

# 东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 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 2017 年 3 月 24 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53

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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
8.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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的情况 .....	55
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
11.4 基金投资策略的改变 .....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	58
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误!未定义书签。</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	61
13.3 查阅方式 .....	62

## § 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	25,140,698.65 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	王恒	郭明

	联系电话	021-60586966	010-66105799
	电子邮箱	wangheng@donghaifunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-9595531	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	100032
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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.donghaifunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、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

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 11 月 14 日 (基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-11,677,374.01	46,912,906.43	5,210,522.61
本期利润	-12,157,469.42	52,594,027.91	-575,137.20
加权平均基金份额本期利润	-0.390	0.878	-0.002
本期加权平均净值利润率	-39.20%	68.39%	-0.17%
本期基金份额净值增长率	-30.94%	38.00%	-2.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-1,681,589.36	11,006,927.45	-4,228,115.50

期末可供分配基金份额利润	-0.0669	0.3509	-0.0205
期末基金资产净值	23,459,109.29	42,378,362.15	201,999,779.53
期末基金份额净值	0.933	1.351	0.979
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	-6.70%	35.10%	-2.10%

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) 本基金合同生效日为 2014 年 11 月 14 日，至本报告期末未满三年。

## 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

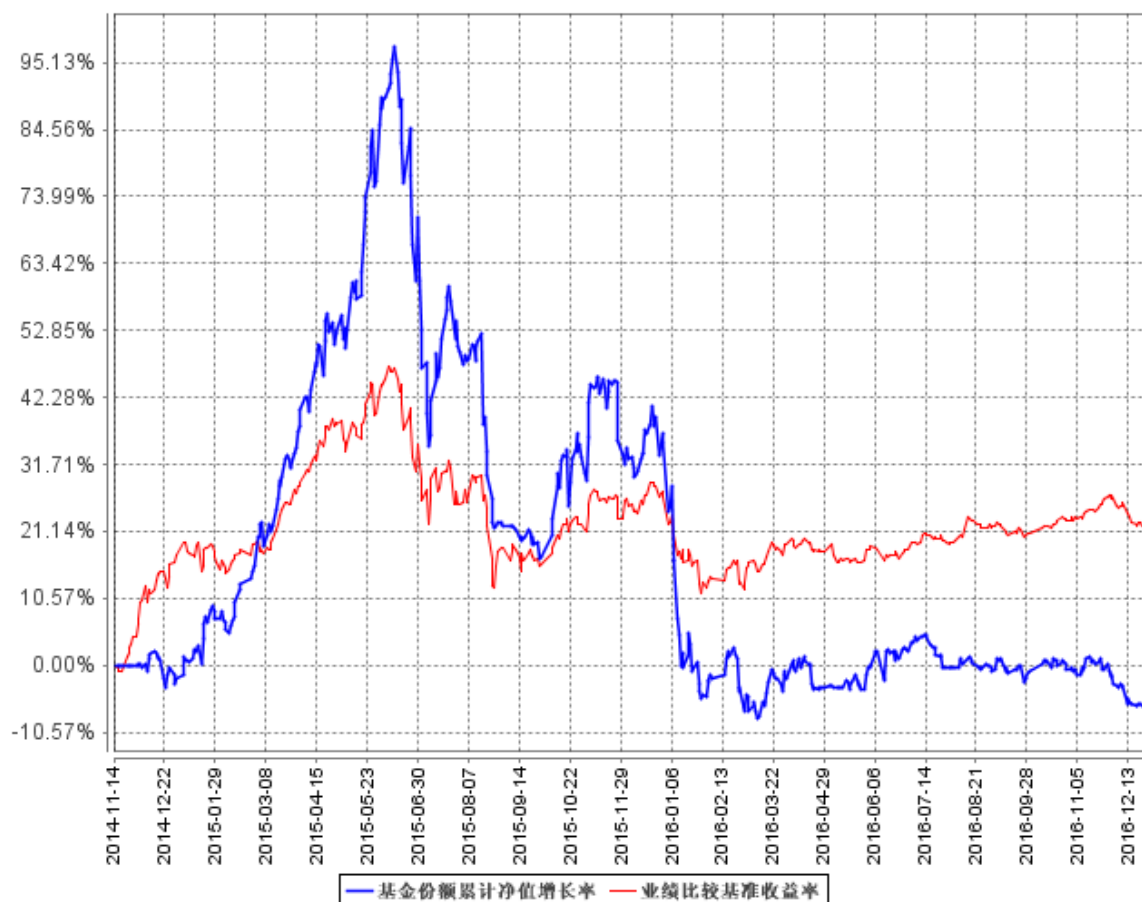
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.76%	0.68%	0.92%	0.36%	-6.68%	0.32%
过去六个月	-8.98%	0.67%	3.22%	0.38%	-12.20%	0.29%
过去一年	-30.94%	1.51%	-3.64%	0.70%	-27.30%	0.81%
自基金合同生效起至今	-6.70%	1.80%	22.13%	1.01%	-28.83%	0.79%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



