# 东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：东兴证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月21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。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

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2016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 | 东兴蓝海财富混合 |
| 基金主代码 | 002182 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年12月23日 |
| 基金管理人 | 东兴证券股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 177,023,064.26 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资受益于具有估值优势和良好成长性的潜力公司，通过合理的资产配置，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将"自上而下"的趋势投资和"自下而上"的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找有巨大发展潜力的蓝海行业，并在行业内精选出具有竞争优势和估值优势的投资标的构建组合。本基金的"蓝海"投资范畴界定为：在新常态下通过产业升级以及创新发展实现价值创新的行业与公司。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。 |

## 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 | | 东兴证券股份有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披 | 姓名 | 张韵 | 林葛 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 露负责人 | 联系电话 | 010-66551816 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | zhangyun@dxzq.net.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 95309 | 95599 |
| 传真 | | 010-66551452 | 010-68121816 |

## 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.fund.dxzq.net |
| 基金年度报告备置地点 | 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层 |

# §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12月23日-2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -67,123,887.11 | -57,546.95 |
| 本期利润 | -68,804,753.35 | -2,742,282.76 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2827 | -0.0075 |
| 本期加权平均净值利润率 | -34.13% | -0.75% |
| 本期基金份额净值增长率 | -21.77% | -0.80% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 2016年末 | 2015年末 |
| 期末可供分配利润 | -39,624,990.89 | -2,742,282.76 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2238 | -0.0075 |
| 期末基金资产净值 | 137,398,073.37 | 362,403,292.90 |
| 期末基金份额净值 | 0.776 | 0.992 |
| **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 | -22.40% | -0.80% |

注：1、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；

2、期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3、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。

4、本基金基金合同于2015年12月23日生效，至报告期末不满二年。

## 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

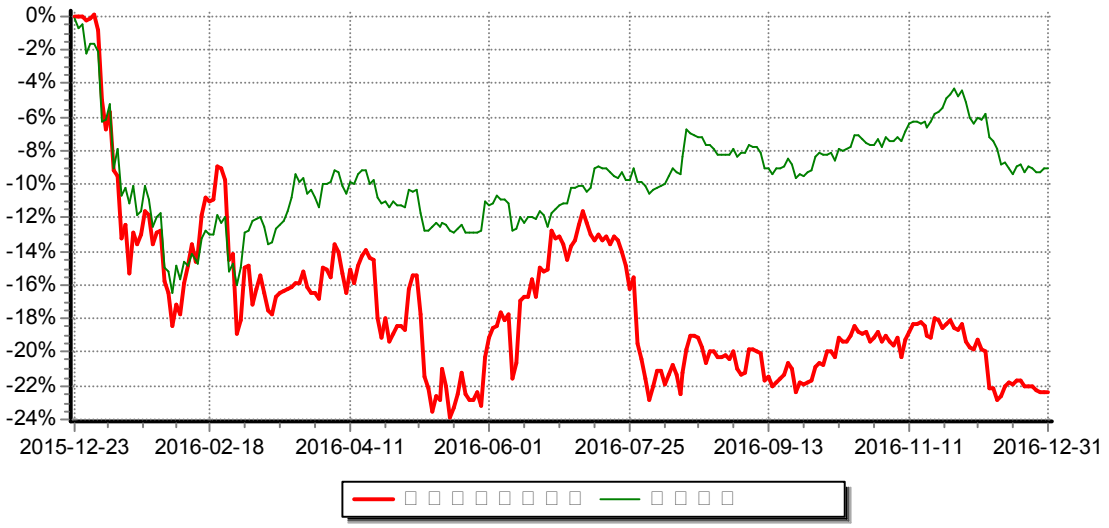
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.89% | 0.69% | 0.12% | 0.45% | -1.01% | 0.24% |
| 过去六个月 | -10.19% | 0.90% | 2.40% | 0.47% | -12.59% | 0.43% |
| 过去一年 | -21.77% | 1.44% | -7.42% | 0.84% | -14.35% | 0.60% |
| 自基金合同生效日起至今（2015年12月23日-2016年12月31日） | -22.40% | 1.42% | 9.33% | 0.84% | -31.73% | 0.58% |

