

东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

2016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：2016年8月25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2016年8月19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2016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 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
§ 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 .....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	13
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	18
§ 7 投资组合报告 .....	37
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
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 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	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股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	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 .....	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
§ 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 .....	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
§ 11 备查文件目录 .....	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

## § 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
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	29,534,483.20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	刘建锋	洪渊
	联系电话	021-60586998	010-66105799
	电子邮箱	liujianfeng@donghaifunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		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	易会满

### 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》
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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-11,174,961.62
本期利润	-9,887,025.29
加权平均基金份额本期利润	-0.2764
本期加权平均净值利润率	-27.84%
本期基金份额净值增长率	-24.13%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配利润	745,025.94
期末可供分配基金份额利润	0.0252
期末基金资产净值	30,279,509.14
期末基金份额净值	1.025
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2016年6月30日）
基金份额累计净值增长率	2.50%

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	4.06%	1.63%	-0.07%	0.49%	4.13%	1.14%
过去三个月	3.96%	1.23%	-0.60%	0.50%	4.56%	0.73%

过去六个月	-24.13%	2.03%	-6.64%	0.91%	-17.49%	1.12%
过去一年	-39.95%	2.15%	-12.36%	1.15%	-27.59%	1.00%
自基金合同生效日起 至今（2014年11月14 日-2016年06月30日）	2.50%	2.03%	18.32%	1.14%	-15.82%	0.89%

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；

（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70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、东海中证社会发展安全产业主题性证券投资基金、东海祥瑞债券型证券投资基金。

##### 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		
杜斌	本基金的基金经理	2014年11月14日	—	19年	国籍：中国。经济学学士，中级经济师。曾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等职，2013年2月加入东海基金任公司专户理财部投资经理。现任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的基金经理。
胡德军	本基金的基金	2015年10月27日	—	6年	国籍：中国。上海交通大学生物医学工程博士，曾

	经理			任齐鲁证券有限公司研究所医药行业研究员，2013年6月加入东海基金，历任公司研究开发部高级研究员、专户理财部投资经理等职。现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《证券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，全球经济维持弱势稳定，美联储暂缓加息，而包括中国在内的新兴市场汇率相对稳定。但全球经济局势整体动荡，除美国外主要经济体经济增长并无亮点，风险事件频发，而美联储加息预期扰动市场情绪，牵动各方市场神经；其中英国脱欧公投则成为全球化逆转的重要标志之一。上半年国内经济整体平稳，有企稳迹象，新增信贷或将创历史记录，但每单位资金投入带来的边际经济增长快速递减。

2016年上半年A股呈现大幅波动行情，各主要指数跌幅均较大：上证综指下跌17.22%，沪深300下跌15.45%，中小板和创业板指分别下跌17.88%和下跌17.92%。同时，政策监管逐渐趋严，市场增量资金受到管制，因此市场表现为板块和个股分化日益显著，其中行业基本面有所改善的白酒、家电、OLED、新能源汽车产业链等细分子行业表现较好，而军工、有色等主题板块也呈现阶段性行情。

鉴于国内外错综复杂的经济形势以及A股市场持续分化的市场特征，本报告期内我们遵循产业发展方向和具备估值优势两条选股思路，上半年投资组合主要聚焦新能源汽车、食品饮料以及军工相关产业链，同时适度参与了有色和环保等阶段性行情；在仓位上整体采取谨慎的操作策略，控制风险为主；截至本报告期末，本组合在新能源、食品饮料和医药生物行业的配置较多。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年上半年，本基金净值增长率为-24.13%，业绩基准增长率为-6.64%，跑输业绩比较基准17.49%。自成立以来（2014年11月14日），本基金净值增长率为2.5%，业绩基准增长率为18.32%，跑输业绩比较基准15.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内外经济平稳，但金融市场大幅波动，事件性因素层出不穷，从年初人民币大幅贬值、中国股市熔断、中国经济局部转暖，美联储连续两次会议暂缓加息，再到英国脱欧公投带来的避险情绪再度升温，整个金融市场暗流涌动；展望2016年下半年，世界经济可能持续低迷，国内外经济错综复杂，各国目前基准利率处于历史最低水平、资本过剩、债务高企，叠加日、欧、中、美等国的人口老龄化问题日益严重，都成为中

