

# 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

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

### 重要提示

本基金经 2014 年 9 月 9 日中国证券监督管理委员会证监许可【2014】934 号文准予注册募集。本基金基金合同于 2014 年 11 月 14 日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风

险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特定风险等。

本基金是灵活配置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。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：东海基金管理有限责任公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室

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

法定代表人：葛伟忠

成立时间：2013 年 2 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证券监督管理委员会《关于核准设立东海基金管理有限责任公司的批复》（证监许可[2013]179 号）

注册资本：人民币 1.5 亿元

联系人：王兆

联系电话：（021）60586900

股东名称及其出资比例：

东海证券股份有限公司 45%

深圳鹏博实业集团有限公司 30%

苏州市相城区江南化纤集团有限公司 25%

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

葛伟忠先生，董事，工商管理硕士。现任东海基金管理有限责任公司董事长，兼任东海瑞京资产管理（上海）有限公司董事。曾任东海证券股份有限公司深圳香梅路营业部总经理助理、综合管理部总经理助理、上海愚园路营业部总经理、人力资源部总经理、总裁助理，东海基金管理有限责任公司总经理等职。

刘建锋先生，董事，工商管理硕士。现任东海基金管理有限责任公司总经理。曾任山西证券公司（现山西证券股份有限公司）投资银行部、自营部负责人，山西证券股份有限公司资产经营（自营）部、北方业务部总经理，上海汉盈投资管理公司执行董事，东海基金管理有限责任公司总经理助理等职。

汪劲松先生，董事，经济学硕士，经济师。现任东海证券股份有限公司副总裁兼人力资源部总经理、党办主任。曾任泰阳证券股份有限公司总经理助理、营业部总经理；东海证券经纪业务总部总经理、总监兼综合管理部总经理、工会主席，东海证券股份有限公司副总裁等职。

杨学林先生，董事，工学学士。现任深圳鹏博实业集团有限公司董事长、中国电子器件工业有限公司董事长。曾任深圳市天潼微电子技术公司工程师、深圳市城运照明电器有限公司总工程师等职。

顾志强先生，董事。现任苏州市相城区江南化纤集团有限公司销售经理。曾任职于吴县第二化纤厂、苏州市吴申化纤厂。

邱兆祥先生，独立董事，财政信贷本科。现任对外经济贸易大学金融研究所名誉所长、教授、博士生导师，兼任西南财经大学和暨南大学等高校教授、博士生导师，中国汽车金融研究中心主任。曾任中央财经大学（原中央财政金融学院）助教、北京语言大学（原北京语言学院）讲师、中国金融学院教授。

张心泉女士，独立董事，法学硕士。现任华东政法大学副教授、硕士研究生导师、行政法教研室副主任。曾任华东政法大学讲师。

李清伟先生，独立董事，法学博士，现任上海大学法学院教授、博士生导师，兼任上海凯宝药业股份有限公司独立董事、澳门科技大学兼职博导、澳门城市大学商学院兼职教授、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。曾任职于河南师范大学外语系、上海财经大学法学院。

### 2、监事会成员

宋宽仁先生，监事会主席，工商管理硕士，会计师、经济师、审计师。现任东海证券股份有限公司合规与风险管理部总经理、内部审计部总经理、监事，东海期

货有限责任公司监事。曾任湖南杨律师事务所律师助理，湖南公信投资有限公司副总经理，东海证券综合管理部高级经理、上海水城南路证券营业部总经理等职。

邓文胜先生，监事，经济学硕士。现任深圳鹏博实业集团有限公司投资总监，曾任深圳农业银行主任、支行行长，广东经天律师事务所执业律师，兰州普合房地产开发有限公司财务总监，上海道丰投资有限公司总经理等职。

向方华先生，职工监事，法学硕士，律师。现任东海基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理，曾任职于东海证券股份有限公司。

王宇先生，职工监事，理学硕士，现任东海基金管理有限责任公司综合管理部总经理助理，曾任职于东海证券股份有限公司。

### 3、公司高级管理人员

葛伟忠先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

刘建锋先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

王恒先生，督察长。管理学博士，曾任中国银河证券信息技术部副主任、主任，中国银河证券党委办公室、总裁办公室主任、纪委委员，银河创新资本管理有限公司董事总经理，中国银河证券资产管理总部董事总经理，东海瑞京资产（上海）管理有限公司总经理、董事长，东海基金管理有限责任公司总经理助理等职。