### 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

东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

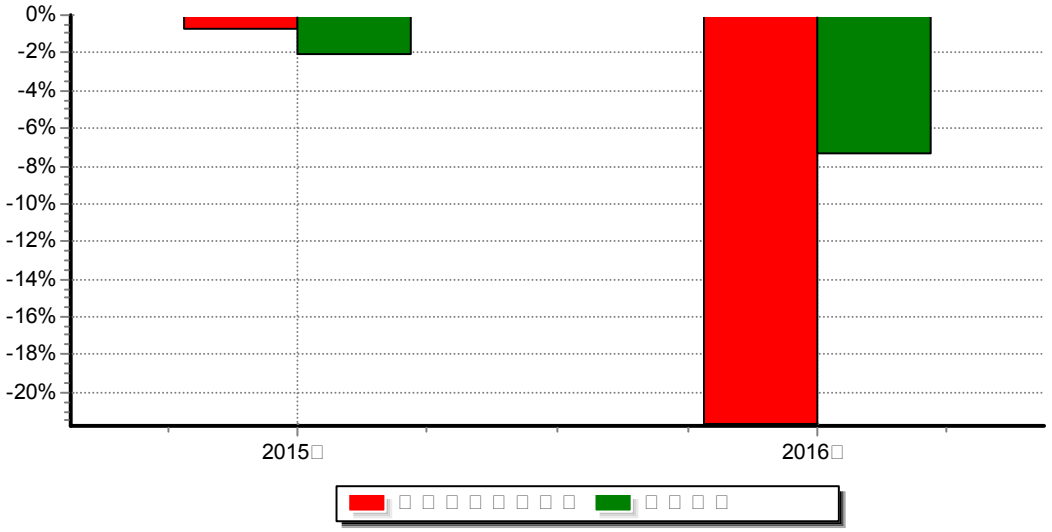
（2015年12月23日-2016年12月31日）



注：1、本基金基金合同生效日为2015年12月23日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内，截至本报告期末已完成建仓但距建仓结束不满一年；

2、建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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：本基金基金合同于2015年12月23日生效,自合同生效以来未满五年。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

本基金自基金合同生效日（2015年12月23日）至报告期截止日（2016年12月31日）未进行利润分配。

# §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

东兴证券股份有限公司（股票简称"东兴证券"，股票代码"601198"，以下简称"本公司"）是2008年经财政部和中国证监会批准，由中国东方资产管理公司作为主要发起人发起设立的全国性综合类证券公司，2015年2月26日在上海证券交易所上市，是国内首家资产管理公司系上市证券公司。

本公司注册资本27.58亿元，总部设在北京。公司业务涵盖证券经纪、证券投资咨询、与证券交易和证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券投资基金销售业务、证券自营和证券资产管理业务、融资融券业务、代销金融产品业务、公开募

集证券投资基金管理业务，形成覆盖场内与场外、线下和线上、国内和海外的综合金融服务体系。

本公司经中国证券监督管理委员会核准（证监许可【2015】67号）于2015年1月8日获得公开募集证券投资基金管理业务资格。截至2016年12月31日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金和东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金共5只开放式基金。

### 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 | | |
| 程远先生 | 本基金基金经理 | 2015年12月23日 | — | 8年 | 学士，8年证券行业从业经验。2008年加入东兴证券投资银行总部工作，2009年任东兴证券研究所纺织服装行业高级研究员，2011年任华泰证券（原华泰联合）研究所纺织服装研究组组长，2013年任华泰证券纺织服装组组长兼任轻工造纸组和旅游酒店组组长，现任东兴证券基金业务部研究总监、投资决策委员会委员、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 孙继青先生 | 本基金基金经理 | 2015年12月23日 | — | 9年 | 北京科技大学工学硕士，3年钢铁行业经验，9年证券行业经验。2007年10月加入东兴证券，2007年 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 10月至2012年3月任东兴证券研究所钢铁行业研究员；2012年3月至2013年6月任东兴证券资产管理部投资品行业研究员、宏观策略研究员；2013年6月至2014年9月任东兴证券资产管理部投资经理。2014年9月加入东兴证券基金业务部。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴安盈宝货币市场基金基金经理。 |
| 刘家伟先生 | 本基金基金经理 | 2016年1月15日 | — | 19年 | 经济学博士，从事证券行业18年以上，曾任大通证券研发中心副总经理，2007年入职东兴证券股份有限公司研究所，从事卖方研究。曾任造纸、农业、食品饮料行业分析师，历任食品饮料首席分析师、消费组组长、研究所副所长、研究总监等。现任职基金业务部投资研究团队。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，公平交易制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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成交量5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年初，人民币汇率大幅贬值，熔断机制受挫，大股东减持套现增加以及美国酝酿加息等异常复杂局面，使得年初股市面临重重压力，一月份出现了大幅杀跌的单边走势；随着两会的召开，2016年政府工作重点及十三五规划及时发布、房地产市场去库存及差异化调控政策密集出台、供给侧改革快速发力等等，一系列改革与发展举措开始发挥效果，结合美国加息延后、石油与许多大宗商品价格上涨、国内肉菜价格