期制约经济复苏的动能；同时我们也看到，英国脱欧必然将降低欧盟政经地位，使得欧洲地缘政治更加复杂，导致美国加息变得更加谨慎，利好新兴市场；展望国内，M1年初以来持续两位数增长，基建和房地产投资成为经济托底的主导力量，但民间投资增速继续下滑，反映出私营企业仍面临资金成本过高，投资回报率过低，经营困难增加的情况。

预期在未来的一段时间内，经济仍将处于筑底过程中，货币政策或将维持中性。财政政策会进一步发力，通过加速基建投资进度来托底经济增长；通过对于教育、公共服务的投资，带来新的生产力和新的需求；通过放松土地管控，加快土地改革，放松户籍管制，进行超级城市和重点城市群建设；通过整合优势资源和收缩供给侧来压缩产能和提升生产效率，实现资源的合理分配。

鉴于新的资本市场形势，2016年下半年我们将遵循东海美丽中国产品设立之初的投资理念，寻找符合美丽中国的相关产业链上市公司，通过更加勤勉、更加深入地基本面研究，挖掘并投资于行业景气度向上、企业盈利和估值匹配、管理层执行力强且有产业前景的优质公司；具体行业配置方向上，我们进一步挖掘新兴产业，包括新能源汽车、新型材料、新的环保节能工艺、新的消费模式等的投资机会。与此同时，我们仍将盈利模式新颖、具有产业前景的成长股作为我们重点研究和关注的对象。我们也将坚持本基金的核心投资理念，即充分挖掘符合美丽中国主题的相关产业链上市公司，分享新形势下中国经济结构转型中涌现出来的中长期投资机会。

#### 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

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情况出现。本基金资产净值于2016年1月4日至2016年1月29日期间连续20个工作日低于5000万元，并于2016年2月1日恢复至5000万元以上；2016年2月3日再次低于5000万，2016年2月3日至2016年4月27日期间连续55个工作日低于5000万元，并于2016年4月28日恢复至5000万元以上；2016年5月16日再次低于5000万元，截至报告期末，已持续32个交易日。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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2016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：2016年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,238,369.73	2,862,250.45
结算备付金		324,730.55	894,375.20
存出保证金		98,523.83	165,508.99
交易性金融资产	6.4.7.2	21,635,935.52	37,920,117.50
其中：股票投资		21,635,935.52	37,920,117.50
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		1,127,237.46	1,997,930.65
应收利息	6.4.7.5	1,914.03	2,641.37
应收股利		—	—
应收申购款		4,455.53	80,597.37
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		31,431,166.65	43,923,421.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—

应付证券清算款		—	146,461.70
应付赎回款		36,070.22	16,855.31
应付管理人报酬		37,929.71	54,922.23
应付托管费		6,321.60	9,153.69
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	1,021,554.36	1,257,666.45
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	49,781.62	60,000.00
负债合计		1,151,657.51	1,545,059.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	29,534,483.20	31,371,434.70
未分配利润	6.4.7.10	745,025.94	11,006,927.45
所有者权益合计		30,279,509.14	42,378,362.15
负债和所有者权益总计		31,431,166.65	43,923,421.53

注：(1) 报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.025元，基金份额总额29,534,483.2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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入		-9,037,110.90	66,019,828.65
1. 利息收入		83,370.38	41,049.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,559.14	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		23,811.24	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,935,225.68	45,291,506.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,962,253.43	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	27,027.75	251,358.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,287,936.33	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	526,808.07	861,188.83
<b>减：二、费用</b>		849,914.39	1,796,611.37
1. 管理人报酬		264,029.57	814,588.81
2. 托管费		44,004.87	135,764.78
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	491,993.73	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	49,886.22	183,005.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,887,025.29	64,223,217.28

减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-9,887,025.29</b>	<b>64,223,217.28</b>