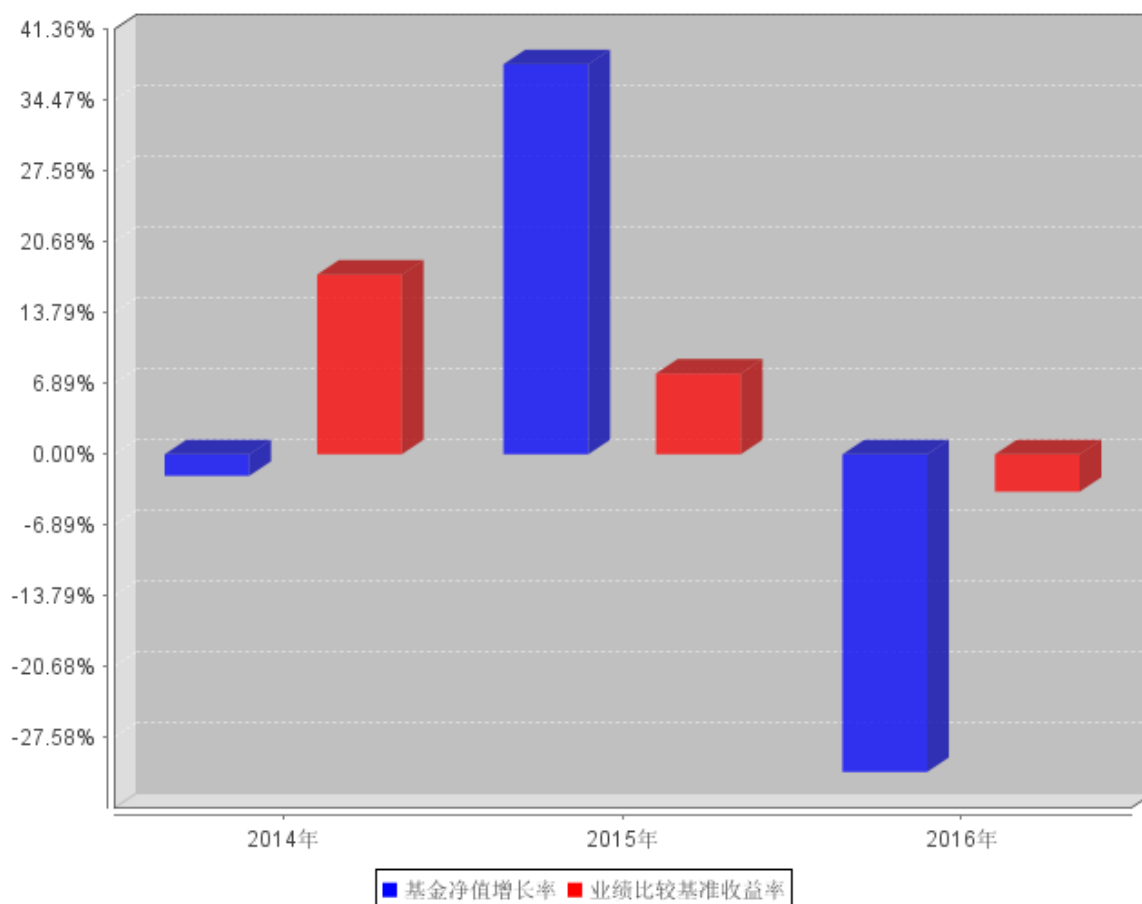
注：（1）本基金合同生效日为 2014 年 11 月 14 日；

（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%。



### 3.2.3 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

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对比图



注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 14 日，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

注：自 2014 年 11 月 14 日基金合同生效日以来，本基金未进行分红。

## § 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，本基金管理人管理的基金有东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金、东海祥瑞债券型证券投资基金和东海祥龙定增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（助理）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	-	20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和东海祥瑞债券型证券投资基金的基金经理。
胡德军	本基金的基金经理	2015年10月27日	-	8年	国籍：中国。上海交通大学生物医学工程博士，曾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和东海祥龙定增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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易制度》，该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。

公司通过交易系统强制进行公平交易，对不通过交易系统进行的交易，风险管理部遵照《公平交易制度》逐笔审核，确保交易公平。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

### 4.3.3 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，并定期对组合间的同向交易分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。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

