期持续稳健的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东兴证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张韵	林葛
	联系电话	010-66551816	010-66060069
	电子邮箱	zhangyun@dxzq.net.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8888-993	95599
传真		010-66551452	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街5号 (新盛大厦) 12、15层	北京市东城区建国门内大街 69号
办公地址		北京市东城区东直门南大街3 号国华投资大厦12层	北京市西城区复兴门内大街 28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码		100007	100031
法定代表人		魏庆华	刘士余

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund.dxzq.net
基金年度报告备置地点	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦) 15层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区永定门西滨河路8 号院7号楼中海地产广场西塔5层
注册登记机构	东兴证券股份有限公司	北京市西城区金融大街5号(新盛 大厦) 12、15层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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>	2015年9月8日-2015年12月31日
本期已实现收益	15,110,540.38
本期利润	24,658,933.46
加权平均基金份额本期利润	0.0858
本期加权平均净值利润率	8.38%
本期基金份额净值增长率	9.30%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2015年末
期末可供分配利润	8,654,007.99
期末可供分配基金份额利润	0.0807
期末基金资产净值	117,275,905.34
期末基金份额净值	1.093
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2015年末
基金份额累计净值增长率	9.30%

注：1、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；

2、期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3、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。

4、本基金基金合同于2015年9月8日生效，至报告期末不满一年。

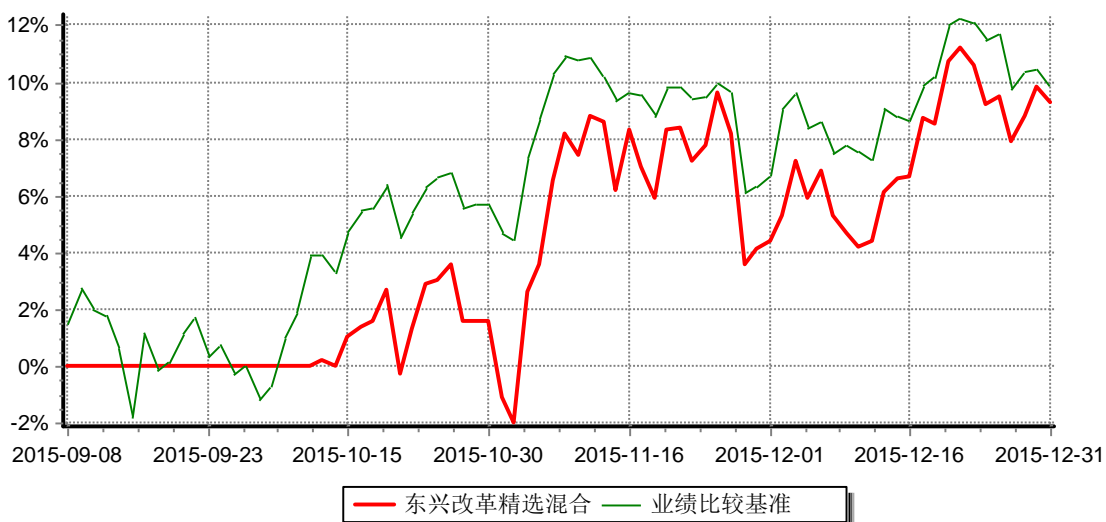
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	9.30%	1.46%	10.61%	1.00%	-1.31%	0.46%

