

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

2015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：2016年3月28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2016年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	31,371,434.70
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东海基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘清	洪渊
	联系电话	021-60586900	010-66105799
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009595531	95588
传真		021-60586926	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	2015年	2014年11月14日-2014年12月31日
本期已实现收益	46,912,906.43	5,210,522.61
本期利润	52,594,027.91	-575,137.20
加权平均基金份额本期利润	0.8782	-0.0017
本期基金份额净值增长率	38.00%	-2.10%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.3509	-0.0205
期末基金资产净值	42,378,362.15	201,999,779.53
期末基金份额净值	1.351	0.979

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。比较期间主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2014年12月31日的数据。

### 3.2 基金净值表现

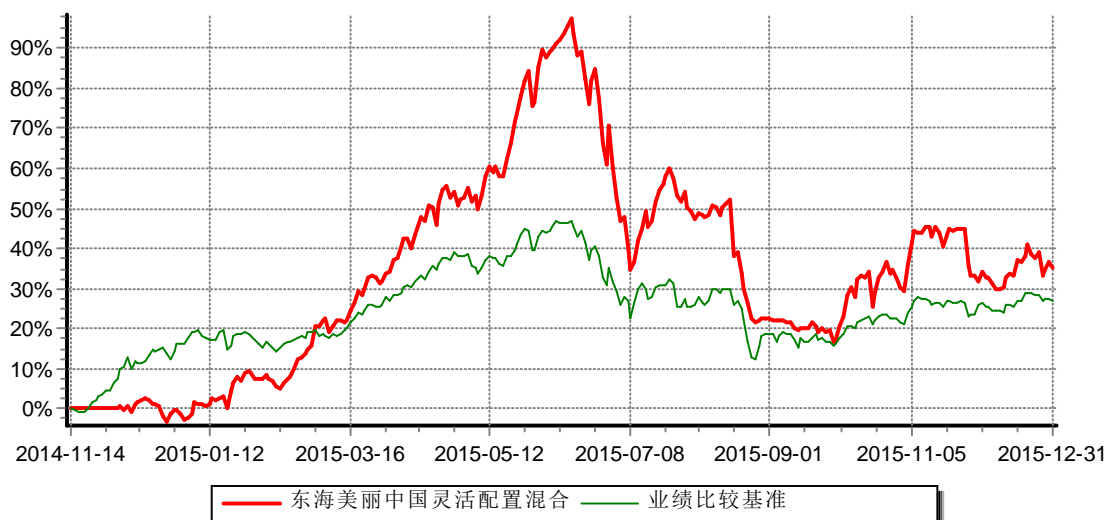
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	15.37%	2.19%	9.19%	0.84%	6.18%	1.35%
过去六个月	-20.86%	2.26%	-6.12%	1.34%	-14.74%	0.92%
过去一年	38.00%	2.13%	7.87%	1.24%	30.13%	0.89%
自基金合同生效日起至今（2014年11月14日-2015年12月31日）	35.10%	2.02%	26.74%	1.22%	8.36%	0.80%