2016 年，A 股市场受熔断和美国加息影响导致市场大幅下挫，甚至一度流动性枯竭，由于 A 股投资以散户为主的结构特征，跟风操作更是加剧了市场恐慌，市场风险偏好大幅下降，投资环境大幅恶化。从国际形势看，2016 年国际政治错综复杂，黑天鹅频出，英国脱欧、特朗普“意外”当选美国总统，同时叠加美联储进入加息周期，全球金融动荡，经济低迷。在美国加息刺激下，2016 年美元持续走强，人民币汇率承压，国内贬值预期和资本外流压力加剧，同时随着国内金融去杠杆的推进，实际利率触底回升，A 股流动性持续紧张。从 A 股市场看，得益于国家财政支出的经济刺激政策，国内经济在下半年逐渐好转，PMI 和 PPI 逐渐回升，经济有触底回升迹象，这在一定程度上扭转了市场对传统行业的悲观预期，传统企业盈利持续改善；但同时以创业板为首的新兴产业盈利改善相对较小，特别是随着 IPO 加速，更多的创业型公司登陆 A 股，新兴产业板块估值不断下移。本报告期内，东海美丽中国在整体操作上采取了相对比较谨慎的策略，但受制于年初 A 股熔断，因此在持仓上相对较为谨慎，同时在配置上偏重于蓝筹加成长策略，全年来看配置效果不甚理想，跑输同期基准。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，本基金净值增长率为-30.94%，业绩基准增长率为-3.64%，低于业绩比较基准 27.30%。自成立以来（2014 年 11 月 14 日），本基金净值增长率为-6.70%，业绩基准增长率为 22.13%，低于业绩比较基准 28.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，美国新任总统特朗普上台让全球经济和外交形势变得的错综复杂，而美国的持续加息可能导致新兴经济体资本外流加速，因此人民币汇率可能面临持续贬值压力。但同时我们也看到国内经济 2016 年下半年开始持续回暖，2016 年 PMI 创两年新高，PPI 由负转正之后持续上升，考虑到 PMI 指数中的新订单指数在持续创新高，有理由相信工业生产在未来一段时间依然保持稳中向上的趋势。本报告期内，我们将坚持建设美丽中国的投资主线，布局及于生态环保、先进制造及部分受益于国家经济刺激措施的行业，从这些行业中精选估值相对较低的个股积极布局。

#### 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，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司监察稽核部门在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全风险管理体系，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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，2016 年 5 月 16 日至 2016 年 8 月 2 日期间连续 55 个工作日低于 5000 万元，并于 2016 年 8 月 03 日恢复至 5000 万元以上；2016 年 8 月 9 日再次低于 5000 万元以下，2016 年 8 月 9 日至 2016 年 12 月 30 日期间连续 96 个工作日低于 5000 万元；截至报告期末，已持续 97 个交易日。本基金管理人已经将该基金情况向证监会报备，将持续关注本基金资产净值情况，下一步本基金管理人将进行持续营销，力争基金净值尽快回升并稳定在五千万以上。

## § 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——东海基金管理有限责任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责任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 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	安永华明（2017）审字第 61047315_B01 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	东海美丽中国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海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（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	编制和公允列报财务报表是基金管理人东海基金管理有限责任公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对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财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关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财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与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基金管理人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企业会计准则的规定编制，公允反映了东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	印艳萍
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东城区长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,372,654.65	2,862,250.45
结算备付金		410,294.50	894,375.20
存出保证金		38,818.00	165,508.99
交易性金融资产	7.4.7.2	11,164,090.86	37,920,117.50
其中：股票投资		11,164,090.86	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,587,108.86	1,997,930.65
应收利息	7.4.7.5	2,131.51	2,641.37
应收股利		-	-
应收申购款		17,383.70	80,597.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		24,592,482.08	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	146,461.70
应付赎回款		2,436.19	16,855.31
应付管理人报酬		30,531.55	54,922.23
应付托管费		5,088.61	9,153.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,035,308.88	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	7.4.7.8	60,007.56	60,000.00
负债合计		1,133,372.79	1,545,059.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	25,140,698.65	31,371,434.70
未分配利润	7.4.7.10	-1,681,589.36	11,006,927.45
所有者权益合计		23,459,109.29	42,378,362.15
负债和所有者权益总计		24,592,482.08	43,923,421.53

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.933 元，基金份额总额 25,140,698.65 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-10,550,454.74	56,200,430.98
1. 利息收入		134,754.12	114,703.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	101,622.93	106,411.26
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		33,131.19	8,292.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,965,414.85	49,190,641.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-11,039,967.31	48,910,557.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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	74,552.46	280,083.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-480,095.41	5,681,121.48
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	760,301.40	1,213,964.14
<b>减：二、费用</b>		1,607,014.68	3,606,403.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	467,134.27	1,165,468.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	77,855.66	194,244.78
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	957,202.75	1,817,690.22
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	104,822.00	428,999.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,157,469.42	52,594,027.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,157,469.42	52,594,027.91

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	-12,157,469.42	-12,157,469.42
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）	-6,230,736.05	-531,047.39	-6,761,783.44
其中：1. 基金申购款	87,976,828.15	-2,163,533.40	85,813,294.75
2. 基金赎回款	-94,207,564.20	1,632,486.01	-92,575,078.19

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）	25,140,698.65	-1,681,589.36	23,459,109.29
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	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）	-	52,594,027.91	52,594,027.91
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）	-174,856,460.33	-37,358,984.96	-212,215,445.29
其中：1. 基金申购款	83,427,256.27	31,072,958.68	114,500,214.95
2. 基金赎回款	-258,283,716.60	-68,431,943.64	-326,715,660.24
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）	31,371,434.70	11,006,927.45	42,378,362.15

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：

<u>          刘建锋          </u>	<u>          刘建锋          </u>	<u>          刘宇          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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《关于准予东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由东海基金管理有限责任公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2014 年 11 月 14 日生效，首次设立募集规模为 404,663,363.74 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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%。