注：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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016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)	31,371,434.70	11,006,927.45	42,378,362.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-9,887,025.29	-9,887,025.29
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)	-1,836,951.50	-374,876.22	-2,211,827.72
其中：1. 基金申购款	56,269,079.75	-2,049,149.24	54,219,930.51
2. 基金赎回款	-58,106,031.25	1,674,273.02	-56,431,758.23
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)	29,534,483.20	745,025.94	30,279,509.14
项 目	上年度可比期间 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	—	64,223,217.28	64,223,217.28

净值变动数(本期利润)			
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：报表附注为财务报表的组成部分。

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：

葛伟忠

刘建锋

刘宇

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4,609,682.94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4,663,363.74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2016年6月30日的财务状况以及2016上半年的经营成果和净值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。

#### 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[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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

##### 3、 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》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。

#### 4、 个人所得税

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》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》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[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；

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、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8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，持股期限超过1年的，股息红利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 2016年6月30日
活期存款	8,238,369.73
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	8,238,369.73

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		20,452,537.52	21,635,935.52	1,183,398.00
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		20,452,537.52	21,635,935.52	1,183,398.00

#### 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/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,723.63
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	146.10

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	44.30
合计	1,914.03

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,021,554.36
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,021,554.36

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	57.40
预提费用	49,724.22
合计	49,781.62

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,371,434.70	31,371,434.70

本期申购	56,269,079.75	56,269,079.75
本期赎回（以“-”号填列）	-58,106,031.25	-58,106,031.25
本期末	29,534,483.20	29,534,483.20

#### 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	22,942,777.42	-11,935,849.97	11,006,927.45
本期利润	-11,174,961.62	1,287,936.33	-9,887,025.29
本期基金份额交易产生的变动数	-548,638.10	173,761.88	-374,876.22
其中：基金申购款	20,938,682.25	-22,987,831.49	-2,049,149.24
基金赎回款	-21,487,320.35	23,161,593.37	1,674,273.02
本期已分配利润	—	—	—
本期末	11,219,177.70	-10,474,151.76	745,025.94

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	54,460.36
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	3,763.37
其他	1,335.41
合计	59,559.14

#### 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2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-10,962,253.43

股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	-10,962,253.43

**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
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	180,677,419.13
减：卖出股票成本总额	191,639,672.56
买卖股票差价收入	-10,962,253.43

**6.4.7.13 债券投资收益**

**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

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
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	27,027.75
基金投资产生的股利收益	—
合计	27,027.75

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	1,287,936.33
——股票投资	1,287,936.33

——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	1,287,936.33

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	526,808.07
合计	526,808.07

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	491,993.73
银行间市场交易费用	—
合计	491,993.73

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	19,888.96

其他	162.00
合计	49,886.22

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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

本基金本报告期内未发生与本基金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	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	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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例

东海证券股份 有限公司	—	—	74,189,477.00	18.38%
----------------	---	---	---------------	--------

#### 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 2016年1月1日至2016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
东海证券股份 有限公司	—	—	380,418.70	37.24%
关联方名称	上年度可比期间 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
东海证券股份 有限公司	67,542.10	21.48%	380,418.70	67.03%

注：(1)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；

(2)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 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 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	264,029.57	814,588.81
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

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 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 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	44,004.87	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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
期初持有的基金份额	5,724,525.11		—	
期间申购/买入总份额	—		—	
期间因拆分变动份额	—		—	
减：期间赎回/卖出总份额	—		—	
期末持有的基金份额	5,724,525.11		—	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.38%		—	

注：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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	8,238,369.73	54,460.36	12,390,706.53	34,764.32

注：（1）除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2016年1月1日至2016年6月30日止期间获得的利息收入为人民币3,763.37元（无上年度同期可比数据），2016年6月30日结算备付金余额为人民币324,730.55元（无上年度同期可比数据）。

（2）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。

#### 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。

#### 6.4.11 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（2016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