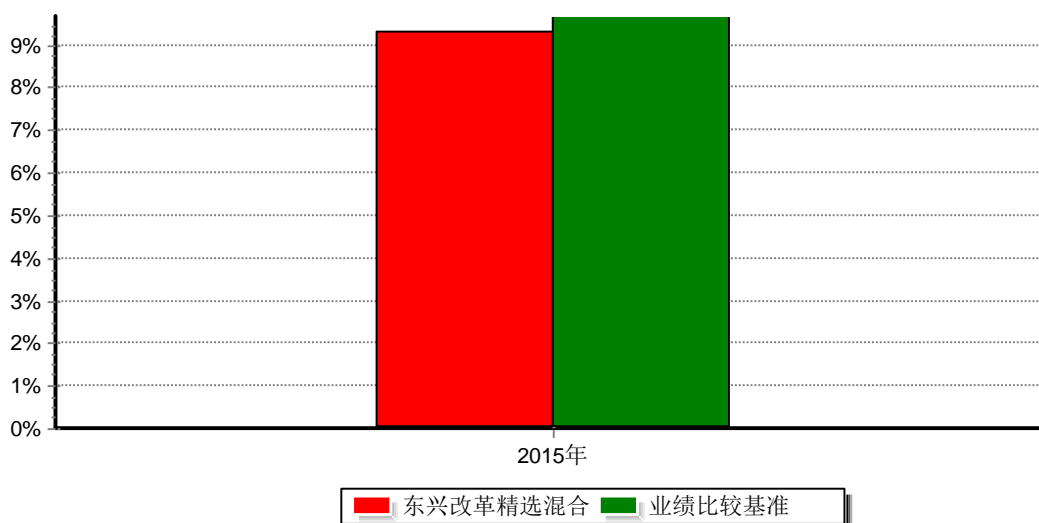
自基金合同生效起至今	9.30%	1.29%	9.67%	1.07%	-0.37%	0.22%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

### 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变动的比较



注：本基金基金合同生效日2015年9月8日至报告期末未满1年。按本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于2015年9月8日生效，自合同生效以来未满五年。合同生效当



年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015年9月8日）至报告期截止日（2015年12月31日）未进行利润分配。

## § 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

东兴证券股份有限公司（股票简称“东兴证券”，股票代码“601198”，以下简称“本公司”）是2008年经财政部和中国证监会批准，由中国东方资产管理公司作为主要发起人发起设立的全国性综合类证券公司，2015年2月26日在上海证券交易所上市，是国内首家资产管理公司系上市证券公司。

本公司注册资本25.04亿元，总部设在北京，在全国拥有61家证券营业部；在福建、上海、深圳、新疆设有4家分公司；拥有东兴期货有限责任公司、东兴证券投资有限公司、东兴资本投资管理有限公司、东兴证券（香港）金融控股有限公司四家一级全资子公司。公司业务涵盖证券经纪、证券投资咨询、与证券交易和证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券投资基金销售业务、证券自营和证券资产管理业务、融资融券业务、代销金融产品业务、公开募集证券投资基金管理业务，形成覆盖场内与场外、线下和线上、国内和海外的综合金融服务体系。

本公司经中国证券监督管理委员会核准（证监许可【2015】67号）于2015年1月8日获得公开募集证券投资基金管理业务资格。截至2015年12月31日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金和东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金共2只开放式基金。

#### 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		
孙继青先生	本基金基金经理	2015年9月8日	—	8	北京科技大学工学硕士，3年钢铁行业经验，7年证券行业经验。2007年10月加入东兴证券，2007年10月

					至2012年3月任东兴证券研究所钢铁行业研究员；2012年3月至2013年6月任东兴证券资产管理部投资品行业研究员、宏观策略研究员；2013年6月至2014年9月任东兴证券资产管理部投资经理。2014年9月加入东兴证券基金部。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
刘家伟先生	本基金基金经理	2015年12月25日	—	18	经济学博士，从事证券行业18年以上，曾任大通证券研发中心副总经理，2007年入职东兴证券股份有限公司研究所，从事卖方研究。曾任造纸、农业、食品饮料行业分析师，历任食品饮料首席分析师、消费组组长、研究所副所长、研究总监等。现任职基金业务部投资研究团队。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，公平交易制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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成交量5%的情况。