注：(1) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

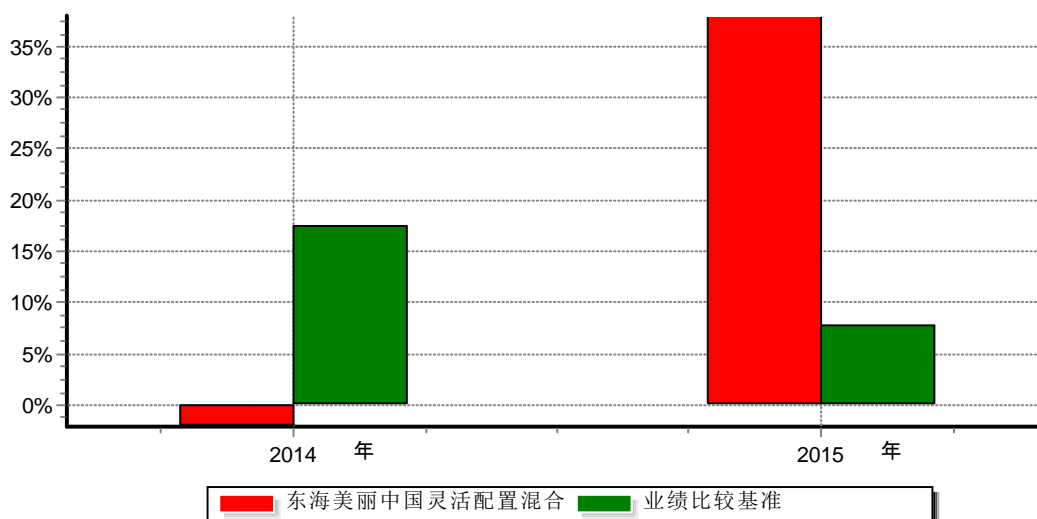


注：（1）本基金合同生效日为2014年11月14日；

（2）本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产净值的比例为0%-95%；权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

（3）本基金的建仓期为本基金合同生效日起6个月，截至建仓期末和报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

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



注：（1）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；

（2）本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产净值的比例为0%-95%；权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

（3）本基金的建仓期为本基金合同生效日起6个月，截至建仓期末和报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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80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和东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金。

#### 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		
王庆仁	副总经理，本基金的基	2014年11月14日	2015年8月5日	15年	金融学博士、加拿大MCMaster大学博士后。历任华西证券有限责任公司

	金经理				证券投资部副总经理、东海证券上海自营分公司执行总经理、上海云腾投资管理有限公司投资总监等职。
杜斌	本基金的基金经理	2014年11月14日	—	19年	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的基金经理。
胡德军	本基金的基金经理	2015年10月27日	—	6年	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。

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

（3）本报告期内，本基金基金经理王庆仁先生已辞去公司副总经理及基金经理职务，相关公告已于2015年8月6日通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司官网（www.donghaifunds.com）对外披露；

（4）本报告期内，本基金管理人新增胡德军先生为本基金基金经理，相关公告已于2015年10月28日通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司官网（www.donghaifunds.com）对外披露。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明



本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

本报告期内，A股全年在利率下行和杠杆资金推动下整体呈现大幅波动特征，其中2015年上半年经过多轮降息降准后，货币呈现大幅宽松态势，推动股市大幅上涨；2015年下半年货币宽松政策逐渐收敛，整体不及预期，叠加杠杆资金受到严查，股市也逐步

走低，个股整体回撤比较明显。从国内经济看，2015年国内经济基本面数据仍然延续低迷，经济结构转型阵痛开始显现，但随着国家经济刺激措施不断加码，全年GDP同比增长6.9%，仍然维持较高速增长。本报告期内，我们坚持建设美丽中国的投资主线，布局生态环保、信息安全、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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年度，本基金份额净值增长率为38.00%，业绩比较基准收益率为7.87%，跑赢业绩比较基准30.13%。自本基金合同生效（2014年11月14日）以来，本基金份额净值增长率为35.10%，业绩比较基准收益率为26.74%，跑赢业绩比较基准8.36%。

