
东海中证社会发展安全产业主题指数型证 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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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
§5 托管人报告	14
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.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
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.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49

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	49
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	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息.....	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§10 开放式基金份额变动.....	51
§11 重大事件揭示.....	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4 基金投资策略的改变	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 其他重大事件	54
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金
基金简称	东海社会安全
基金主代码	001899
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 23 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	116,277,108.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金将采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证社会发展安全产业主题指数收益率×95%+人民币税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的投资品种，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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 11 月 23 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-32,211,171.76	232,859.83
本期利润	-43,140,011.97	-3,812,615.29
加权平均基金份额本期利润	-0.271	-0.013
本期加权平均净值利润率	-33.94%	-1.27%
本期基金份额净值增长率	-19.76%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-24,652,687.78	-4,004,544.95
期末可供分配基金份额利润	-0.2120	-0.0177

期末基金资产净值	91,624,421.04	222,652,239.45
期末基金份额净值	0.788	0.982
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-21.20%	-1.80%

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 2015 年 11 月 23 日，至本报告期末未满两年。

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

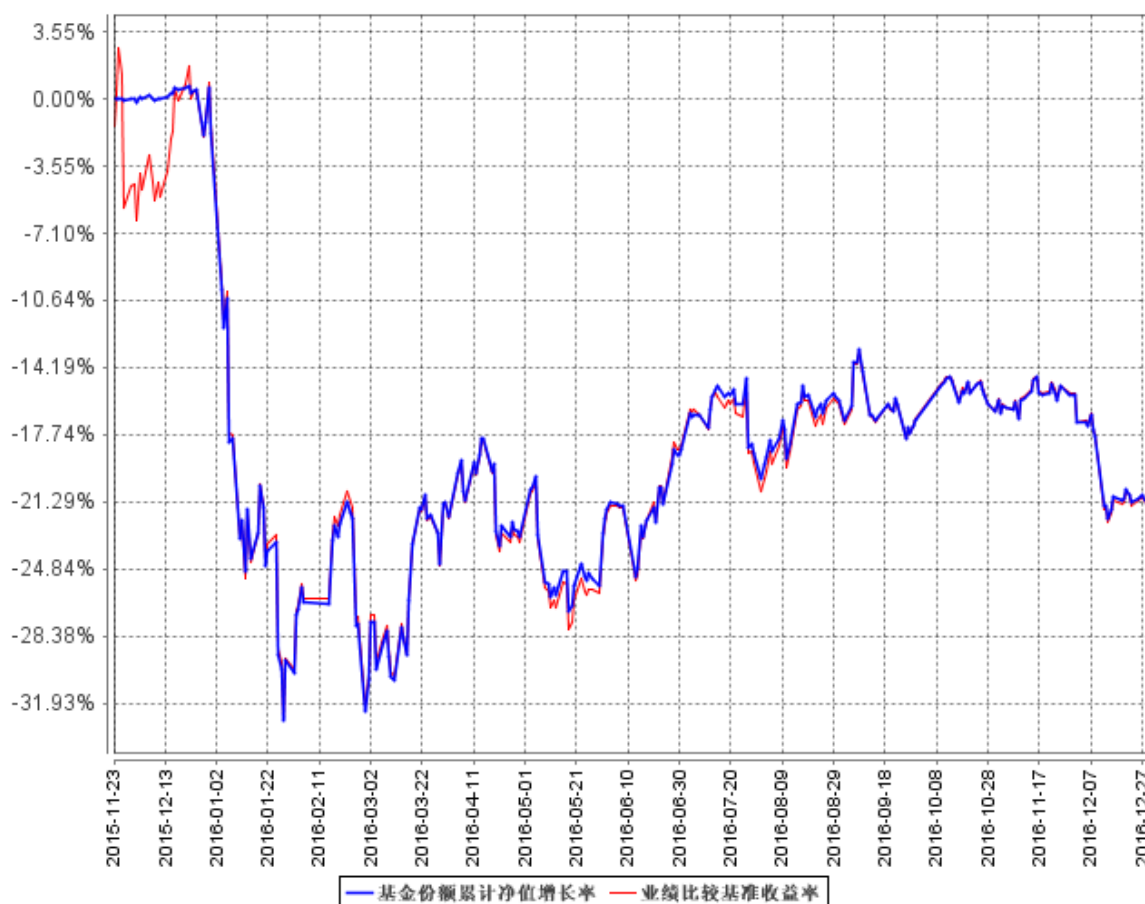
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.06%	0.86%	-5.27%	0.90%	0.21%	-0.04%
过去六个月	-2.96%	1.01%	-3.44%	1.04%	0.48%	-0.03%
过去一年	-19.76%	1.97%	-20.26%	2.01%	0.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-21.20%	1.88%	-21.30%	2.01%	0.10%	-0.13%