### 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

报告期内市场先抑后扬，在三季度经历了市场大幅波动之后，场外去杠杆基本结束，两融大幅下降使得市场总体杠杆下降，美国9月份放弃加息，也使得整个市场风险偏好有所提升。

报告期内，特别是本基金封闭期内市场比较低迷，基金仓位比较低。封闭期结束之后，市场开始活跃，我们抓住市场反弹的黄金期，加大了仓位配置，基金净值开始逐步上涨。由于建仓期间中小盘和创业板估值较高，报告期内加大了有国企改革预期的医药、金融的配置比例，取得了一定收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年9月8日(基金合同生效日)起至2015年12月31日,本基金净值增长率为9.30%,业绩比较基准收益率为9.67%,低于业绩比较基准0.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为中国经济处于转型期,2016年经济仍有较大下行压力,经济能否企稳主要看是否能加大政策支持。

从政策层面来看,改革仍然是主旋律,特别是从2015年四季度政府加大了供给侧改革的力度,我们预计在供给侧改革预期下,一些过剩产能可能加速出清。稳定投资和房地产市场升温有助于经济企稳。从货币层面来看,由于美国进入加息周期,国内降息空间明显减小,同时人民币存在一定的贬值预期,资金供给略显紧张,有一定的降准空间,国内货币宽松力度可能会低于去年,边际效应递减。经济下行压力下,企业盈利压力比较大,市场经历了大幅波动之后,总体心态仍然不稳定,中小创估值仍然偏高,总体来讲,市场面临较大的不确定性,市场也会有较大的分化。国企改革和供给侧改革在今年将会有较大的实施力度,大众创业万众创新所带来的新的经济增长点仍然有较大的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规,坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

本报告期内,本基金管理人进一步完善了公司的内控体系;对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性;采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;针对新出台的法律法规和监管要求,积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试,不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养;全面参与新产品设计、新业务拓展工作;严格审查基金宣传推介材料,及时检查基金销售业务的合法合规情况;完成各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性;监督客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,顺应“放松管制、加强监管”的监管形势,积极健全内部管理制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国

证监会相关规定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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

#### 4.9 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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-东兴证券股份有限公司2015年9月8日（本基金基金合同生效日）至2015年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东兴证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，东兴证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字【2016】01460055号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的东兴证券股份有限公司作为管理人按照后附的财务报表附注7.4.2所述的编制基础编制的东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称基金）的财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表，2015年度的利润表和持有人权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报基金财务报表是基金管理人东兴证券股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照后附的财务报表附注7.4.2所述的编制基础编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使基金财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对基金财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对基金财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及执行审计程序，以获取有关基金财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的基金财务报表重大错报风险的评估。在进行风险

	<p>评估时，注册会计师考虑与基金财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价基金财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照附注7.4.2所述编制基础编制，公允反映了东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动情况。
注册会计师的姓名	王需如、刘涛
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5层
审计报告日期	2016-03-14

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	2,301,946.53
结算备付金		473,907.27
存出保证金		272,031.62
交易性金融资产	7.4.7.2	115,566,191.54
其中：股票投资		95,304,191.54

基金投资		—
债券投资		20,262,000.00
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	397,859.25
应收股利		—
应收申购款		29,865.74
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		119,041,801.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		919,512.21
应付管理人报酬		180,576.67
应付托管费		30,096.09
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	557,415.13
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	78,296.51



负债合计		1,765,896.61
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	107,288,483.26
未分配利润	7.4.7.10	9,987,422.08
所有者权益合计		117,275,905.34
负债和所有者权益总计		119,041,801.95

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.093元，基金份额总额107,288,483.26份。

2、本基金基金合同于2015年9月8日生效，本报告实际报告期为2015年9月8日至2015年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年9月8日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
<b>一、收入</b>		27,317,739.85
1. 利息收入		1,288,139.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,037,390.68
债券利息收入		165,444.24
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		85,304.09
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,111,519.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,126,490.68
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	-14,971.23
资产支持证券投资收		—

益		
贵金属投资收益	7.4.7.14	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—
股利收益	7.4.7.16	—
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	9,548,393.08
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	1,369,688.31
<b>减：二、费用</b>		<b>2,658,806.39</b>
1. 管理人报酬		1,419,836.16
2. 托管费		236,639.32
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.19	882,430.12
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.20	119,900.79
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>24,658,933.46</b>
减：所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>24,658,933.46</b>