### 4、本基金基金经理

#### （1）现任基金经理

杜斌先生，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。2014年11月14日至今任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年11月23日至今任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经理。

胡德军先生，博士。历任齐鲁证券有限公司研究所医药研究员，东海基金管理有限责任公司研究开发部研究员、专户理财部投资经理等职。2015年10月27日任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### （2）历任基金经理

王庆仁先生，2014年11月至2015年8月

### 5、投资决策委员会成员

主席：

刘建锋先生，总经理。

成员：

杜斌先生，基金经理。

胡德军先生，基金经理。

祝鸿玲女士，基金经理。

周三深先生，研究开发部总经理助理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2016 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境

内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 三、相关服务机构

#### （一）销售机构

##### 1、直销机构

东海基金管理有限责任公司直销中心

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室

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

法定代表人：葛伟忠

电话：（021）60586973

传真：（021）60586926

联系人：王兆

客户服务电话：400-959-5531

网址：[www.donghaifunds.com](http://www.donghaifunds.com)

##### 2、其他销售机构

###### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

电话：010-66106912

传真：010-66107914

联系人：洪渊

客服电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

###### （2）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：汪汇

电话：021-20333363

传真：021-50498825

客服电话：95531

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(3) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

传真：021-54967293

联系人：王道

客服电话：4001099918

网站：www.cfsc.com.cn

(4) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法人代表：李长伟

联系电话：010-88321717

传真电话：010-88321763

联系人员：唐昌田

客服电话：4006650999

网址：www.tpyzq.com

(5) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63410456

客服电话：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

(6) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(7) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509988

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(8) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 邮电新闻大厦 2 层

法人代表：闫振杰

联系电话：010-59601366-7024

传真电话：010-62020355

联系人员：李露平

客服电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

(9) 江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-89995001

传真：0519-89995001

客服电话：96005

网址：www.jnbank.cc

(10) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法人代表：兰荣



联系电话：0591-38281963

传真电话：0591-38281963

联系人员：柯延超

客服电话：95562

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(11) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周雁雯

电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(12) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：杨德红

联系人：朱亚薇

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：95521

网址：[www.gtja.com/i/](http://www.gtja.com/i/)

(13) 东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

联系人：李天雨

电话：021-68757102

传真：021-68756991

客服电话：95531

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(14) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：021-68761616

传真：021-68767880

客服电话：95353

网址：www.tebon.com.cn

(15) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 做 12 楼

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

电话：4008215399

传真：021-38509777

客服电话：4008215399

网址：www.noah-fund.com

(16) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-88891212

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

(17) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：余永健

电话：400-021-8850

传真：010-65215433

客服电话：4000218850

网址：www.harvestwm.cn

(18) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：唐诗洋

电话：021-20691869

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(19) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法人代表：陈有安

联系电话：010-66568292

传真电话：010-66568990

联系人员：邓颜

客服电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(20) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法人代表：吴雪秀

联系电话：010-88312877

传真电话：010-88312099

联系人员：段京璐

客服电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

(21) 中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

法人代表：徐福星  
联系电话：010-68292940  
传真电话：010-68292941  
联系人员：徐娜  
客服电话：400-600-0030  
网址：www.bzfunds.com

(22) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903  
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼  
法人代表：凌顺平  
联系电话：0571-88911818  
传真电话：0571-86800423  
联系人员：吴强  
客服电话：95105885  
网址：www.0033.com

(23) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
法定代表人：赵荣春  
电话：010-59158281  
传真：010-57569671  
联系人：高静  
客服电话：400-893-6885  
网址：www.qianjing.com

(24) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室  
办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼  
法定代表人：燕斌  
电话：021-51507071  
传真：021-62990063  
联系人：凌秋艳  
客服电话：4000-466-788  
网址：www.66zichan.com