#### 7.4.2 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 2 号《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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、《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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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为股票投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等

##### (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。

#### 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

##### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

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，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

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；

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。

#### 金融资产转移

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证

具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍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，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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) 资产支持证券投资收益/(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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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。

#### 7.4.4.10 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 1.50%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) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购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；

(4) 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。

#### 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 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。

#### 7.4.4.12 分部报告

-

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1. 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。

#### 7.4.6.2. 营业税、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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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。

### 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	5,372,654.65	2,862,250.45
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,372,654.65	2,862,250.45

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		11,748,724.60	11,164,090.86	-584,633.74
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		11,748,724.60	11,164,090.86	-584,633.74
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		38,024,655.83	37,920,117.50	-104,538.33
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		38,024,655.83	37,920,117.50	-104,538.33

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均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

注：本基金本报告末及上年度末均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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,909.20	2,116.89
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	203.06	442.64
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	19.25	81.84
合计	2,131.51	2,641.37

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,035,308.88	1,257,666.45
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,035,308.88	1,257,666.45

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7.56	-
应付审计费	60,000.00	60,000.00
合计	60,007.56	60,000.00

### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	87,976,828.15	87,976,828.15
本期赎回 (以“-”号填列)	-94,207,564.20	-94,207,564.20
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	25,140,698.65	25,140,698.65

#### 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
上年度末	22,942,777.42	-11,935,849.97	11,006,927.45
本期利润	-11,677,374.01	-480,095.41	-12,157,469.42
本期基金份额交易产生的变动数	-2,360,629.90	1,829,582.51	-531,047.39
其中：基金申购款	32,895,993.64	-35,059,527.04	-2,163,533.40
基金赎回款	-35,256,623.54	36,889,109.55	1,632,486.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,904,773.51	-10,586,362.87	-1,681,589.36

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	91,930.74	93,644.35
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,771.58	1,796.61
结算备付金利息收入	6,093.86	10,052.18
其他	1,826.75	918.12
合计	101,622.93	106,411.26

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	343,860,448.89	697,650,764.30
减：卖出股票成本总额	354,900,416.20	648,740,206.50
买卖股票差价收入	-11,039,967.31	48,910,557.80

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	74,552.46	280,083.97
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	74,552.46	280,083.97

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-480,095.41	5,681,121.48
——股票投资	-480,095.41	5,681,121.48
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-480,095.41	5,681,121.48

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	760,301.40	1,213,964.14
合计	760,301.40	1,213,964.14



### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	957,202.75	1,817,690.22
银行间市场交易费用	-	-
合计	957,202.75	1,817,690.22

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	40,000.00	368,686.28
银行费用	4,822.00	313.00
合计	104,822.00	428,999.28

### 7.4.7.21 分部报告

-

## 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

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金本报告期末无需要披露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。

## 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

#### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	101,388,244.36	15.07%	74,189,477.00	6.24%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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 2016年1月1日至2016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
东海证券股份 有限公司	94,422.92	17.04%	474,841.62	45.86%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1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
东海证券股份 有限公司	67,542.10	6.72%	380,418.70	30.25%

注：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。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。

### 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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	467,134.27	1,165,468.79
其中：支付销售机构的客 户维护费	124,655.81	333,549.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金管理费

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	77,855.66	194,244.78

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

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

H 为每日应支付的基金托管费

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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期间与上年度可比期间均无销售服务费。

### 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

注：本基金本报告期及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

### 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2014 年 11 月 14 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,724,525.11	-
期间申购/买入总份额	-	5,724,525.11
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	5,724,525.11
期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.7700%	18.2500%

注：基金管理人申购本基金份额时所适用的费率与本基金公告的费率一致。期间申购/买入总份额含转换入份额；期间因拆分变动份额含红利再投份额；期间赎回/卖出总份额转换出份额。

#### 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	5,372,654.65	91,930.74	2,862,250.45	93,644.35

注：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 年度获得的利息收入为人民币 6,093.86 元（2015 年度获得的利息收入：10,052.18 元），2016 年末结算备付金余额为人民币 410,294.50 元（2015 年末：894,375.20 元）。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 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

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2016 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规与风险管理委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

### 7.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

于 2016 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因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	5,372,654.65	-	-	-	-	-	5,372,654.65
结算备付金	410,294.50	-	-	-	-	-	410,294.50
存出保证金	38,818.00	-	-	-	-	-	38,818.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	11,164,090.86	11,164,090.86
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,587,108.86	7,587,108.86
应收利息	-	-	-	-	-	2,131.51	2,131.51
应收申购款	-	-	-	-	-	17,383.70	17,383.70
资产总计	5,821,767.15	-	-	-	-	18,770,714.93	24,592,482.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,436.19	2,436.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,531.55	30,531.55
应付托管费	-	-	-	-	-	5,088.61	5,088.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,035,308.88	1,035,308.88
其他负债	-	-	-	-	-	60,007.56	60,007.56
负债总计	-	-	-	-	-	1,133,372.79	1,133,372.79
利率敏感度缺口	5,821,767.15	-	-	-	-	-17,637,342.14	23,459,109.29
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
结算备付金	894,375.20	-	-	-	-	-	894,375.20
存出保证金	165,508.99	-	-	-	-	-	165,508.99
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
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,922,134.64	-	-	-	-	40,001,286.89	43,923,421.53
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	146,461.70	146,461.70
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 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