注：本基金基金合同于2015年9月8日生效，本报告实际报告期为2015年9月8日至2015年12月31日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年9月8日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年9月8日至2015年12月31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)	466,056,506.87	—	466,056,506.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	24,658,933.46	24,658,933.46
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)	-358,768,023.61	-14,671,511.38	-373,439,534.99
其中：1. 基金申购款	8,235,195.11	258,986.82	8,494,181.93
2. 基金赎回款	-367,003,218.72	-14,930,498.20	-381,933,716.92
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)	107,288,483.26	9,987,422.08	117,275,905.34

注：本基金基金合同于2015年9月8日生效，本报告实际报告期为2015年9月8日至2015年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

魏庆华

魏庆华

银国宏

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2015年7月10日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1589号）的批复，自2015年8月17日至2015年8月28日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集465,974,776.50元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]01460023号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为466,056,506.87份，其中认购资金利息折合81,730.37份。本

基金基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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，包括国内依法发行上市交易的股票（含中小板股票、创业板股票，以及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%，投资受益于深化改革的行业股票的资产不低于非现金基金资产的80%；债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、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不低于基金资产净值的5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规变更或中国证监会允许，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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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2号-年度报告的内容与格式》、《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》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

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、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为

应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。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。

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

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

#### （2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

#### （3）权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

#### （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）买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

#### （6）卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（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影响证券价格的重大事件的，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。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（4）交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，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，按成本估值。

(3) 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，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。



#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### （3）公允价值变动损益

公允价值变动损益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，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

##### （4）其他收入

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时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 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12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，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。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【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》、财税【2007】

84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年04月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税。自2013年1月1日起，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自2008 年09 月19 日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。
6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	2,301,946.53
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	2,301,946.53

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	85,676,401.20	95,304,191.54	9,627,790.34
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	20,341,397.26	20,262,000.00
	银行间市场	—	—
	合计	20,341,397.26	20,262,000.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	106,017,798.46	115,566,191.54	9,548,393.08

#### 7.4.7.3 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/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 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通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	695.57
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	234.52

应收债券利息	396,794.52
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	134.64
合计	397,859.25

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	557,415.13
银行间市场应付交易费用	—
合计	557,415.13

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	2,296.51
预提费用	76,000.00
合计	78,296.51

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月

	31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	466,056,506.87	466,056,506.87
本期申购	8,235,195.11	8,235,195.11
本期赎回（以“-”号填列）	-367,003,218.72	-367,003,218.72
本期末	107,288,483.26	107,288,483.26

注：本基金基金合同于2015年9月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为466,056,506.87份，其中：认购资金本金折算基金份额为：465,974,776.50份，利息折算基金份额为：81,730.37份。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	15,110,540.38	9,548,393.08	24,658,933.46
本期基金份额交易产生的变动数	-6,456,532.39	-8,214,978.99	-14,671,511.38
其中：基金申购款	137,487.54	121,499.28	258,986.82
基金赎回款	-6,594,019.93	-8,336,478.27	-14,930,498.20
本期已分配利润	—	—	—
本期末	8,654,007.99	1,333,414.09	9,987,422.08

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月8日至2015年12月31日
活期存款利息收入	265,614.51
定期存款利息收入	764,261.11
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	6,984.58
其他	530.48
合计	1,037,390.68

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	270,560,032.02
减：卖出股票成本总额	255,433,541.34
买卖股票差价收入	15,126,490.68

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	10,489,669.97
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	10,233,708.70
减：应收利息总额	270,932.50
买卖债券差价收入	-14,971.23

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期2015年9月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日未投资资产支持证券。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

根据本基金基金合同规定，本基金不投资贵金属。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期2015年9月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日，无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月31日，无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	9,548,393.08
——股票投资	9,627,790.34
——债券投资	-79,397.26
——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	—
合计	9,548,393.08