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：中证社会发展安全产业主题指数收益率×95%+人民币税后活期存款利率×5%。

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

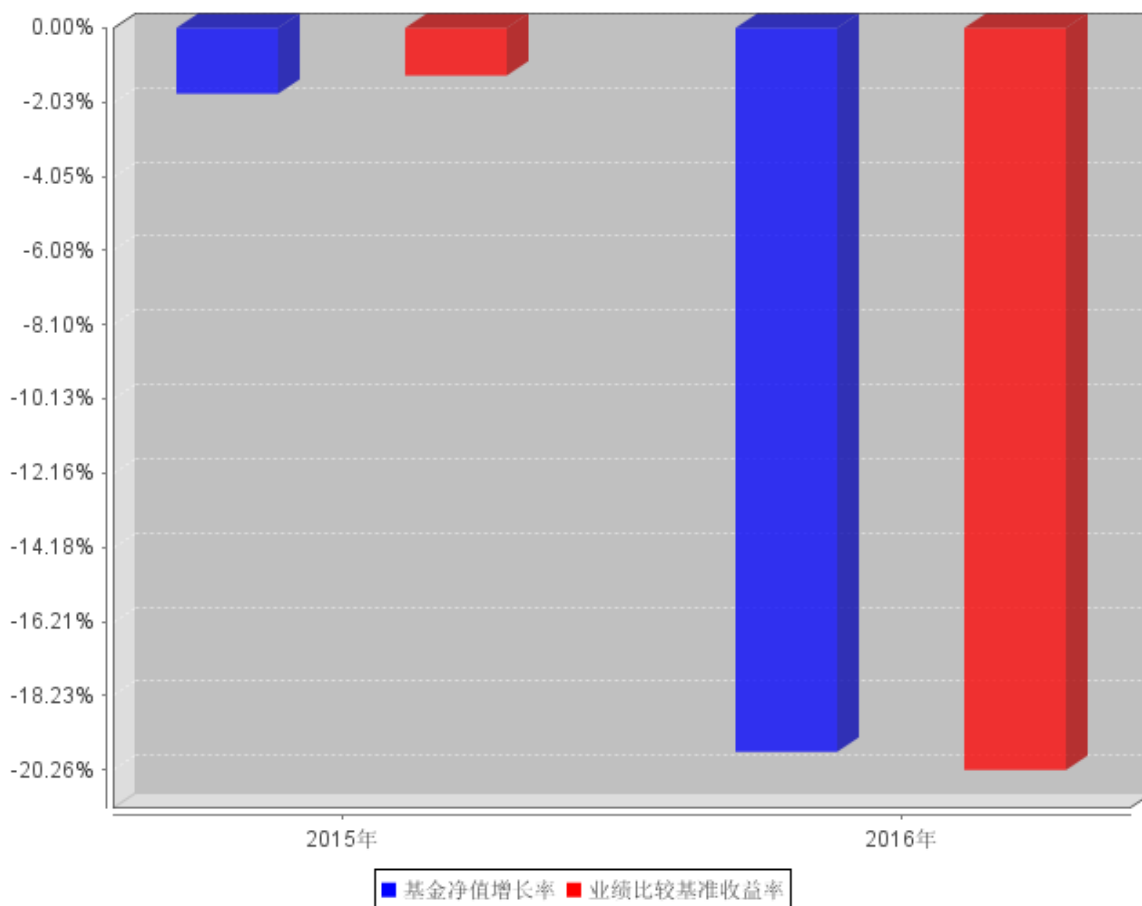


注：(1) 本基金合同生效日为 2015 年 11 月 23 日；

(2) 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证安全指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；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 2015 年 11 月 23 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 2015 年 11 月 23 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	2015年11月23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。

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。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

在报告期间，本基金管理人根据基金合同规定，采取了对指数的完全被动复制策略，将基金

净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内基金的跟踪误差主要来自基金所持股票组合占基金资产的比例及与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。占基金资产的比例差异源自基金股票组合占基金资产的比例在合同规定的 90%至 95%的范围内波动，而业绩比较基准为中证社会发展安全产业主题指数 $\times 95\%$ + 人民币税后活期存款利率 $\times 5\%$ 。

权重差异源自部分股票由于停牌或舍入取整等原因，股票组合中各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人采取了适当的组合调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪偏离度与跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为-19.76%，业绩基准增长率为-20.26%，跑赢业绩比较基准 0.5%。自成立以来（2015 年 11 月 23 日），本基金净值增长率为-21.20%，业绩基准增长率为-20.30%，高于业绩比较基准 0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议已经为 2017 年中国经济定调为稳中求进，明确国改、混改、加大股权融资、保持人民币基本稳定等艰巨任务，改革的题材将是 2017 年股市最明确的一个方向。

同时，中央经济工作会议还提到要把防控金融风险放到更加重要的位置，着力防控资产泡沫，去杠杆、防风险仍将是 2017 年管理层对市场监管的重点。

从资金的供求关系来看，2017 年预计全年的定增规模和去年持平，但新股发行规模预计和限售股解禁规模将大大高于去年。在新股扩容和解禁的双重压力下，以中小创为代表的中小盘股票的高估值面临业绩增速能否匹配的检验，我们认为 2017 年在中小盘股票的估值风险充分释放之后，其中真正具备成长性和想象空间的公司，将在调整到位后被挖掘出投资价值。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东海中证社会发展安全产业主题指数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，东海中证社会发展安全产业主题指数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中证社会发展安全产业主题指数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，东海中证社会发展安全产业主题指数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中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 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_B02 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	东海中证社会发展安全产业主题指数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中证社会发展安全产业主题指数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,公允反映了东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 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:东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