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，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的股票，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	11,164,090.86	47.59	37,920,117.50	89.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,164,090.86	47.59	37,920,117.50	89.48

注：本基金投资组合中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%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上图。

#### 7.4.13.4.3.2 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。		
	2、以下分析中，除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	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。		
	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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准增加 1%	752,685.23	539,735.99
	业绩比较基准减少 1%	-752,685.23	-539,735.99

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 11,164,090.86 元，无划分为第二层次和第三层次的余额。（于 2015 年 12 月 31 日，第一层级层次的余额为人民币 37,920,117.50 元，无划分为第二层次和第三层次的余额）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项  
截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 23,459,109.29 元，已连续超过 96 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，在本基金 2016 年 4 季度报告中进行了披露。本基金管理人已经将该基金情况向证监会报备，将持续关注本基金资产净值情况，下一步本基金管理人将进行持续营销，力争基金净值尽快回升并稳定在五千万以上。

除此以外，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	11,164,090.86	45.40
	其中：股票	11,164,090.86	45.40
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	5,782,949.15	23.52
7	其他各项资产	7,645,442.07	31.09
8	合计	24,592,482.08	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	693,384.00	2.96
C	制造业	7,933,522.86	33.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	642,984.00	2.74
F	批发和零售业	1,894,200.00	8.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,164,090.86	47.59

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 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	600529	山东药玻	38,276	813,747.76	3.47
2	002475	立讯精密	34,400	713,800.00	3.04
3	000568	泸州老窖	21,600	712,800.00	3.04
4	600699	均胜电子	21,400	708,126.00	3.02
5	600297	广汇汽车	81,300	695,928.00	2.97
6	601899	紫金矿业	207,600	693,384.00	2.96
7	600038	中直股份	14,300	692,406.00	2.95
8	600183	生益科技	61,200	673,200.00	2.87
9	002758	华通医药	22,550	668,382.00	2.85
10	600820	隧道股份	58,400	642,984.00	2.74
11	000422	湖北宜化	80,000	636,000.00	2.71
12	000651	格力电器	24,300	598,266.00	2.55
13	002636	金安国纪	34,300	560,805.00	2.39
14	000858	五粮液	15,400	530,992.00	2.26
15	002556	辉隆股份	51,000	529,890.00	2.26
16	300387	富邦股份	14,600	448,220.00	1.91
17	000930	中粮生化	25,300	340,032.00	1.45
18	603020	爱普股份	13,000	264,420.00	1.13
19	000820	神雾节能	8,329	240,708.10	1.03

### 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	9,390,219.77	22.16
2	002245	澳洋顺昌	6,189,115.42	14.60
3	002690	美亚光电	6,178,380.73	14.58
4	300182	捷成股份	5,988,561.00	14.13
5	000423	东阿阿胶	5,063,383.50	11.95

6	300068	南都电源	4,084,949.86	9.64
7	600184	光电股份	3,996,229.00	9.43
8	600391	成发科技	3,982,131.00	9.40
9	600362	江西铜业	3,883,455.00	9.16
10	300285	国瓷材料	3,877,699.06	9.15
11	600079	人福医药	3,789,868.00	8.94
12	002361	神剑股份	3,396,989.00	8.02
13	600685	中船防务	3,294,847.97	7.77
14	300059	东方财富	3,293,423.00	7.77
15	300207	欣旺达	3,289,716.27	7.76
16	000568	泸州老窖	3,281,255.50	7.74
17	600529	山东药玻	3,200,932.00	7.55
18	000050	深天马A	3,192,888.00	7.53
19	600277	亿利洁能	3,097,439.36	7.31
20	000426	兴业矿业	3,047,181.88	7.19
21	002589	瑞康医药	2,995,784.50	7.07
22	002533	金杯电工	2,936,436.00	6.93
23	601688	华泰证券	2,891,039.00	6.82
24	002108	沧州明珠	2,888,175.02	6.82
25	300037	新宙邦	2,786,526.00	6.58
26	002758	华通医药	2,785,179.50	6.57
27	002007	华兰生物	2,574,316.00	6.07
28	002271	东方雨虹	2,547,226.82	6.01
29	600501	航天晨光	2,498,765.25	5.90
30	600343	航天动力	2,496,023.00	5.89
31	600482	中国动力	2,494,185.20	5.89
32	300145	中金环境	2,491,229.00	5.88
33	300224	正海磁材	2,394,721.74	5.65
34	000915	山大华特	2,393,191.00	5.65
35	002268	卫士通	2,335,641.00	5.51
36	002466	天齐锂业	2,324,850.00	5.49
37	600976	健民集团	2,282,102.00	5.39
38	000756	新华制药	2,196,652.00	5.18
39	600392	盛和资源	2,144,202.00	5.06
40	600297	广汇汽车	2,097,935.00	4.95
41	002182	云海金属	2,049,053.00	4.84