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,369,666.21
其他	22.10
合计	1,369,688.31

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	882,430.12
银行间市场交易费用	—



合计	882,430.12
----	------------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月8日至2015年12月31日
审计费用	10,000.00
信息披露费	99,000.00
银行汇划费用	10,410.79
账户维护费	90.00
证券账户开户费	400.00
合计	119,900.79

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东兴证券股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国东方资产管理公司	基金管理人的控股股东
东兴期货有限责任公司	基金管理人的全资子公司
东兴证券投资有限公司	基金管理人的全资子公司
东兴资本投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
东兴证券（香港）金融控股有限公司	基金管理人的全资子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年9月8日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东兴证券股份 有限公司	611,669,974.56	100.00%

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年9月8日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东兴证券股份 有限公司	41,567,110.71	100.00%

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年9月8日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东兴证券股份 有限公司	250,200,000.00	100.00%

## 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月31日，未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年9月8日至2015年12月31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
东兴证券股份 有限公司	557,415.13	100.00%	557,415.13	100.00%

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月8日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,419,836.16
其中：支付销售机构的客户维护费	67,741.28

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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5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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年9月8日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	236,639.32

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5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。

**7.4.10.3 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2015年9月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日,未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位:人民币元

项目	本期 2015年9月8日至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年9月8日)持有的基金份额	17,999,000.00
期初持有的基金份额	—
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	—
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	—
减:基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	—
期末持有的基金份额	17,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.78%

**7.4.10.4.2 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**

本基金本报告期2015年9月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

**7.4.10.5 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9月8日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,301,946.53	265,614.51

股份有限公司

#### 7.4.10.6 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2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月31日，未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联事项的说明。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期2015年9月8日（基金合同生效日）至2015年12月31日未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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 (单位： 股)	期末 成本总额	期末 估值总额
000796	凯撒 旅游	2015- 11-09	重大资产 重组停牌	27.46		—	200,000	5,063,306.00	5,492,000.00
002678	珠江 钢琴	2015- 12-21	重大事项 停牌	17.21	2016- 01-19	15.49	300,000	4,505,775.95	5,163,000.00
002465	海格 通信	2015- 12-30	重大事项 停牌	16.69	2016- 02-04	15.02	300,200	4,530,510.91	5,010,338.00

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和合规法律部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本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，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行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，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 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 2015年12月31日
AAA	—
AAA以下	10,240,000.00
未评级	—
合计	10,240,000.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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 market 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独立的风险管理部门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的投资品种比例等。本基金投资于一家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发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

于2015年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。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。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末	1个月以内	1	3个月	1-5年	5	不计息	合计
-----	-------	---	-----	------	---	-----	----

2015年12月31日		-3个月	-1年		年以上	
资产						
银行存款	2,301,946.53					2,301,946.53
结算备付金	473,907.27					473,907.27
存出保证金	272,031.62					272,031.62
交易性金融资产-股票投资	—				95,304,191.54	95,304,191.54
交易性金融资产-债券投资	—	10,022,000.00	10,240,000.00			20,262,000.00
买入返售金融资产	—					
应收利息	—				397,859.25	397,859.25
应收申购款	—				29,865.74	29,865.74
资产总计	3,047,885.42	—	10,022,000.00	10,240,000.00	—	95,731,916.53
负债						
应付证券清算款	—					
应付赎回款	—				919,512.21	919,512.21
应付管理人报酬	—				180,576.67	180,576.67
应付托管费	—				30,096.09	30,096.09
应付交易费用	—				557,415.13	557,415.13
其他负债	—				78,296.51	78,296.51
负债总计	—	—	—	—	—	1,765,896.61
利率敏感度缺口	3,047,885.42	—	10,022,000.00	10,240,000.00	—	93,966,019.92

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者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析