#### 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2016年，世界经济可能持续低迷，国内外经济错综复杂，各国目前基准利率处于历史最低水平、资本过剩、债务高企，叠加日、欧、中、美等国的人口老龄化问题日益严重，都成为中期制约经济复苏的动能；同时各经济体货币政策将逐渐分化，其中美国经济复苏强劲，2016年加息成大概率事件，而欧洲经济复苏不确定性较大，宽松的货币政策有望维持；2016年国内经济仍将处于结构调整期，通缩风险加大，虽然降息仍有空间，但相比2015年可操作性大幅降低，且降准可能更多是对冲美国加息导致的资金外流，对资本市场流动性将形成较大冲击。因此预计2016年国内资本市场将面临经济持续低迷和流动性相对2015年紧缩的新型特征，证券市场可能将受到业绩和估值的双重挤压；鉴于新的资本市场形势，2016年我们将遵循业绩稳健成长和低估值两条思路，在寻找成长性好的上市公司同时，注重各种宏观因素对市场估值造成的影响，整体采取谨慎的操作策略，控制风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币42,378,362.15元，已连续超过35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2015年4季度报告中进行了披露。本基金资产管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作，并积极采取开展持续营销、加大宣传力度、提高投研能力等措施，尽快扭转这一状况。

除此以外，本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 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2015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

本基金审计的注册会计师出具的是标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基

金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 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：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,862,250.45	13,702,972.25
结算备付金		894,375.20	—
存出保证金		165,508.99	—
交易性金融资产	7.4.7.2	37,920,117.50	189,470,183.00
其中：股票投资		37,920,117.50	189,470,183.00
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		1,997,930.65	—
应收利息	7.4.7.5	2,641.37	4,674.99
应收股利		—	—
应收申购款		80,597.37	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	92,171.57
资产总计		43,923,421.53	203,270,001.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	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		16,855.31	463,123.78
应付管理人报酬		54,922.23	402,989.83
应付托管费		9,153.69	67,164.96
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	1,257,666.45	312,876.60
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	60,000.00	24,067.11
负债合计		1,545,059.38	1,270,222.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	31,371,434.70	206,227,895.03
未分配利润	7.4.7.10	11,006,927.45	-4,228,115.50
所有者权益合计		42,378,362.15	201,999,779.53
负债和所有者权益总计		43,923,421.53	203,270,001.81

注：(1) 报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.351元，基金份额总额31,371,434.7份；

(2) 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 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：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月14日至 2014年12月31日
一、收入		56,200,430.98	666,354.40

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

1. 利息收入		114,703.59	794,106.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	106,411.26	773,388.36
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		8,292.33	20,718.59
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,190,641.77	4,895,910.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	48,910,557.80	4,895,910.11
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		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	280,083.97	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,681,121.48	-5,785,659.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,213,964.14	761,997.15
<b>减：二、费用</b>		3,606,403.07	1,241,491.60
1. 管理人报酬		1,165,468.79	669,080.12
2. 托管费		194,244.78	111,513.34
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	1,817,690.22	428,344.42
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.19	428,999.28	32,553.72

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		52,594,027.91	-575,137.20
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		52,594,027.91	-575,137.20

注：(1) 本基金基金合同生效日为2014年11月14日，上年度可比期间利润表列示从基金合同生效日至2014年12月31日数据，特此说明；

(2) 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 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：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2014年11月14日至2014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)	404,663,363.74	—	404,663,363.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-575,137.20	-575,137.20
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)	-198,435,468.71	-3,652,978.30	-202,088,447.01
其中：1. 基金申购款	1,093,751.26	6,741.32	1,100,492.58
2. 基金赎回款	-199,529,219.97	-3,659,719.62	-203,188,939.59
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)	206,227,895.03	-4,228,115.50	201,999,779.53

注：本基金基金合同生效日为2014年11月14日，上年度可比期间所有者权益变动表列示从基金合同生效日至2014年12月31日的数据，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：

葛伟忠

葛伟忠

刘宇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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号文准予注册募集，由基金管理人东海基金管理有限责任公司于2014年10月16日至2014年11月12日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2014)验字第61047315\_B57号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年11月14日生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。募集期间净认购金额为人民币404,609,682.94元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币53,680.80



元，以上实收基金（本息）合计为人民币404,663,363.74元，合计募集份额为404,663,363.74份。本基金的基金管理人为东海基金管理有限责任公司，注册登记机构为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金业绩比较基准：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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 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及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 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；