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
资产:			
银行存款	7.4.7.1	9,249,956.01	24,145,683.87
结算备付金		-	566,830.25
存出保证金		28,036.91	9,131.65
交易性金融资产	7.4.7.2	82,717,957.43	204,751,925.48
其中: 股票投资		82,717,957.43	204,751,925.48
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,089.23	38,304.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	45,880.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		91,998,039.58	229,557,756.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		8,724.29	6,440,554.69
应付管理人报酬		64,527.64	201,619.76
应付托管费		8,065.98	25,202.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	182,286.55	155,011.52
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	110,014.08	83,128.36
负债合计		373,618.54	6,905,516.80
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	116,277,108.82	226,656,784.40
未分配利润	7.4.7.10	-24,652,687.78	-4,004,544.95
所有者权益合计		91,624,421.04	222,652,239.45

负债和所有者权益总计		91,998,039.58	229,557,756.25
------------	--	---------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.788 元，基金份额总额 116,277,108.82 份。

7.2 利润表

会计主体：东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

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 11 月 23 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-41,015,507.91	-3,263,207.24
1. 利息收入		74,678.03	465,861.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	74,678.03	368,749.41
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		-	97,111.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-30,370,252.69	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-30,989,271.66	-
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	619,018.97	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,928,840.21	-4,045,475.12
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	208,906.96	316,406.59
减：二、费用		2,124,504.06	549,408.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,022,670.97	249,252.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	127,833.93	31,156.57
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	378,667.38	173,532.60
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	595,331.78	95,466.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-43,140,011.97	-3,812,615.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填		-43,140,011.97	-3,812,615.29