假设	1. 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； 2. 所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化； 3. 银行存款、结算备付金、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； 4. 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。	
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12月31日
	1、市场利率上升25个基点	-7,604.96
	2、市场利率下降25个基点	7,643.77

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	95,304,191.54	81.26
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	20,262,000.00	17.28
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	115,566,191.54	98.54

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

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	95,304,191.54	80.06
	其中：股票	95,304,191.54	80.06
2	固定收益投资	20,262,000.00	17.02
	其中：债券	20,262,000.00	17.02
	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	2,775,853.80	2.33
7	其他各项资产	699,756.61	0.59
8	合计	119,041,801.95	100.00

## 8.2 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	3,761,034.21	3.21
B	采矿业	—	—
C	制造业	58,343,485.18	49.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,170,000.00	2.70
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	5,492,000.00	4.68
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,182,472.15	6.12
J	金融业	12,470,000.00	10.63
K	房地产业	4,885,200.00	4.17
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	95,304,191.54	81.26

## 8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	600085	同仁堂	160,000	7,137,600.00	6.09
2	002675	东诚药业	100,000	5,601,000.00	4.78

3	600436	片仔癀	80,000	5,503,200.00	4.69
4	000796	凯撒旅游	200,000	5,492,000.00	4.68
5	000999	华润三九	199,909	5,457,515.70	4.65
6	002678	珠江钢琴	300,000	5,163,000.00	4.40
7	601166	兴业银行	300,000	5,121,000.00	4.37
8	002465	海格通信	300,200	5,010,338.00	4.27
9	600185	格力地产	230,000	4,885,200.00	4.17
10	000915	山大华特	132,353	4,653,531.48	3.97
11	000728	国元证券	200,000	4,518,000.00	3.85
12	002714	牧原股份	79,903	3,761,034.21	3.21
13	600498	烽火通信	130,000	3,706,300.00	3.16
14	300059	东方财富	70,100	3,647,303.00	3.11
15	603369	今世缘	100,000	3,353,000.00	2.86
16	601668	中国建筑	500,000	3,170,000.00	2.70
17	300353	东土科技	120,000	2,928,000.00	2.50
18	601628	中国人寿	100,000	2,831,000.00	2.41
19	000488	晨鸣纸业	300,000	2,676,000.00	2.28
20	002709	天赐材料	30,000	2,487,000.00	2.12
21	300212	易华录	49,995	2,308,269.15	1.97
22	300119	瑞普生物	80,000	1,608,000.00	1.37
23	300198	纳川股份	100,000	1,573,000.00	1.34
24	002433	太安堂	100,000	1,486,000.00	1.27
25	300379	东方通	10,000	1,226,900.00	1.05

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	15,427,401.50	13.15
2	000728	国元证券	15,281,465.08	13.03

3	002142	宁波银行	13,000,190.00	11.09
4	002678	珠江钢琴	12,015,402.54	10.25
5	600085	同仁堂	11,980,270.04	10.22
6	000488	晨鸣纸业	10,879,567.46	9.28
7	300397	天和防务	10,672,329.87	9.10
8	603000	人民网	10,486,242.00	8.94
9	600498	烽火通信	10,311,442.52	8.79
10	300255	常山药业	10,271,545.40	8.76
11	002262	恩华药业	10,264,124.00	8.75
12	600138	中青旅	10,246,483.96	8.74
13	300059	东方财富	10,214,873.60	8.71
14	601818	光大银行	10,193,648.00	8.69
15	600185	格力地产	10,174,503.00	8.68
16	300212	易华录	10,163,871.00	8.67
17	000999	华润三九	10,125,297.83	8.63
18	002465	海格通信	10,114,418.42	8.62
19	002236	大华股份	10,062,042.96	8.58
20	600436	片仔癀	10,002,330.50	8.53
21	300016	北陆药业	9,774,334.27	8.33
22	600886	国投电力	9,437,000.00	8.05
23	600999	招商证券	9,008,430.20	7.68
24	600887	伊利股份	8,115,528.00	6.92
25	000915	山大华特	7,401,499.00	6.31
26	000596	古井贡酒	7,338,560.90	6.26
27	000063	中兴通讯	6,819,122.00	5.81
28	601688	华泰证券	6,162,973.00	5.26
29	600835	上海机电	5,562,839.39	4.74
30	000796	凯撒旅游	5,063,306.00	4.32
31	000027	深圳能源	4,822,750.00	4.11
32	002714	牧原股份	4,197,150.20	3.58
33	002675	东诚药业	4,025,623.00	3.43