##### (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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

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

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

#### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 权证投资

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

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

#### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5) 回购协议

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

### 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。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。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经

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，调整最近交易市价以确定公允价值。

#### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，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。

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

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

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

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

#### 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 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的说明

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

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

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

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

##### 2. 营业税、企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

##### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关

税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额；

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

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

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 关联方关系

##### 7.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东海基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
东海证券股份有限公司(“东海证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳鹏博实业集团有限公司	基金管理人的股东
苏州市相城区江南化纤集团有限公司	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
东海瑞京资产管理(上海)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年11月14日至2014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	74,189,477.00	6.24%	343,669,774.42	100.00%

### 7.4.8.1.2 债券交易

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交易。

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

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。

### 7.4.8.1.4 权证交易

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权证交易。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年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	67,542.10	6.72%	380,418.70	30.25%
关联方名称	上年度可比期间 2014年11月14日至2014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	312,876.60	100.00%	312,876.60	100.00%

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

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

(3)本基金合同生效日为2014年11月14日，上年度可比期间数据列示从基金合同生效日至2014年12月31日的数据，特此说明。



### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年11月14日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,165,468.79	669,080.12
其中：支付销售机构的客户维护费	333,549.36	122,969.87

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年11月14日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	194,244.78	111,513.34

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年11月14日至2014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	—	—
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	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.25%	—

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。报告期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；报告期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人外的其他关联方本期末及上年度末均未投资本基金。

##### 7.4.8.5 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	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年11月14日至2014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	2,862,250.45	93,644.35	13,702,972.25	134,860.57

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

（2）本基金合同生效日为2014年11月14日，上年度可比期间数据列示从基金合同生效日至2014年12月31日的数据，特此说明。

（3）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，2015年度获得的利息收入为人民币10,052.18元（2014年11月14日（基金合同生效日）至2014年12

月31日止期间获得的利息收入：无），2015年末结算备付金余额为人民币894,375.20元（2014年末：无）。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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。

#### 7.4.8.7 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。

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

###### (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。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### 1) 各层次金融工具公允价值

2015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37,920,117.50元，无属于第二层次和第三层次的余额。

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。

3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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本期末不以第三层次公允价值计量。

2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,920,117.50	86.33
	其中：股票	37,920,117.50	86.33
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	3,756,625.65	8.55
7	其他各项资产	2,246,678.38	5.11
8	合计	43,923,421.53	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	22,532,642.80	53.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,343,452.00	17.33
J	金融业	38.70	—
K	房地产业	3,876,864.00	9.15
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	4,167,120.00	9.83
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	37,920,117.50	89.48

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000920	南方汇通	174,305	4,188,549.15	9.88
2	300187	永清环保	77,600	4,167,120.00	9.83
3	002268	卫士通	72,200	4,058,362.00	9.58
4	002510	天汽模	227,738	4,037,794.74	9.53

5	600340	华夏幸福	126,200	3,876,864.00	9.15
6	002224	三力士	170,700	3,707,604.00	8.75
7	600501	航天晨光	132,394	3,495,201.60	8.25
8	600718	东软集团	105,800	3,285,090.00	7.75
9	600685	中船防务	78,699	3,123,563.31	7.37
10	000988	华工科技	95,600	2,024,808.00	4.78

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

#### 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	600388	龙净环保	20,511,547.38	10.15
2	600837	海通证券	16,372,705.36	8.11
3	600118	中国卫星	13,860,948.00	6.86
4	600718	东软集团	13,654,198.00	6.76
5	002573	清新环境	13,529,779.79	6.70
6	000530	大冷股份	12,335,696.71	6.11
7	300145	南方泵业	12,133,167.02	6.01
8	000920	南方汇通	12,105,988.74	5.99
9	600958	东方证券	11,688,536.63	5.79
10	002658	雪迪龙	10,488,134.60	5.19
11	600703	三安光电	10,357,466.63	5.13
12	600030	中信证券	10,253,121.75	5.08
13	600008	首创股份	9,891,932.12	4.90
14	002268	卫士通	9,601,104.20	4.75
15	600517	置信电气	8,591,179.00	4.25
16	000065	北方国际	7,981,991.03	3.95
17	600480	凌云股份	7,492,703.90	3.71
18	600501	航天晨光	7,289,576.74	3.61
19	600999	招商证券	7,175,341.00	3.55