列)			
----	--	--	--

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

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）	226,656,784.40	-4,004,544.95	222,652,239.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-43,140,011.97	-43,140,011.97
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）	-110,379,675.58	22,491,869.14	-87,887,806.44
其中：1. 基金申购款	4,578,619.13	-892,566.48	3,686,052.65
2. 基金赎回款	-114,958,294.71	23,384,435.62	-91,573,859.09
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）	116,277,108.82	-24,652,687.78	91,624,421.04
项目	上年度可比期间 2015 年 11 月 23 日（基金合同生效日）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）	310,604,096.49	-	310,604,096.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,812,615.29	-3,812,615.29
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）	-83,947,312.09	-191,929.66	-84,139,241.75
其中：1. 基金申购款	237,376.61	-1,581.06	235,795.55

2. 基金赎回款	-84,184,688.70	-190,348.60	-84,375,037.30
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）	226,656,784.40	-4,004,544.95	222,652,239.45

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 11 月 23 日，上年度可比期间利润表列示从基金合同生效日至 2016 年 12 月 31 日数据，特此说明；

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

东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金（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[2015]2158 号文《关于准予东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人东海基金管理有限责任公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2015 年 11 月 23 日正式生效。首次设立募集规模为 310,604,096.49 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及注册登记机构均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，以中证安全指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金业绩比较基准：中证社会发展安全产业主题指数收益率×95%+人民币税后活期存款利率×5%。

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及贷款和应收款项；

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为股票投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，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，主要为各类应付款项。

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 0.8% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率逐日计提；

(3) 标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元；

(4) 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；

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

7.4.6.2. 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

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、地方政府债券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	9,249,956.01	24,145,683.87
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	9,249,956.01	24,145,683.87

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	97,692,272.76	82,717,957.43	-14,974,315.33
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	97,692,272.76	82,717,957.43	-14,974,315.33	
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	208,797,400.60	204,751,925.48	-4,045,475.12	
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	208,797,400.60	204,751,925.48	-4,045,475.12	

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：本基金本报告期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	2,075.37	38,018.97
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	-	280.61
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	13.86	4.51
合计	2,089.23	38,304.09

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末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	182,286.55	155,011.52
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	182,286.55	155,011.52

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	14.08	8,091.14
预提费用	60,000.00	25,037.22
指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	110,014.08	83,128.36

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	226,656,784.40	226,656,784.40
本期申购	4,578,619.13	4,578,619.13
本期赎回（以“-”号填列）	-114,958,294.71	-114,958,294.71
- 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	116,277,108.82	116,277,108.82

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	187,529.35	-4,192,074.30	-4,004,544.95
本期利润	-32,211,171.76	-10,928,840.21	-43,140,011.97
本期基金份额交易产生的变动数	10,284,286.99	12,207,582.15	22,491,869.14
其中：基金申购款	-510,377.07	-382,189.41	-892,566.48
基金赎回款	10,794,664.06	12,589,771.56	23,384,435.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,739,355.42	-2,913,332.36	-24,652,687.78

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	69,896.60	115,971.85
定期存款利息收入	-	252,000.00
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,007.82	765.25
其他	773.61	12.31
合计	74,678.03	368,749.41

注：本基金合同生效日为2015年11月23日，上年度可比期间存款利息收入列示从基金合同生效日（2015年11月23日）至2015年12月31日数据，特此说明。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	159,879,987.11	-
减：卖出股票成本总额	190,869,258.77	-
买卖股票差价收入	-30,989,271.66	-

注：本基金合同生效日为2015年11月23日，上年度可比期间股票投资收益列示从基金合同生效日（2015年11月23日）至2015年12月31日数据，特此说明。

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：本基金本报告期未投资资产支持证券，资产支持证券投资收益为零。