34	603369	今世缘	3,573,938.40	3.05
35	601939	建设银行	3,490,000.00	2.98
36	601668	中国建筑	3,431,100.00	2.93
37	002709	天赐材料	3,078,831.00	2.63
38	300353	东土科技	3,069,588.00	2.62
39	601628	中国人寿	3,035,476.00	2.59
40	002433	太安堂	2,750,074.00	2.34

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、“买入金额”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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	15,316,236.21	13.06
2	000728	国元证券	12,553,842.50	10.70
3	601166	兴业银行	11,514,693.00	9.82
4	300397	天和防务	11,366,814.30	9.69
5	002262	恩华药业	10,791,653.94	9.20
6	300059	东方财富	10,431,758.00	8.90
7	601818	光大银行	10,331,896.00	8.81
8	300212	易华录	10,276,388.73	8.76
9	002236	大华股份	10,077,847.02	8.59
10	600138	中青旅	9,924,590.00	8.46
11	600999	招商证券	9,503,293.00	8.10
12	300255	常山药业	9,476,715.50	8.08
13	600886	国投电力	9,357,400.00	7.98
14	000488	晨鸣纸业	9,058,943.58	7.72
15	603000	人民网	9,026,888.75	7.70
16	600085	同仁堂	8,876,885.00	7.57

17	300016	北陆药业	8,488,828.80	7.24
18	000596	古井贡酒	8,400,750.80	7.16
19	002678	珠江钢琴	7,814,337.18	6.66
20	600887	伊利股份	7,734,700.00	6.60
21	000063	中兴通讯	7,704,624.96	6.57
22	600498	烽火通信	7,578,676.40	6.46
23	600436	片仔癀	6,589,143.00	5.62
24	002465	海格通信	6,318,419.60	5.39
25	600185	格力地产	6,302,615.24	5.37
26	600835	上海机电	6,131,368.93	5.23
27	601688	华泰证券	5,972,330.00	5.09
28	000999	华润三九	5,587,107.99	4.76
29	000027	深圳能源	4,128,323.80	3.52
30	601939	建设银行	3,545,420.00	3.02
31	002373	千方科技	2,414,998.56	2.06

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“卖出金额”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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	341,109,942.54
卖出股票的收入（成交）总额	270,560,032.02

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

#### 8.5 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	10,022,000.00	8.55
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	10,240,000.00	8.73
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	20,262,000.00	17.28

#### 8.6 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	112093	11亚迪01	100,000	10,240,000.00	8.73
2	019509	15国债09	100,000	10,022,000.00	8.55
3			—	—	—
4			—	—	—
5			—	—	—

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。



**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

本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。

**8.12.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	272,031.62
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	397,859.25
5	应收申购款	29,865.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	699,756.61

**8.12.4 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。

**8.12.5 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	占基金资产净	流通受限情况
----	------	------	--------	--------	--------

			的 公允价值	值比例 (%)	说明
1	000796	凯撒旅游	5,492,000.00	4.68	重大资产重组 停牌
2	002678	珠江钢琴	5,163,000.00	4.40	重大事项停牌
3	002465	海格通信	5,010,338.00	4.27	重大事项停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
1,857	57,775.17	17,999,000.00	16.78%	89,289,483.26	83.22%

### 9.2 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	168,000.32	0.16%

### 9.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年9月8日)基金份额总额	466,056,506.87
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,235,195.11

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	367,003,218.72
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	107,288,483.26