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票等流通受限股票。

##### 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

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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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 2016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	8,238,369.73	—	—	—	—	—	8,238,369.73
存出保证金	98,523.83	—	—				98,523.83
结算备付金	324,730.55	—	—	—	—	—	324,730.55
交易性金融资产	—	—	—	—	—	21,635,935.52	21,635,935.52
应收证券清算款	—	—	—	—	—	1,127,237.46	1,127,237.46
应收利息	—	—	—	—	—	1,914.03	1,914.03
应收申购款	—	—	—	—	—	4,455.53	4,455.53
资产总计	8,661,624.11	—	—	—	—	22,769,542.54	31,431,166.65
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	36,070.22	36,070.22
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	37,929.71	37,929.71

应付托管费	—	—	—	—	—	6,321.60	6,321.60
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,021,554.36	1,021,554.36
其他负债	—	—	—	—	—	49,781.62	49,781.62
负债总计	—	—	—	—	—	1,151,657.51	1,151,657.51
利率敏感度缺口	8,661,624.11	—	—	—	—	21,617,885.03	30,279,509.14
上年度末 2015年12月 31日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,862,250.45	—	—	—	—	—	2,862,250.45
存出保证金	165,508.99	—	—	—	—	—	165,508.99
结算备付金	894,375.20	—	—	—	—	—	894,375.20
交易性金融资产	—	—	—	—	—	37,920,117.50	37,920,117.50
应收证券清算款	—	—	—	—	—	1,997,930.65	1,997,930.65
应收利息	—	—	—	—	—	2,641.37	2,641.37
应收申购款	—	—	—	—	—	80,597.37	80,597.37
资产总计	3,922,134.64	—	—	—	—	40,001,286.89	43,923,421.53
负债							
应付证券清	—	—	—	—	—	146,461	146,461

算款						.70	.70
应付赎回款	—	—	—	—	—	16,855.31	16,855.31
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	54,922.23	54,922.23
应付托管费	—	—	—	—	—	9,153.69	9,153.69
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,257.666.45	1,257.666.45
其他负债	—	—	—	—	—	60,000.00	60,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	1,545,059.38	1,545,059.38
利率敏感度缺口	3,922,134.64	—	—	—	—	38,456,227.51	42,378,362.15

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 2016年6月30日		上年度末 2015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	21,635,935.52	71.45	37,920,117.50	89.48
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	21,635,935.52	71.45	37,920,117.50	89.48

#### 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	业绩比较基准增加1%	308,744.80	539,735.99
	业绩比较基准减少1%	308,744.80	539,735.99

#### 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	21,635,935.52	68.84
	其中：股票	21,635,935.52	68.84
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	8,563,100.28	27.24
7	其他各项资产	1,232,130.85	3.92
8	合计	31,431,166.65	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	16,275,962.20	53.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	787,909.00	2.60
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,146,125.32	7.09
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	795,519.00	2.63
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	804,712.00	2.66
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	825,708.00	2.73
	合计	21,635,935.52	71.45

### 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	002176	江特电机	117,400	1,807,960.00	5.97
2	002108	沧州明珠	49,400	1,279,460.00	4.23
3	300207	欣旺达	42,600	1,093,542.00	3.61
4	002112	三变科技	38,500	986,755.00	3.26
5	002658	雪迪龙	54,800	952,972.00	3.15
6	300072	三聚环保	31,900	881,716.00	2.91
7	600869	智慧能源	85,200	877,560.00	2.90
8	002048	宁波华翔	37,900	866,773.00	2.86
9	002664	信质电机	25,400	864,108.00	2.85
10	002268	卫士通	24,000	857,760.00	2.83
11	002167	东方锆业	77,600	849,720.00	2.81

12	002690	美亚光电	36,555	842,227.20	2.78
13	002104	恒宝股份	51,100	840,084.00	2.77
14	600990	四创电子	9,600	832,224.00	2.75
15	000909	数源科技	40,200	825,708.00	2.73
16	300244	迪安诊断	24,400	804,712.00	2.66
17	601689	拓普集团	24,400	803,980.00	2.66
18	300113	顺网科技	21,017	797,805.32	2.63
19	002400	省广股份	56,300	795,519.00	2.63
20	002245	澳洋顺昌	61,700	787,909.00	2.60
21	002533	金杯电工	56,400	757,452.00	2.50
22	300224	正海磁材	31,900	723,173.00	2.39
23	000568	泸州老窖	17,600	522,720.00	1.73
24	002643	万润股份	9,700	493,536.00	1.63
25	300017	网宿科技	7,300	490,560.00	1.62