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买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无衍生工具-其他投资收益。

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11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	619,018.97	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	619,018.97	-

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11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-10,928,840.21	-4,045,475.12
——股票投资	-10,928,840.21	-4,045,475.12
——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	-10,928,840.21	-4,045,475.12

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11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	208,906.96	316,406.59
合计	208,906.96	316,406.59

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11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	378,667.38	173,532.60

银行间市场交易费用	-	-
合计	378,667.38	173,532.60

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11月23日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	-
信息披露费	334,962.78	45,037.22
银行费用	369.00	429.00
指数使用费	200,000.00	50,000.00
合计	595,331.78	95,466.22

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

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其他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	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 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11月23日(基金合同生效日)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	67,603,063.62	28.21%	29,517,175.77	14.14%

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

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11月23日(基金合同生效日)至2015 年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东海证券股份 有限公司	-	-	60,000,000.00	30.00%

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	62,959.03	31.87%	90,448.28	49.62%
关联方名称	上年度可比期间 2015年11月23日(基金合同生效日)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	27,489.25	17.73%	27,489.25	17.73%

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11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,022,670.97	249,252.66
其中：支付销售机构的客户维护费	81,725.37	16,851.19

注：本基金的管理费按前一日的基金资产净值的0.8%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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11月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	127,833.93	31,156.57

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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：本基金本报告期及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

注：本基金基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 11 月 23 日(基金合同生效日)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	9,249,956.01	69,896.60	24,145,683.87	115,971.85

注：除上表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 4,007.82 元（2015 年 11 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间：人民币 765.25 元），2016 年末未持有结算备付金（2015 年末为人民币 566,830.25 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发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：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：本基金本报告期末进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天城投	2016年11月28日	重大事项	6.93	2017年1月3日	7.00	393,239	3,164,567.88	2,725,146.27	-
000533	万家乐	2016年12月29日	重大资产重组	12.82	2017年1月12日	11.54	128,764	1,286,298.39	1,650,754.48	-
300367	东方网力	2016年12月15日	重大资产重组	20.04	-	-	62,935	1,772,437.85	1,261,217.40	-
300098	高新兴	2016年11月17日	重大资产重组	15.84	2017年1月23日	14.26	65,781	1,218,385.84	1,041,971.04	-
002151	北斗星通	2016年11月16日	重大资产重组	31.90	2017年1月12日	31.00	28,301	1,001,205.97	902,801.90	-
300223	北京君正	2016年12月19日	重大资产重组	48.40	-	-	16,000	603,915.61	774,400.00	-
300213	佳讯飞鸿	2016年11月4日	重大资产重组	28.00	2017年2月17日	25.48	21,192	762,987.84	593,376.00	-

002156	通富微电	2016 年 12 月 28 日	重大资产重组	11.38	2017 年 1 月 5 日	11.65	48,139	687,281.32	547,821.82	-
300449	汉邦高科	2016 年 11 月 11 日	重大资产重组	48.44	2017 年 2 月 24 日	43.88	8,902	453,449.65	431,212.88	-

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。

7.4.12.3.2 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为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人进行风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

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	9,249,956.01	-	-	-	-	-	9,249,956.01
存出保证金	28,036.91	-	-	-	-	-	28,036.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	82,717,957.43	82,717,957.43
应收利息	-	-	-	-	-	2,089.23	2,089.23
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,277,992.92	-	-	-	-	82,720,046.66	91,998,039.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,724.29	8,724.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,527.64	64,527.64
应付托管费	-	-	-	-	-	8,065.98	8,065.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	182,286.55	182,286.55
其他负债	-	-	-	-	-	110,014.08	110,014.08
负债总计	-	-	-	-	-	373,618.54	373,618.54
利率敏感度缺口	9,277,992.92	-	-	-	-	82,346,428.12	91,624,421.04
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	24,145,683.87	-	-	-	-	-	24,145,683.87
结算备付金	566,830.25	-	-	-	-	-	566,830.25