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人（以下简称“本公司”或“公司”）于2015年3月27日召开第三届董事会第十五次会议，审议通过选举魏庆华先生担任公司董事长的议案。鉴于魏庆华先生符合中国证监会《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》中关于董事长任职资格条件的要求，且已具备董事长任职资格，其任职以董事会选举日期生效。

本公司于2015年12月8日召开2015年第二次临时会议，审议通过选举印建民先生担任公司董事的议案。印建民先生于2016年1月28日取得证券公司董事任职资格，自前述资格取得之日起正式就任公司第三届董事会董事。

本基金管理人于2015年12月8日召开2015年第二次临时会议，审议通过选举印建民先生担任公司董事的议案。秦斌先生于2016年1月28日取得证券公司董事任职资格，自前述资格取得之日起正式就任公司第三届董事会董事。

本公司合规总监兼首席风险官许学礼先生提交的书面辞职报告，因工作调整，许学礼先生申请辞去公司首席风险官职务。根据工作需要，经公司总经理提名，董事会薪酬与提名委员会审核，本公司于2015年9月22日召开第三届董事会第二十次会议，同意聘任许学礼先生为公司副总经理，同时兼任公司合规总监。

根据工作需要，经公司总经理提名，董事会薪酬与提名委员会审核，本公司于2015年9月22日召开第三届董事会第二十次会议，同意聘任张军先生为公司首席风险官。

本公司董事会于2015年3月16日收到公司原董事长陈江旭先生提交的书面辞职报告。因年龄原因，陈江旭先生申请待公司依照法定程序产生新任董事长履职时，辞去公司第三届董事会董事、董事长及第三届董事会各专门委员会职务。根据有关规定，公司接受陈江旭先生的辞职申请，自公司依照法定程序产生新任董事长履职时生效。公司于2015年3月27日召开第三届董事会第十五次会议，审议通过选举魏庆华先生担任公司董事长的议案。

本公司董事会于2015年11月19日收到公司董事陈景耀先生的辞职报告。陈景耀先生因个人工作原因，申请辞去公司第三届董事会董事职务及第三届董事会发展战略委员会

委员职务。

本公司董事会于2015年11月19日收到公司董事徐勇力先生的辞职报告。徐勇力先生因个人工作原因，申请辞去公司第三届董事会董事职务及第三届董事会发展战略委员会主任委员职务。

本公司董事会于2015年10月13日收到公司副总经理高健先生的书面辞呈，高健先生因个人原因申请辞去公司副总经理，以及在公司及控股子公司兼任的一切职务。

### 11.3 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事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所，本报告期应支付给瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用10,000.00元；截至2015年12月31日，该审计机构向本基金提供审计服务不满1年。

### 11.6 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	2	611,669,974.56	100.00%	557,415.13	100.00%	

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重

大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能在租赁其他证券公司的交易单元。

4、本基金本报告期内新增租用2个交易单元，分别为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。

### 11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
东兴证券股份有限公司	41,567,110.71	100.00%	250,200,000.00	100.00%		—

### 11.8 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	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-08-12
2	东兴改革精选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、基金管理人网站	2015-08-12
3	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2015-08-12
4	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-08-12
5	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人网站	2015-08-12

6	东兴改革精选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、基金管理人网站	2015-09-09
7	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金封闭期内周净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-09-14
8	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金封闭期内周净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-09-21
9	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金封闭期内周净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-09-28
10	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金封闭期内周净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-10-12
11	关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司等4家公司为我公司旗下公开募集证券投资基金基金销售机构及开通定投并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-11-25
12	东兴证券股份有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-12-21
13	东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-12-26
14	东兴证券股份有限公司关于参加中国农业银行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-12-30
15	东兴证券股份有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2015-12-31

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会关于核准东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复、营业执照、公司章程

### 12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站([www.fund.dxzq.net](http://www.fund.dxzq.net))查阅。

东兴证券股份有限公司  
二〇一六年三月二十六日