20	002171	楚江新材	7,102,468.00	3.52
21	600685	中船防务	7,085,462.05	3.51
22	600009	上海机场	6,945,449.22	3.44
23	000099	中信海直	6,096,862.00	3.02
24	601555	东吴证券	5,996,854.00	2.97
25	601377	兴业证券	5,995,541.16	2.97
26	600369	西南证券	5,995,200.00	2.97
27	601158	重庆水务	5,945,841.00	2.94
28	601318	中国平安	5,630,960.00	2.79
29	600015	华夏银行	5,566,852.00	2.76
30	000762	西藏矿业	5,491,027.95	2.72
31	600699	均胜电子	5,478,746.00	2.71
32	600391	成发科技	5,387,447.00	2.67
33	600677	航天通信	5,340,714.36	2.64
34	600016	XD民生银	5,317,481.00	2.63
35	300137	先河环保	5,159,286.50	2.55
36	000970	中科三环	4,996,790.00	2.47
37	600329	中新药业	4,990,891.00	2.47
38	002510	天汽模	4,990,860.34	2.47
39	000728	国元证券	4,937,590.77	2.44
40	600584	长电科技	4,848,227.00	2.40
41	300083	劲胜精密	4,843,758.00	2.40
42	600343	航天动力	4,495,013.00	2.23
43	600536	中国软件	4,491,951.00	2.22
44	002672	东江环保	4,092,286.55	2.03
45	300187	永清环保	4,085,300.00	2.02

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	600703	三安光电	30,876,929.97	15.29

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

2	600388	龙净环保	27,641,788.43	13.68
3	600329	中新药业	19,935,544.83	9.87
4	600837	海通证券	17,206,301.35	8.52
5	002573	清新环境	16,620,553.97	8.23
6	300012	华测检测	15,858,321.33	7.85
7	600057	象屿股份	15,836,528.87	7.84
8	600118	中国卫星	13,235,045.32	6.55
9	000530	大冷股份	12,625,409.76	6.25
10	600718	东软集团	12,539,568.38	6.21
11	300145	南方泵业	12,289,695.64	6.08
12	600958	东方证券	11,777,186.11	5.83
13	002450	康得新	10,790,797.15	5.34
14	600030	中信证券	10,676,052.79	5.29
15	002658	雪迪龙	10,072,259.63	4.99
16	600143	金发科技	10,002,398.93	4.95
17	002422	科伦药业	9,959,961.22	4.93
18	600008	首创股份	9,565,132.59	4.74
19	600309	万华化学	8,920,413.92	4.42
20	600517	置信电气	8,536,139.57	4.23
21	000920	南方汇通	8,349,151.76	4.13
22	600999	招商证券	8,311,004.72	4.11
23	000826	启迪桑德	8,179,816.49	4.05
24	600009	上海机场	8,040,481.14	3.98
25	002023	海特高新	8,014,514.07	3.97
26	300203	聚光科技	7,907,776.32	3.91
27	600459	贵研铂业	7,901,733.76	3.91
28	000065	北方国际	7,424,321.02	3.68
29	600699	均胜电子	7,314,616.36	3.62
30	002171	楚江新材	7,194,910.04	3.56
31	300007	汉威电子	7,185,316.46	3.56
32	300207	欣旺达	7,129,310.32	3.53
33	600480	凌云股份	7,123,638.50	3.53