存出保证金	9,131.65	-	-	-	-	9,131.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-204,751,925.48	204,751,925.48
应收利息	-	-	-	-	38,304.09	38,304.09
应收申购款	-	-	-	-	45,880.91	45,880.91
资产总计	24,721,645.77	-	-	-	-204,836,110.48	229,557,756.25
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	6,440,554.69	6,440,554.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	201,619.76	201,619.76
应付托管费	-	-	-	-	25,202.47	25,202.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	155,011.52	155,011.52
其他负债	-	-	-	-	83,128.36	83,128.36
负债总计	-	-	-	-	6,905,516.80	6,905,516.80
利率敏感度缺口	24,721,645.77	-	-	-	-197,930,593.68	222,652,239.45

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均以人民币计价，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	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日		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	82,717,957.43	90.28	204,751,925.48	91.96
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	82,717,957.43	90.28	204,751,925.48	91.96

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。

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、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%	895,110.00	-
	业绩比较基准减少 1%	-895,110.00	-

注：（1）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。

（2）于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立未满半年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1.1 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 72,789,255.64 元，属于第二层次的余额为人民币 9,928,701.79 元，无划分为第三层次的余额。（于 2015 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 203,637,893.48 元，属于第二层次的余额为人民币 1,114,032.00 元，无划分为第三层次的余额）

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 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，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	82,717,957.43	89.91
	其中：股票	82,717,957.43	89.91
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	9,249,956.01	10.05
7	其他各项资产	30,126.14	0.03
8	合计	91,998,039.58	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	-	-
C	制造业	55,525,927.57	60.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,260,929.70	2.47
E	建筑业	1,120,523.04	1.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,947,600.57	10.86
J	金融业	-	-

K	房地产业	2,725,146.27	2.97
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,205,467.76	2.41
N	水利、环境和公共设施管理业	8,566,984.37	9.35
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	365,378.15	0.40
	合计	82,717,957.43	90.28

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	002415	海康威视	322,724	7,684,058.44	8.39
2	600100	同方股份	332,858	4,610,083.30	5.03
3	300070	碧水源	189,234	3,315,379.68	3.62
4	002236	大华股份	219,623	3,004,442.64	3.28
5	002030	达安基因	128,615	2,983,868.00	3.26
6	300072	三聚环保	63,658	2,946,728.82	3.22
7	000540	中天城投	393,239	2,725,146.27	2.97
8	000826	启迪桑德	63,515	2,094,724.70	2.29
9	002022	科华生物	101,183	2,023,660.00	2.21
10	300203	聚光科技	65,583	2,003,560.65	2.19
11	000533	万家乐	128,764	1,650,754.48	1.80
12	600584	长电科技	87,889	1,551,240.85	1.69
13	300012	华测检测	130,048	1,502,054.40	1.64
14	002573	清新环境	78,963	1,379,483.61	1.51
15	002049	紫光国芯	41,502	1,367,075.88	1.49
16	600388	龙净环保	103,470	1,279,923.90	1.40
17	300367	东方网力	62,935	1,261,217.40	1.38