42	000937	冀中能源	2,047,373.62	4.83
43	600369	西南证券	1,998,568.00	4.72
44	600172	黄河旋风	1,994,505.00	4.71
45	300296	利亚德	1,897,722.35	4.48
46	300255	常山药业	1,834,915.08	4.33
47	600137	浪莎股份	1,795,258.00	4.24
48	600259	广晟有色	1,793,244.00	4.23
49	600702	沱牌舍得	1,745,025.00	4.12
50	600055	万东医疗	1,744,918.48	4.12
51	300345	红宇新材	1,694,005.00	4.00
52	002709	天赐材料	1,686,110.00	3.98
53	300014	亿纬锂能	1,680,754.00	3.97
54	002112	三变科技	1,645,883.00	3.88
55	000983	西山煤电	1,617,014.00	3.82
56	002514	宝馨科技	1,597,249.00	3.77
57	300203	聚光科技	1,596,697.00	3.77
58	002353	杰瑞股份	1,595,990.00	3.77
59	300198	纳川股份	1,595,975.50	3.77
60	002183	怡亚通	1,595,123.00	3.76
61	002664	信质电机	1,593,145.00	3.76
62	600677	航天通信	1,499,206.90	3.54
63	300244	迪安诊断	1,498,369.79	3.54
64	002176	江特电机	1,497,502.30	3.53
65	002155	湖南黄金	1,497,481.58	3.53
66	601699	潞安环能	1,496,551.00	3.53
67	600338	西藏珠峰	1,495,091.62	3.53
68	600779	水井坊	1,494,340.00	3.53
69	000776	广发证券	1,448,593.00	3.42
70	600395	盘江股份	1,443,826.58	3.41
71	600535	天士力	1,429,073.00	3.37
72	300136	信维通信	1,413,729.10	3.34
73	000902	新洋丰	1,397,846.00	3.30
74	600219	南山铝业	1,395,625.00	3.29
75	002292	奥飞娱乐	1,395,274.00	3.29
76	300072	三聚环保	1,394,128.08	3.29
77	300262	巴安水务	1,393,612.00	3.29

78	600566	济川药业	1,386,399.00	3.27
79	603869	北部湾旅	1,379,837.00	3.26
80	000858	五粮液	1,345,770.45	3.18
81	000820	神雾节能	1,342,103.40	3.17
82	600418	江淮汽车	1,334,044.00	3.15
83	300070	碧水源	1,297,850.00	3.06
84	600820	隧道股份	1,297,657.00	3.06
85	000822	山东海化	1,297,112.00	3.06
86	300073	当升科技	1,294,207.60	3.05
87	300017	网宿科技	1,285,847.00	3.03
88	002643	万润股份	1,242,520.00	2.93
89	603088	宁波精达	1,196,896.00	2.82
90	002508	老板电器	1,196,227.00	2.82
91	600276	恒瑞医药	1,195,956.00	2.82
92	002281	光迅科技	1,194,990.00	2.82
93	002234	民和股份	1,189,920.00	2.81
94	000651	格力电器	1,146,509.00	2.71
95	002407	多氟多	1,087,709.00	2.57
96	002167	东方锆业	1,047,791.00	2.47
97	600612	老凤祥	1,038,165.00	2.45
98	600329	中新药业	999,414.00	2.36
99	601628	中国人寿	999,020.00	2.36
100	002630	华西能源	998,880.00	2.36
101	600388	龙净环保	998,801.00	2.36
102	002048	宁波华翔	997,777.00	2.35
103	300144	宋城演艺	996,694.15	2.35
104	000878	云南铜业	995,712.00	2.35
105	002426	胜利精密	994,813.04	2.35
106	601600	中国铝业	978,740.00	2.31
107	600512	腾达建设	927,729.00	2.19
108	603085	天成自控	909,698.25	2.15
109	601028	玉龙股份	899,682.90	2.12
110	600885	宏发股份	899,545.00	2.12
111	601012	隆基股份	899,469.00	2.12
112	002357	富临运业	899,377.00	2.12
113	000639	西王食品	898,869.86	2.12



114	002658	雪迪龙	898,720.00	2.12
115	000078	海王生物	898,670.04	2.12
116	300141	和顺电气	897,695.00	2.12
117	600372	中航电子	897,156.00	2.12
118	600138	中青旅	897,084.00	2.12
119	002241	歌尔股份	896,953.00	2.12
120	600587	新华医疗	896,634.00	2.12
121	002662	京威股份	895,722.96	2.11
122	300291	华录百纳	895,575.00	2.11
123	300376	易事特	894,711.00	2.11
124	300347	泰格医药	894,572.44	2.11
125	000738	中航动控	894,440.00	2.11
126	300031	宝通科技	893,801.00	2.11
127	600211	西藏药业	891,005.00	2.10
128	002087	新野纺织	849,523.00	2.00
129	600990	四创电子	849,332.00	2.00
130	002235	安妮股份	848,907.00	2.00
131	002454	松芝股份	848,593.04	2.00
132	300220	金运激光	847,782.00	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。