(25) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-20665953

联系人：宁博宇

客服电话：400-821-9031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(二) 登记机构

名称：东海基金管理有限责任公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室

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

电话：(021) 60586979

传真：(021) 60586961

联系人：刘宇

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

经办律师：黎明、孙睿

联系人：孙睿

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

首席合伙人：毛鞍宁

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

邮政编码：100738

公司电话：（010）58153000

公司传真：（010）85188298

签章会计师：汤骏、印艳萍

业务联系人：印艳萍

#### 四、基金名称

东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金。

#### 五、基金的类型

混合型。

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、投资范围

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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：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%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

## 八、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。

### 1、大类资产配置策略

本基金运用定量分析和定性分析手段，从宏观经济政策（货币政策、财政政策、产业发展政策等）、微观经济运行环境、证券市场走势等方面对市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，合理配置基金资产在权益类资产、固定收益类资产、现金、衍生金融工具等各类资产间的投资比例，通过积极的资产配置追求超额收益。

### 2、股票投资策略

本基金将重点关注美丽中国概念所蕴含的中国经济结构转型和经济品质改善的行业，挖掘对环境污染、生态失衡、能源紧缺、农业生产力低下、文化产品缺乏、地区发展不平衡、传统行业增长乏力及消费品质落后等方面的问题提供解决方案，景气周期向上的优势行业。基金管理人将围绕美丽中国投资主线，寻找价值低估的企业股票进行配置，包括环保、生态治理、智慧城市、新能源、现代农业、文化传媒、金融服务、电子商务、信息消费、旅游、养老服务、高端装备、新型材料、健康医疗、国有企业改革等景气周期向上的行业。

本基金的股票投资策略通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选出品质优良的上市公司。

#### （1）定性分析

本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据，主要包括以下几个方面：

A、市场优势，包括上市公司的市场地位和市场份额；在细分市场是否占据领先地位；是否具有品牌号召力或较高的行业知名度；在营销渠道及营销网络方面的优势等。

B、资源和垄断优势，包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源，比如市场资源、专利技术等。

C、产品优势，包括是否拥有独特的、难以模仿的产品；对产品的定价能力等。

D、其他优势，例如是否受到中央或地方政府政策的扶持等因素。本基金还对上市公司经营状况和公司治理情况进行定性分析，主要考察上市公司是否有明确、合理的发展战略；是否拥有较为清晰的经营策略和经营模式；是否具有合理的治理结构，管理团队是否团结高效、经验丰富，是否具有进取精神等。

#### （2）定量分析

本基金将对反映上市公司价值和成长潜力的主要财务和估值指标进行定量分析，在对上市公司盈利增长前景进行分析时，本基金将充分利用上市公司的财务数据，通过上市公司的成长能力指标进行量化筛选，主要包括主营业务收入增长率、主营业务利润和净利润增长率、每股收益增长率、净资产收益率、PEG 等。

在以上研究的基础上，本基金将通过定量与定性相结合的评估方法，对上市公司的增长前景进行分析，力争所选择的企业具备长期竞争优势。

### 3、债券投资策略

在债券投资上，坚持稳健投资的原则，控制债券投资风险。

本基金将在利率合理预期的基础上，通过久期管理，稳健地进行债券投资，控制债券投资风险。在预期利率上升阶段，保持债券投资组合较短的久期，降低债券投资风险；在预期利率下降阶段，在评估风险的前提下，适当增大债券投资的久期，以期获得较高投资收益。

在确定债券投资组合久期后，本基金将根据对市场利率变化周期以及不同期限债券供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化，并确定相应的期限结构配置，以获取因收益率曲线的变化所带来的投资收益。

信用债券投资方面，本基金力争通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，在信用债券的选择时将特别重视信用风险的评估和防范。通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史统计区间等因素判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，从而确定信用债总体的投资比例。通过综合分析公司债券、企业债等信用债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平，结合债券担保条款、抵押品估值及债券其他要素，综合评价债券发行人信用风险以及债券的信用级别。通过动态跟踪信用债券的信用风险，确定信用债的合理信用利差，挖掘价值被低估的品种，以获取超额收益。

### 4、股指期货投资策略

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。

#### 5、权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 50\% + \text{上证国债指数收益率} \times 50\%$

本基金选择该业绩基准，是基于以下因素：

- 1、沪深 300 指数和上证国债指数编制方法合理、透明；
- 2、沪深 300 指数和上证国债指数编制和发布有一定的历史，有较高的知名度和市场影响力；
- 3、具有市场覆盖率，不易被操纵；
- 4、本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。关于指数值和成分股名单的所有知识产权归属中证指数有限公司。