大幅攀升、国内房地产市场成交活跃、经济数据预期有所改善等情况，股市开始企稳并有所反弹。

二季度针对复杂的国内外环境，我国宏观调控更加灵活有度且精准发力，发力供给侧改革，突出去杠杆，淘汰落后产能；加快国企改革步伐，推动国企重组；财税改革注重减税、优化税收结构（如营改增）；产业发展方面着力调动民间投资积极性，推动新经济更快发展，打造经济新动能；货币政策强调稳中灵活，防范系统性风险，注重"脱虚向实"，以逆回购、中短期借贷便利等为主的各类工具灵活适度运用，保持了合理的流动性。可以认为，这些改革和支持部署对整个实体经济和资本市场都构成了重要支持和方向性引导。股市二季度虽有几次较大大幅波动但基本上是"平稳"运行或窄幅震荡。

进入2016年下半年，国内宏观经济并未能承接上半年所呈现的持续回暖趋势，在7月份出现了较大程度的回落。多项经济数据的快速滑落致使市场出现经济下行压力不减反增，上半年实体经济增长过分依赖房地产行业等论调的抬头。在美国加息预期提升、人民币贬值、政策监管收紧等影响下，市场出现了震荡调整走势。

四季度以来，国内经济数据持续上修，市场整体风险偏好有所回暖，在保险资金配置稳定增长的蓝筹股的带动下，A股走出一波向上运行的行情。进入12月，美国加息落地，人民币持续贬值创新低且中美利差收窄，造成资本外流压力加大。随着国内经济增长和通胀预期的下修，险资监管趋严，总体流动性环境持续偏紧，A股市场总体呈现震荡走势，债券市场遭遇流动性危机。

报告期内，本基金根据主题内涵，在行业配置方面仍然侧重蓝海市场，主要选择新能源、新材料、消费电子、传媒等新兴战略产业及竞争尚不是非常充分的领域，进行适当配置。同时，更加注重风险控制、及时捕捉机会、尽量减少失误或误判。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年1月1日起至2016年12月31日，本基金净值增长率为-21.77%，业绩比较基准收益率为-7.42%，低于业绩比较基准14.35%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，供给侧改革仍将持续，房地产调控压力持续存在，经济复苏预期可能会在补库存周期结束之后面临回调，短期看由于经济已经企稳，短期内不具备降息降准的基础，如果经济有二次探底的波动，不排除下半年加大财政刺激和货币政策调整。由于PPI高企，补库存周期没有结束，大宗商品价格持续上涨、消费品价格有上涨趋势，特别是去年房地产价格大幅上涨之后，CPI有上涨的预期。

从国际环境来看，美国特朗普上台之后的经济政治政策仍存在不确定性，再加上欧洲仍处于艰难复苏，可能会对国内经济产生较大的扰动。

经历了2016年市场大幅波动之后，A股整体来看估值处于相对低位，大幅下跌的风险较小，在目前经济企稳预期下，经济复苏预期向中游传导，中游行业可能在补库存周期结束之前仍有较大的投资机会，CPI上涨预期下，下游消费品仍有较大的投资机会，另外国企改革和一带一路可能会超预期，仍将是重要的投资主题。