18	300101	振芯科技	66,947	1,241,197.38	1.35
19	300318	博晖创新	134,086	1,214,819.16	1.33
20	000977	浪潮信息	55,592	1,178,550.40	1.29
21	000939	凯迪生态	90,170	1,160,487.90	1.27
22	300137	先河环保	79,085	1,154,641.00	1.26
23	300055	万邦达	68,408	1,120,523.04	1.22
24	002439	启明星辰	53,500	1,112,265.00	1.21
25	600602	云赛智联	113,900	1,085,467.00	1.18
26	002658	雪迪龙	62,525	1,075,430.00	1.17
27	300098	高新兴	65,781	1,041,971.04	1.14
28	300007	汉威电子	52,509	1,017,099.33	1.11
29	300077	国民技术	60,432	982,020.00	1.07
30	300090	盛运环保	82,302	954,703.20	1.04
31	600198	大唐电信	58,387	926,601.69	1.01
32	002268	卫士通	29,457	925,538.94	1.01
33	002151	北斗星通	28,301	902,801.90	0.99
34	603508	思维列控	13,101	897,680.52	0.98
35	002672	东江环保	48,028	845,292.80	0.92
36	300165	天瑞仪器	81,881	818,810.00	0.89
37	300223	北京君正	16,000	774,400.00	0.85
38	000811	烟台冰轮	51,608	773,603.92	0.84
39	600323	瀚蓝环境	53,705	771,203.80	0.84
40	300139	晓程科技	56,814	769,829.70	0.84
41	300215	电科院	52,572	703,413.36	0.77
42	600360	华微电子	74,886	663,489.96	0.72
43	300297	蓝盾股份	53,008	659,419.52	0.72
44	300053	欧比特	43,950	622,771.50	0.68
45	300183	东软载波	25,191	622,721.52	0.68
46	300140	中环装备	37,489	604,697.57	0.66
47	600292	远达环保	48,608	601,280.96	0.66
48	600460	士兰微	95,796	595,851.12	0.65
49	300213	佳讯飞鸿	21,192	593,376.00	0.65
50	300352	北信源	30,485	591,713.85	0.65
51	300333	兆日科技	33,648	571,006.56	0.62
52	300188	美亚柏科	26,088	558,022.32	0.61
53	002156	通富微电	48,139	547,821.82	0.60
54	300386	飞天诚信	21,399	541,608.69	0.59
55	300379	东方通	7,406	513,902.34	0.56
56	300458	全志科技	5,599	511,916.57	0.56

57	300327	中颖电子	14,658	489,577.20	0.53
58	000920	南方汇通	33,400	483,298.00	0.53
59	603005	晶方科技	15,391	462,345.64	0.50
60	300056	三维丝	27,413	456,426.45	0.50
61	300155	安居宝	34,994	440,574.46	0.48
62	300449	汉邦高科	8,902	431,212.88	0.47
63	300369	绿盟科技	12,501	424,658.97	0.46
64	300190	维尔利	25,734	414,060.06	0.45
65	300334	津膜科技	21,300	387,234.00	0.42
66	000551	创元科技	34,633	365,378.15	0.40
67	002528	英飞拓	46,364	341,239.04	0.37
68	300311	任子行	19,946	332,499.82	0.36
69	300335	迪森股份	18,900	329,238.00	0.36
70	300465	高伟达	17,980	325,797.60	0.36
71	300172	中电环保	32,748	324,860.16	0.35
72	300187	永清环保	21,900	269,808.00	0.29
73	002771	真视通	3,103	218,575.32	0.24
74	300448	浩云科技	7,166	214,120.08	0.23
75	300469	信息发展	2,600	208,312.00	0.23
76	603568	伟明环保	7,184	167,387.20	0.18

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	002415	海康威视	5,379,349.39	2.42
2	600100	同方股份	3,806,932.62	1.71
3	002180	艾派克	3,499,295.21	1.57
4	002690	美亚光电	3,491,716.22	1.57
5	600584	长电科技	3,262,804.00	1.47
6	002236	大华股份	3,177,303.89	1.43
7	002030	达安基因	2,608,336.08	1.17
8	002049	紫光国芯	2,584,073.52	1.16
9	002672	东江环保	2,393,143.30	1.07
10	300318	博晖创新	2,167,854.46	0.97

11	300070	碧水源	2,104,986.66	0.95
12	300101	振芯科技	2,053,692.20	0.92
13	000540	中天城投	2,007,410.00	0.90
14	600602	云赛智联	1,671,120.00	0.75
15	002022	科华生物	1,524,417.00	0.68
16	300012	华测检测	1,502,928.00	0.68
17	603508	思维列控	1,340,740.43	0.60
18	300367	东方网力	1,298,401.58	0.58
19	000826	启迪桑德	1,252,372.48	0.56
20	300072	三聚环保	1,235,627.20	0.55