#### 8.4.2 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	9,357,901.66	22.08
2	002690	美亚光电	6,353,988.72	14.99
3	300182	捷成股份	5,966,163.78	14.08
4	002245	澳洋顺昌	5,759,783.00	13.59
5	600685	中船防务	5,446,362.36	12.85
6	600501	航天晨光	5,269,606.01	12.43
7	600391	成发科技	5,259,923.82	12.41
8	000423	东阿阿胶	4,968,438.00	11.72
9	002268	卫士通	4,836,279.76	11.41
10	300068	南都电源	4,338,608.75	10.24
11	600362	江西铜业	3,869,790.38	9.13
12	300187	永清环保	3,831,287.79	9.04

13	300285	国瓷材料	3,734,825.78	8.81
14	600340	华夏幸福	3,695,635.53	8.72
15	600079	人福医药	3,625,551.34	8.56
16	600184	光电股份	3,450,861.00	8.14
17	300207	欣旺达	3,426,375.12	8.09
18	002361	神剑股份	3,373,431.76	7.96
19	002510	天汽模	3,291,611.22	7.77
20	002224	三力士	3,263,308.87	7.70
21	300059	东方财富	3,261,049.00	7.70
22	600718	东软集团	3,211,779.06	7.58
23	000050	深天马A	3,194,749.77	7.54
24	002589	瑞康医药	3,085,015.67	7.28
25	002108	沧州明珠	3,073,397.50	7.25
26	600277	亿利洁能	3,064,511.68	7.23
27	000426	兴业矿业	2,959,179.60	6.98
28	601688	华泰证券	2,831,576.00	6.68
29	002533	金杯电工	2,804,433.00	6.62
30	000920	南方汇通	2,759,815.95	6.51
31	300037	新宙邦	2,695,416.00	6.36
32	000568	泸州老窖	2,636,048.10	6.22
33	000915	山大华特	2,626,111.53	6.20
34	300145	中金环境	2,540,845.20	6.00
35	002271	东方雨虹	2,527,064.00	5.96
36	002007	华兰生物	2,509,404.00	5.92
37	600529	山东药玻	2,416,549.86	5.70
38	300224	正海磁材	2,412,315.00	5.69
39	600343	航天动力	2,387,273.00	5.63
40	002466	天齐锂业	2,336,104.88	5.51
41	600976	健民集团	2,253,855.00	5.32
42	002182	云海金属	2,135,872.50	5.04
43	002758	华通医药	2,132,012.68	5.03
44	000988	华工科技	2,073,520.12	4.89
45	600392	盛和资源	2,043,209.00	4.82
46	600172	黄河旋风	1,950,815.00	4.60
47	000756	新华制药	1,926,427.21	4.55
48	000937	冀中能源	1,923,334.31	4.54
49	600137	浪莎股份	1,892,325.76	4.47
50	600259	广晟有色	1,888,813.12	4.46

51	300296	利亚德	1,850,972.00	4.37
52	300255	常山药业	1,830,754.40	4.32
53	600482	中国动力	1,807,096.36	4.26
54	002176	江特电机	1,797,873.00	4.24
55	002112	三变科技	1,794,733.50	4.24
56	600702	沱牌舍得	1,785,523.00	4.21
57	600055	万东医疗	1,780,622.20	4.20
58	300198	纳川股份	1,689,735.50	3.99
59	002353	杰瑞股份	1,685,684.00	3.98
60	002514	宝馨科技	1,682,768.00	3.97
61	300072	三聚环保	1,662,449.80	3.92
62	300014	亿纬锂能	1,661,090.00	3.92
63	600369	西南证券	1,655,208.00	3.91
64	002709	天赐材料	1,650,016.00	3.89
65	300345	红宇新材	1,642,359.00	3.88
66	601699	潞安环能	1,630,230.21	3.85
67	000983	西山煤电	1,605,591.69	3.79
68	002664	信质电机	1,573,406.00	3.71
69	300203	聚光科技	1,549,581.36	3.66
70	600338	西藏珠峰	1,528,025.00	3.61
71	002155	湖南黄金	1,513,271.00	3.57
72	600779	水井坊	1,500,783.95	3.54
73	600677	航天通信	1,491,568.50	3.52
74	002183	怡亚通	1,490,342.00	3.52
75	300136	信维通信	1,466,211.95	3.46
76	000776	广发证券	1,464,925.00	3.46
77	300244	迪安诊断	1,457,761.00	3.44
78	603869	北部湾旅	1,433,914.00	3.38
79	600219	南山铝业	1,424,678.00	3.36
80	000902	新洋丰	1,423,773.82	3.36
81	002407	多氟多	1,422,420.07	3.36
82	300262	巴安水务	1,414,723.85	3.34
83	600395	盘江股份	1,403,052.00	3.31
84	000820	神雾节能	1,389,257.39	3.28
85	600535	天士力	1,386,798.00	3.27
86	600566	济川药业	1,384,047.69	3.27
87	600297	广汇汽车	1,382,180.79	3.26
88	002292	奥飞娱乐	1,365,693.00	3.22