2017年最大的风险是经济的二次探底和通胀超预期。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

### 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相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

## §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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-东兴证券股份有限公司2016年1月1日至2016年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为,东兴证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，东兴证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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 | 瑞华审字【2017】01460013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 | 东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的东兴证券股份有限公司作为管理人按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制的东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金（以下简称基金）的财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表，2016年度的利润表和持有人权益(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 | 编制和公允列报基金财务报表是基金管理人东兴证券股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使基金财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对基金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基金财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 |

| | |
|---|---|
| | 审计工作涉及执行审计程序，以获取有关基金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基金财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与基金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管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价基金财务报表的总体列报。<br>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。 |
| 审计意见段 | 我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照附注二所述编制基础编制，公允反映了东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金于2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动情况。 |
| 注册会计师的姓名 | 王需如、刘涛 |
| 会计师事务所的名称 | 瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5层 |
| 审计报告日期 | 2017年3月22日 |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | | 78,058,438.22 | 199,769,166.18 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 结算备付金 | | 741,859.18 | — |
| 存出保证金 | | 518,307.32 | — |
| 交易性金融资产 | | 55,122,584.82 | 157,031,627.48 |
| 其中：股票投资 | | 55,122,584.82 | 157,031,627.48 |
| 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 | | — | — |
| 买入返售金融资产 | | — | 50,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 4,497,515.24 | — |
| 应收利息 | | 15,939.07 | 72,534.55 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | — | — |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | | — | — |
| 资产总计 | | 138,954,643.85 | 406,873,328.21 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>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 | | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | — | — |
| 应付证券清算款 | | — | 44,181,827.76 |
| 应付赎回款 | | 1,163,889.41 | — |
| 应付管理人报酬 | | 181,911.96 | 119,992.51 |
| 应付托管费 | | 30,318.67 | 19,998.74 |
| 应付销售服务费 | | — | — |
| 应付交易费用 | | 168,227.90 | 148,216.30 |
| 应交税费 | | — | — |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付利息 | | — | — |
| 应付利润 | | — | — |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | | 12,222.54 | — |
| 负债合计 | | 1,556,570.48 | 44,470,035.31 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | | 177,023,064.26 | 365,145,575.66 |
| 未分配利润 | | -39,624,990.89 | -2,742,282.76 |
| 所有者权益合计 | | 137,398,073.37 | 362,403,292.90 |
| 负债和所有者权益总计 | | 138,954,643.85 | 406,873,328.21 |

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值0.776元，基金份额总额177,023,064.26份。

2、本基金基金合同于2015年12月23日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2016年1月1日-<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日-<br>2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | -58,502,685.32 | -2,437,692.67 |
| 1.利息收入 | | 593,026.51 | 72,534.55 |
| 其中：存款利息收入 | | 521,902.49 | 56,537.79 |
| 债券利息收入 | | 13,478.26 | — |
| 资产支持证券利息收入 | | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 57,645.76 | 15,996.76 |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -57,840,258.00 | 174,508.59 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：股票投资收益 | | -58,203,114.52 | 174,508.59 |
| 基金投资收益 | | | |
| 债券投资收益 | | -3,880.00 | — |
| 资产支持证券投资收益 | | — | — |
| 贵金属投资收益 | | — | — |
| 衍生工具收益 | | — | — |
| 股利收益 | | 366,736.52 | — |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -1,680,866.24 | -2,684,735.81 |
| 4.汇兑收益（损失以“—”号填列） | | | |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 425,412.41 | — |
| **减：二、费用** | | 10,302,068.03 | 304,590.09 |
| 1．管理人报酬 | | 3,046,201.74 | 119,992.51 |
| 2．托管费 | | 507,700.30 | 19,998.74 |
| 3．销售服务费 | | — | — |
| 4．交易费用 | | 6,627,125.45 | 164,193.84 |
| 5．利息支出 | | — | — |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | — | — |
| 6．其他费用 | | 121,040.54 | 405.00 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | -68,804,753.35 | -2,742,282.76 |
| 减：所得税费用 | | — | — |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -68,804,753.35 | -2,742,282.76 |