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	002415	海康威视	15,625,476.00	7.02
2	600100	同方股份	9,464,937.62	4.25
3	002236	大华股份	9,044,835.95	4.06
4	002030	达安基因	6,465,298.85	2.90
5	300070	碧水源	4,928,734.01	2.21
6	300072	三聚环保	4,422,761.88	1.99
7	300203	聚光科技	4,219,928.30	1.90
8	002180	艾派克	4,175,289.33	1.88
9	300367	东方网力	4,073,083.40	1.83
10	002022	科华生物	3,883,204.77	1.74
11	000826	启迪桑德	3,778,526.74	1.70
12	002672	东江环保	3,215,402.00	1.44
13	000540	中天城投	3,050,601.90	1.37
14	300012	华测检测	3,010,225.55	1.35
15	002690	美亚光电	2,953,002.40	1.33
16	000977	浪潮信息	2,941,182.00	1.32
17	600388	龙净环保	2,800,944.46	1.26
18	600584	长电科技	2,374,561.93	1.07
19	002439	启明星辰	2,162,332.76	0.97
20	601965	中国汽研	2,100,937.86	0.94

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	79,764,130.93
卖出股票收入（成交）总额	159,879,987.11

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

为有效控制指数的跟踪误差，本基金可在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果

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	28,036.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,089.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,126.14

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	----------	----------

			价值	例 (%)	
1	000540	中天城投	2,725,146.27	2.97	停牌

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
2,011	57,820.54	2,982,597.32	2.57%	113,294,511.46	97.43%

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	596,217.55	0.5128%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 11 月 23 日) 基金份额总额	310,604,096.49
本报告期期初基金份额总额	226,656,784.40

本报告期基金总申购份额	4,578,619.13
减:本报告期基金总赎回份额	114,958,294.71
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	116,277,108.82

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	13,594,096.30	5.67%	12,388.33	6.27%	-
恒泰证券	2	56,504,870.64	23.58%	40,192.06	20.35%	-
宏源证券	2	47,382,893.71	19.77%	43,180.24	21.86%	-
德邦证券	2	54,559,193.77	22.77%	38,807.83	19.65%	-
东海证券	2	67,603,063.62	28.21%	62,959.03	31.87%	-

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。

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	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

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》	《上海证券报》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》	《上海证券报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016 年 1 月 4 日
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 年 1 月 7 日
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 年 1 月 13 日
5	《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 年 1 月 21 日
6	《东海基金管理有限责任公	《上海证券报》和基金管理	2016 年 1 月 23 日

	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》	人 网 站 (www.donghaifunds.com)	
7	《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 年 2 月 3 日
8	《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 年 3 月 29 日
9	《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 年 3 月 29 日
10	《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 (www.donghaifunds.com)	2016 年 4 月 15 日
11	《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 年 4 月 15 日
12	《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 年 4 月 18 日
13	《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 年 4 月 21 日
14	《东海中证社会发展安全产	《中国证券报》、《上海证券	2016 年 4 月 22 日

	业主题型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》	报》、《证券时报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	
15	《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 年 4 月 26 日
16	《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 年 5 月 20 日
17	《东海基金管理有限责任公司关于新增杭州数米基金销售有限公司未代销机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016 年 6 月 13 日
18	《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 年 6 月 24 日
19	《东海基金管理有限责任公司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
20	《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016 年 7 月 20 日
21	《东海基金管理有限责任公司关于参加上海联泰资产管	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日	2016 年 8 月 17 日

	理有限公司基金申购费率优惠活动公告》	报》和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	
22	《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2016 年半年度报告》、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要》。	《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 年 8 月 25 日
23	《东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》	《中国证券报》、《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 9 月 29 日
24	《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告》；	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2016 年 10 月 24 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中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《东海中证社会发展安全产业主题指数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