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

34	300165	天瑞仪器	6,948,164.50	3.44
35	300070	碧水源	6,690,145.49	3.31
36	002470	金正大	6,685,107.31	3.31
37	600015	华夏银行	6,605,700.85	3.27
38	601318	中国平安	6,578,928.09	3.26
39	601777	力帆股份	6,376,096.31	3.16
40	601377	兴业证券	6,312,658.50	3.13
41	300073	当升科技	6,187,250.26	3.06
42	600369	西南证券	6,138,083.64	3.04
43	601555	东吴证券	6,078,384.60	3.01
44	600690	青岛海尔	6,046,600.00	2.99
45	000099	中信海直	6,024,837.27	2.98
46	601158	重庆水务	5,673,635.56	2.81
47	000762	西藏矿业	5,654,260.00	2.80
48	600584	长电科技	5,620,565.67	2.78
49	600217	*ST秦岭	5,371,720.43	2.66
50	600016	XD民生银	5,230,532.00	2.59
51	002268	卫 士 通	5,230,262.66	2.59
52	000977	浪潮信息	5,137,005.78	2.54
53	600526	菲达环保	5,125,257.00	2.54
54	000728	国元证券	5,104,439.78	2.53
55	300137	先河环保	5,064,090.39	2.51
56	002022	科华生物	4,974,832.71	2.46
57	600677	航天通信	4,725,505.16	2.34
58	002672	东江环保	4,592,116.50	2.27
59	000970	中科三环	4,459,443.57	2.21
60	601328	交通银行	4,379,857.30	2.17
61	300262	巴安水务	4,274,892.30	2.12
62	300334	津膜科技	4,243,715.45	2.10
63	000919	金陵药业	4,209,118.67	2.08
64	600536	中国软件	4,112,894.00	2.04
65	600036	招商银行	4,102,001.92	2.03

66	600685	中船防务	4,096,410.89	2.03
67	300135	宝利国际	4,068,716.72	2.01

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	491,509,019.52
卖出股票的收入（成交）总额	697,650,764.30

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

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

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 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

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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	165,508.99
2	应收证券清算款	1,997,930.65
3	应收股利	—
4	应收利息	2,641.37
5	应收申购款	80,597.37
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,246,678.38

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
1,357	23,118.23	7,999,980.16	26.00%	23,371,454.54	74.00%

### 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	67,220.74	0.21%

注：(1) 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；

(2) 本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年11月14日)基金份额总额	404,663,363.74
本报告期期初基金份额总额	206,227,895.03
本报告期基金总申购份额	83,427,256.27
减：本报告期基金总赎回份额	258,283,716.60

本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	31,371,434.70

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

2、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意刘元春先生辞去公司独立董事职务，任命李清伟先生担任公司独立董事；

3、本报告期内，王庆仁先生辞去公司副总经理、本基金的基金经理职务；

4、本报告期内，本基金管理人增聘胡德军先生为本基金的基金经理，与杜斌先生共同管理本基金；

5、经本基金管理人股东会、董事会决议，同意朱科敏先生辞去公司董事及董事长职务，其辞任日期为2016年1月12日；本基金管理人于2016年1月13日就上述事项予以对外披露。

### 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，中国证券监督管理委员会上海监管局向我司下发了《关于对东海基金管理有限责任公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决【2015】55号）。我司高度重视

视，成立了整改工作小组，梳理相关制度流程，排查现行内控漏洞，针对性的制定了整改执行方案，完善了公司内部控制措施，完成整改并已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华鑫证券	2	406,133,057.81	34.15%	375,974.34	37.43%	
东海证券	2	74,189,477.00	6.24%	67,542.10	6.72%	
太平洋证券	1	238,542,830.96	20.06%	164,092.07	16.33%	
德邦证券	2	158,246,338.15	13.31%	112,559.90	11.20%	
申万宏源	2	312,027,699.90	26.24%	284,407.25	28.31%	

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。

东海基金管理有限责任公司

二〇一六年三月二十八日