#### 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	600030	中信证券	8,493,475.77	20.04
2	002690	美亚光电	4,484,726.73	10.58
3	600184	光电股份	3,996,229.00	9.43
4	600391	成发科技	3,982,131.00	9.40
5	300285	国瓷材料	3,877,699.06	9.15
6	002361	神剑股份	3,396,989.00	8.02
7	600685	中船防务	3,294,847.97	7.77
8	300207	欣旺达	3,289,716.27	7.76
9	000050	深天马 A	3,192,888.00	7.53
10	002589	瑞康医药	2,995,784.50	7.07
11	300182	捷成股份	2,893,209.00	6.83

12	600501	航天晨光	2,498,765.25	5.90
13	600079	人福医药	2,497,003.00	5.89
14	600343	航天动力	2,496,023.00	5.89
15	600482	中国动力	2,494,185.20	5.89
16	300224	正海磁材	2,394,721.74	5.65
17	002466	天齐锂业	2,324,850.00	5.49
18	000756	新华制药	2,196,652.00	5.18
19	002268	卫士通	2,136,975.00	5.04
20	600369	西南证券	1,998,568.00	4.72
21	600172	黄河旋风	1,994,505.00	4.71
22	000568	泸州老窖	1,896,698.00	4.48
23	600137	浪莎股份	1,795,258.00	4.24
24	300068	南都电源	1,743,807.86	4.11
25	002245	澳洋顺昌	1,696,996.42	4.00
26	300059	东方财富	1,695,761.00	4.00
27	002709	天赐材料	1,686,110.00	3.98
28	300203	聚光科技	1,596,697.00	3.77
29	002353	杰瑞股份	1,595,990.00	3.77
30	300198	纳川股份	1,595,975.50	3.77
31	002183	怡亚通	1,595,123.00	3.76
32	300145	中金环境	1,593,627.00	3.76
33	000915	山大华特	1,593,519.00	3.76
34	600277	亿利洁能	1,499,398.00	3.54
35	600677	航天通信	1,499,206.90	3.54
36	002176	江特电机	1,497,502.30	3.53
37	002108	沧州明珠	1,497,195.00	3.53
38	600338	西藏珠峰	1,495,091.62	3.53
39	002292	奥飞娱乐	1,395,274.00	3.29
40	300037	新宙邦	1,394,593.00	3.29
41	300072	三聚环保	1,394,128.08	3.29

42	300262	巴安水务	1,393,612.00	3.29
43	002007	华兰生物	1,384,432.00	3.27
44	300073	当升科技	1,294,207.60	3.05
45	300017	网宿科技	1,285,847.00	3.03
46	603088	宁波精达	1,196,896.00	2.82
47	002508	老板电器	1,196,227.00	2.82
48	002234	民和股份	1,189,920.00	2.81
49	002407	多氟多	1,087,709.00	2.57
50	600329	中新药业	999,414.00	2.36
51	601628	中国人寿	999,020.00	2.36
52	002630	华西能源	998,880.00	2.36
53	600388	龙净环保	998,801.00	2.36
54	002426	胜利精密	994,813.04	2.35
55	601028	玉龙股份	899,682.90	2.12
56	600885	宏发股份	899,545.00	2.12
57	601012	隆基股份	899,469.00	2.12
58	002357	富临运业	899,377.00	2.12
59	000639	西王食品	898,869.86	2.12
60	002658	雪迪龙	898,720.00	2.12
61	000078	海王生物	898,670.04	2.12
62	300296	利亚德	897,883.35	2.12
63	300141	和顺电气	897,695.00	2.12
64	600372	中航电子	897,156.00	2.12
65	600587	新华医疗	896,634.00	2.12
66	600055	华润万东	896,170.28	2.11
67	002182	云海金属	896,020.10	2.11
68	002662	京威股份	895,722.96	2.11
69	300291	华录百纳	895,575.00	2.11
70	300376	易事特	894,711.00	2.11
71	300347	泰格医药	894,572.44	2.11