89	000822	山东海化	1,332,213.00	3.14
90	600418	江淮汽车	1,328,716.00	3.14
91	300017	网宿科技	1,292,778.00	3.05
92	002234	民和股份	1,279,900.00	3.02
93	300070	碧水源	1,270,919.14	3.00
94	300073	当升科技	1,236,635.50	2.92
95	002508	老板电器	1,235,983.00	2.92
96	002281	光迅科技	1,213,434.00	2.86
97	600276	恒瑞医药	1,200,972.00	2.83
98	002643	万润股份	1,192,804.51	2.81
99	603088	宁波精达	1,137,524.29	2.68
100	600512	腾达建设	1,122,060.00	2.65
101	002167	东方锆业	1,108,049.00	2.61
102	600612	老凤祥	1,082,555.00	2.55
103	600388	龙净环保	1,043,232.00	2.46
104	300144	宋城演艺	1,021,147.54	2.41
105	002048	宁波华翔	1,005,238.00	2.37
106	002460	赣锋锂业	1,000,033.00	2.36
107	601628	中国人寿	995,676.00	2.35
108	600329	中新药业	991,603.00	2.34
109	002357	富临运业	991,589.00	2.34
110	600211	西藏药业	989,804.00	2.34
111	000878	云南铜业	983,289.15	2.32
112	300347	泰格医药	967,476.87	2.28
113	002235	安妮股份	966,992.00	2.28
114	002658	雪迪龙	961,474.16	2.27
115	002426	胜利精密	953,976.00	2.25
116	000639	西王食品	940,113.22	2.22
117	300141	和顺电气	932,794.00	2.20
118	002241	歌尔股份	930,210.00	2.20
119	000738	中航动控	927,562.00	2.19
120	300291	华录百纳	924,625.00	2.18
121	601600	中国铝业	915,404.00	2.16
122	600885	宏发股份	910,857.00	2.15
123	300376	易事特	900,900.00	2.13
124	000078	海王生物	900,057.00	2.12
125	600869	智慧能源	879,128.00	2.07
126	601028	玉龙股份	868,320.09	2.05

127	002087	新野纺织	867,432.00	2.05
128	002001	新和成	867,360.00	2.05
129	000793	华闻传媒	865,536.00	2.04
130	600372	中航电子	862,106.00	2.03
131	000909	数源科技	860,280.00	2.03
132	300220	金运激光	853,092.00	2.01
133	002104	恒宝股份	850,120.00	2.01
134	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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	328,624,929.97
卖出股票收入（成交）总额	343,860,893.89

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：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

注：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

注：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

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

#### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	38,818.00
2	应收证券清算款	7,587,108.86
3	应收股利	-
4	应收利息	2,131.51
5	应收申购款	17,383.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,645,442.07

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 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。

## § 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
856	29,369.98	5,724,525.11	22.77%	19,416,173.54	77.23%

### 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	50,398.06	0.2005%

### 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的情况

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（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	87,976,828.15
减：本报告期基金总赎回份额	94,207,564.20
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	25,140,698.65

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

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、基金管理人 2016 年 9 月 29 日公告，新任王恒先生为公司督察长，刘建锋先生不再代为履行督察长职务。

7、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。

### 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。



### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人未改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的基金审计费用为六万元，其已提供审计服务的连续年限为 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。

### 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	137,581,560.76	20.46%	125,378.82	22.63%	-
东海证券	2	101,388,244.36	15.08%	94,422.92	17.04%	-
恒泰证券	2	179,514,589.51	26.70%	127,688.65	23.04%	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	2	127,866,792.44	19.02%	116,982.39	21.11%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	126,084,386.79	18.75%	89,684.94	16.18%	-

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。

### 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

### 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	《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》、《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》	《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 年 1 月 4 日
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》	《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 年 1 月 7 日
3	《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	《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	2016 年 1 月 23 日

	告 》	(www.donghaifunds.com)	
4	《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》	《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 年 2 月 3 日
5	《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》、《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（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)	2016 年 3 月 28 日
6	《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 》	《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 年 3 月 29 日
7	《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》	《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 年 4 月 18 日
8	《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》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016 年 4 月 22 日
9	《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 》	《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 年 4 月 26 日
10	《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	2016 年 5 月 20 日

		(www.donghaifunds.com)	
11	《东海基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告》	《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 年 6 月 24 日
12	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摘要(2016 年第 1 号)、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)	《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 年 6 月 27 日
13	《关于旗下开放式基金 2016 年半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)	2016 年 7 月 1 日
14	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 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)	2016 年 7 月 20 日
15	《东海基金管理有限责任公司关于参加上海联泰资产管理有限公司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)	2016 年 8 月 17 日
16	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要》、《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 年 8 月 25 日
17	《东海基金管理有限责任公	《中国证券报》、《上海证券	2016 年 9 月 29 日

	司高级管理人员变更公告》	报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	
18	《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 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)	2016 年 10 月 24 日
19	《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 2 号)、 《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摘要》(2016 年第 2 号)	《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 年 12 月 28 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海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

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

东海基金管理有限责任公司  
2017 年 3 月 27 日