上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有权

归属上海证券交易所。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并在更新的招募说明书中列示，无须召开基金份额持有人大会。

#### 十、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。

#### 十一、基金投资组合报告

##### 1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 权益投资 20,065,987.20 74.47

其中：股票 20,065,987.20 74.47

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 — —

其中：债券 — —

资产支持证券 — —

4 贵金属投资 — —

5 金融衍生品投资 — —

6 买入返售金融资产 — —

其中：买断式回购的买入返售金融资产 — —

7 银行存款和结算备付金合计 6,766,584.07 25.11

8 其他资产 111,362.67 0.41

9 合计 26,943,933.94 100.00

##### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,187,016.00	4.71
C	制造业	15,236,977.20	60.47
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	1,894,914.00	7.52
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	1,014,258.00	4.03
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	732,822.00	2.91
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	20,065,987.20	79.64

### 3 报告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

序号 股票代码 股票名称 数量（股） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1	000820	金城股份	50,100	1,249,995.00	4.96
2	002108	沧州明珠	55,600	1,204,852.00	4.78
3	300182	捷成股份	86,100	1,014,258.00	4.03
4	300296	利亚德	30,900	945,540.00	3.75
5	002241	歌尔股份	30,700	928,061.00	3.68

6	002758	华通医药	29,000	928,000.00	3.68
7	000423	东阿阿胶	15,500	922,250.00	3.66
8	002007	华兰生物	24,100	905,678.00	3.59
9	300145	中金环境	34,000	902,020.00	3.58
10	600529	山东药玻	40,600	890,358.00	3.53

#### 4 报告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。

#### 5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7 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 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 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。

##### 9.2 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。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

## 11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

### 11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 56,165.24

2 应收证券清算款 —

3 应收股利 —

4 应收利息 1,462.82

5 应收申购款 53,734.61

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 111,362.67

### 11.4 报告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。

### 11.5 报告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。

### 11.6 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公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）基金净值表现

#### 1、本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 净值增长率① 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

2014年11月14日至2014年12月31日 -2.1% 0.90% 17.5% 0.99% -19.6% -0.09%

2015年1月1日至2015年12月31日 38.00% 2.13% 7.87% 1.24% 30.13% 0.89%

2016年1月1日至2016年6月30日 -24.13% 2.03% -6.64% 0.91% -17.49% 1.12%

2016年7月1日至2016年9月30日 -3.41% 0.67% 2.27% 0.40% -5.68% 0.27%

2014年11月14日至2016年9月30日 -1.00% 1.90% 20.97% 1.07% -21.97% 0.83%

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%

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

注：（1）本基金基金合同生效日为2014年11月14日。图示日期为2014年11月14日至2016年9月30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，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

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。

## 2、基金托管人的托管费

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。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

### 1、“重要提示”部分

- （1）更新本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日期。

### 2、“二、释义”

- （1）更新 21、基金销售业务
- （2）更新 26、基金交易账户
- （3）更新 42、巨额赎回

### 3、“三、基金管理人”部分



- (1) 更新基金管理人概况
- (2) 更新主要人员情况
- (3) 更新基金管理人的职责
- 4、“四、基金托管人”部分
  - (1) 更新基金托管人基本情况
  - (2) 更新基金托管人主要人员情况
  - (3) 更新基金托管业务经营情况
  - (4) 更新基金托管人的内部控制制度
- 5、“五、相关服务机构”部分
  - (1) 更新 2、其他销售机构
  - (2) 更新（四）审计基金财产的会计师事务所
- 6、“九、基金份额的投资”部分
  - (1) 更新（十）基金投资组合报告，报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日
- 7、更新“十、基金的业绩”部分
- 8、“二十、基金托管协议的内容摘要”
  - (1) 更新（一）托管协议的当事人
- 9、“二十一、对基金份额持有人的服务”
  - (1) 更新五、信息定制服务
- 10、“二十二、其他应披露事项”部分
  - (1) 更新 2016 年 5 月 20 日至 2016 年 10 月 24 日期间涉及本基金的相关公告

东海基金管理有限责任公司

2016 年 12 月 28 日