72	000738	中航动控	894,440.00	2.11
73	300031	宝通科技	893,801.00	2.11
74	600990	四创电子	849,332.00	2.00
75	002167	东方锆业	849,071.00	2.00

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	8,463,541.66	19.97
2	600685	中船防务	5,446,362.36	12.85
3	600501	航天晨光	5,269,606.01	12.43
4	600391	成发科技	5,259,923.82	12.41
5	002690	美亚光电	3,850,545.37	9.09
6	300187	永清环保	3,831,287.79	9.04
7	002268	卫士通	3,771,467.32	8.90
8	300285	国瓷材料	3,734,825.78	8.81
9	600340	华夏幸福	3,695,635.53	8.72
10	600184	光电股份	3,450,861.00	8.14
11	002361	神剑股份	3,373,431.76	7.96
12	002510	天汽模	3,291,611.22	7.77
13	002224	三力士	3,263,308.87	7.70
14	000050	深天马A	3,194,749.77	7.54
15	002589	瑞康医药	3,085,015.67	7.28
16	300182	捷成股份	2,985,347.00	7.04
17	600718	东软集团	2,851,558.06	6.73
18	000920	南方汇通	2,759,815.95	6.51
19	600079	人福医药	2,438,051.34	5.75
20	600343	航天动力	2,387,273.00	5.63
21	300207	欣旺达	2,345,825.90	5.54

22	002466	天齐锂业	2,336,104.88	5.51
23	000988	华工科技	2,073,520.12	4.89
24	600172	黄河旋风	1,950,815.00	4.60
25	300068	南都电源	1,932,068.25	4.56
26	000756	新华制药	1,926,427.21	4.55
27	600137	浪莎股份	1,892,325.76	4.47
28	000915	山大华特	1,817,793.53	4.29
29	600482	中国动力	1,807,096.36	4.26
30	300059	东方财富	1,751,584.00	4.13
31	300198	纳川股份	1,689,735.50	3.99
32	002353	杰瑞股份	1,685,684.00	3.98
33	300224	正海磁材	1,665,481.00	3.93
34	600369	西南证券	1,655,208.00	3.91
35	002709	天赐材料	1,650,016.00	3.89
36	300145	中金环境	1,648,207.20	3.89
37	300203	聚光科技	1,549,581.36	3.66
38	600338	西藏珠峰	1,528,025.00	3.61
39	600677	航天通信	1,491,568.50	3.52
40	002183	怡亚通	1,490,342.00	3.52
41	000568	泸州老窖	1,456,742.00	3.44
42	600277	亿利洁能	1,449,738.00	3.42
43	002407	多氟多	1,422,420.07	3.36
44	300262	巴安水务	1,414,723.85	3.34
45	300037	新宙邦	1,383,695.00	3.27
46	002292	奥飞娱乐	1,365,693.00	3.22
47	002007	华兰生物	1,356,923.00	3.20
48	002234	民和股份	1,279,900.00	3.02
49	300073	当升科技	1,236,635.50	2.92
50	002508	老板电器	1,235,983.00	2.92
51	603088	宁波精达	1,137,524.29	2.68

52	600388	龙净环保	1,043,232.00	2.46
53	002182	云海金属	1,004,872.00	2.37
54	002460	赣锋锂业	1,000,033.00	2.36
55	601628	中国人寿	995,676.00	2.35
56	600329	中新药业	991,603.00	2.34
57	002357	富临运业	991,589.00	2.34
58	300347	泰格医药	967,476.87	2.28
59	002426	胜利精密	953,976.00	2.25
60	000639	西王食品	940,113.22	2.22
61	300141	和顺电气	932,794.00	2.20
62	000738	中航动控	927,562.00	2.19
63	600055	华润万东	926,411.00	2.19
64	300291	华录百纳	924,625.00	2.18
65	002245	澳洋顺昌	917,202.00	2.16
66	600885	宏发股份	910,857.00	2.15
67	300376	易事特	900,900.00	2.13
68	000078	海王生物	900,057.00	2.12
69	002514	宝馨科技	897,078.00	2.12
70	300296	利亚德	889,380.00	2.10
71	300014	亿纬锂能	883,144.00	2.08
72	601028	玉龙股份	868,320.09	2.05
73	002001	新 和 成	867,360.00	2.05
74	000793	华闻传媒	865,536.00	2.04
75	600372	中航电子	862,106.00	2.03
76	600090	同济堂	849,814.00	2.01

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	174,067,554.25
卖出股票的收入（成交）总额	180,677,419.13

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。

## 7.12 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	98,523.83
2	应收证券清算款	1,127,237.46
3	应收股利	—
4	应收利息	1,914.03
5	应收申购款	4,455.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,232,130.85

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
1,074	27,499.52	7,999,980.16	27.09%	21,534,503.04	72.91%

### 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	54,350.84	0.18%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 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	31,371,434.70
本报告期基金总申购份额	56,269,079.75
减：本报告期基金总赎回份额	58,106,031.25
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	29,534,483.20

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、基金管理人2016年1月13日公告，朱科敏先生不再担任公司董事长，由总经理葛伟忠代为履行董事长职责。

2、《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》于2016年3月24日正式生效，杜斌先生、祝鸿玲女士任该基金的基金经理。

3、基金管理人2016年4月15日公告，新任葛伟忠先生为公司董事长。

4、基金管理人2016年4月15日公告，新任刘建锋先生为公司总经理，葛伟忠先生不再担任公司总经理。

5、基金管理人2016年6月24日公告，刘清先生不再担任公司督察长，由总经理刘建锋先生代为履行督察长职责。

6、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	
广发证券股份有限公司	2	137,581,560.76	38.78%	125,378.82	44.8%	—

德邦证券股份有限公司	2	126,084,386.79	35.54%	89,684.94	32.05%	—
恒泰证券股份有限公司	2	91,079,025.83	25.67%	64,784.5	23.15%	—
中国银河证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
招商证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
海通证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
申万宏源证券有限公司	2	—	—	—	—	—
华鑫证券有限公司	2	—	—	—	—	—
太平洋证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
东海证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—

## 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	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额比例
广发证券股份有限公司	—	—
德邦证券股份有限公司	—	—
恒泰证券股份有限公司	114,000,000	100%
中国银河证券股份有限公司	—	—
招商证券股份有限公司	—	—
海通证券股份有限公司	—	—
申万宏源证券有限公司	—	—

华鑫证券有限公司	—	—
太平洋证券股份有限公司	—	—
东海证券股份有限公司	—	—

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。

3、此处的佣金指基金通过单一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的合计，不单指股票交易佣金。

## 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	《关于旗下开放式基金2015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》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-04
2	《东海基金管理有限责任公司关于指数发生不可恢复熔断的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-07
3	《东海基金管理有限责任公司关于指数发生不可恢复熔断的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-07
4	《东海基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-13

		)	
5	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-20
6	《东海基金管理有限责任公司关于暂停通联支付渠道浦发银行卡部分业务的通知》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-21
7	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金新增销售机构并参加费率优惠活动的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-01-23
8	《东海基金管理有限责任公司关于恢复通联支付渠道浦发银行卡部分业务的通知》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-02-03
9	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告正文及摘要》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-03-28
10	《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)	2016-03-29
11	《东海基金管理有限责任公司关于参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016-03-29
12	《东海基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告》	《上海证券报》和基金管理人网站	2016-04-15

		(www.donghaifunds.com )	
13	《东海基金管理有限责任公司关于董事长任职的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2016-04-15
14	《东海基金管理有限责任公司关于参加银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2016-04-18
15	《东海基金管理有限责任公司关于公司网站系统改版升级的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2016-04-21
16	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2016-04-22
17	《东海基金管理有限责任公司关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2016-04-26
18	《东海基金管理有限责任公司关于网上直销实施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 )	2016-05-20
19	《东海基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com )	2016-06-24

20	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2016年第1号）正文及摘要》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站（www.donghaifunds.com）	2016-06-27
----	---	--	------------

## § 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

二〇一六年八月二十五日