注：本基金基金合同于2015年12月23日生效，上年度可比期间为为2015年12月23日至2015年12月31日。

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2016年1月1日-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) | 365,145,575.66 | -2,742,282.76 | 362,403,292.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | -68,804,753.35 | -68,804,753.35 |
| 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） | -188,122,511.40 | 31,922,045.22 | -156,200,466.18 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,672,687.68 | -477,057.42 | 2,195,630.26 |
| 2.基金赎回款 | -190,795,199.08 | 32,399,102.64 | -158,396,096.44 |
| 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） | 177,023,064.26 | -39,624,990.89 | 137,398,073.37 |
| 项 目 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日-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) | — | — | — |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | -2,742,282.76 | -2,742,282.76 |
| 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） | 365,145,575.66 | — | 365,145,575.66 |
| 其中：1.基金申购款 | 365,145,575.66 | — | 365,145,575.66 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2.基金赎回款 | — | — | — |
| 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） | 365,145,575.66 | -2,742,282.76 | 362,403,292.90 |

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:

| | | |
|---|---|---|
| 魏庆华 | 魏庆华 | 王青 |
| ———————— | ———————— | ———————— |
| 基金管理公司负责人 | 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

东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2015年11月19日中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于准予东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2667号）的批复,自2015年12月7日至2015年12月18日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集365,119,408.43元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）"瑞华验字[2015]01460035号"验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年12月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为365,145,575.66份，其中认购资金利息折合26,167.23份。本基金基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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（含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、权证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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规变更或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称"企业会计准则"）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年1月1日至2016年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及

持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

**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**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

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、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。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。

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

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以

及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

（3）权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

（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）买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

（6）卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计

入初始成本。卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如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影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（4）交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

**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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

**7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内

含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益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，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

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时确认。

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**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12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，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**

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

**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**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

**7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

**7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

**7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税【2007】84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101号《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》、财税【2016】36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1.于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2.对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.对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，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。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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 东兴证券股份有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国东方资产管理公司 | 基金管理人的控股股东 |
| 东兴期货有限责任公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 东兴证券投资有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 东兴资本投资管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 东兴证券（香港）金融控股有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 大连银行股份有限公司 | 与基金管理人同一控股股东关联方 |

### 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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日-2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日（基金合同生效日）-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 |
|---|---|---|---|---|
| 东兴证券股份有限公司 | 4,369,195,073.84 | 100.00% | 162,642,680.70 | 100.00% |

7.4.8.1.2 **债券交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日-2016年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2015年12月23日（基金合同生效日）-2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 150,000,000.00 | 100.00% | 50,000,000.00 | 100.00% |

7.4.8.1.4 **权证交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金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<br>2016年1月1日-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 |
| 东兴证券股份有限公司 | 4,013,290.55 | 100.00% | 167,768.05 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日（基金合同生效日）-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 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 东兴证券股份有限公司 | 148,216.30 | 100.00% | 148,216.30 | 100.00% |

### 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<br>2016年1月1日-2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日（基金合同生效日）-2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,046,201.74 | 119,992.51 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,801.67 | 77.25 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷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5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<br>2016年1月1日-2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日-2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 507,700.30 | 19,998.74 |

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×0.25%÷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5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

本基金本报告期和上年度可比期间，未与关联方进行银行间同业市场的债券(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：份

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日-2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年12月23日（基金合同生效日）-2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2015年12月23日）持有的基金份额 | — | 9,999,000.00 |
| 期初持有的基金份额 | 9,999,000.00 | 9,999,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | — | — |
| 期间因拆分变动份额 | — | — |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 3,000,000.00 | — |
| 期末持有的基金份额 | 6,999,000.00 | 9,999,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 3.95% | 2.74% |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用按招募说明书中规定的费率收取。

#### 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

### 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<br>2016年1月1日-2016年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2015年12月23日（基金合同生效日）-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 |
| 中国农业银行 | 78,058,438.22 | 482,128.89 | 199,769,166.18 | 56,537.79 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 股份有限公司 | | | | |

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联事项的说明。

7.4.9 期末（2016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/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600687 | 刚泰控股 | 2016-07-25 | 重大资产重组停牌 | 15.85 | 2017-01-18 | 16.38 | 400,000 | 7,243,007.00 | 6,340,000.00 |

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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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 | 55,122,584.82 | 39.67 |
| | 其中：股票 | 55,122,584.82 | 39.67 |
| 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 | 78,800,297.40 | 56.71 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,031,761.63 | 3.62 |
| 8 | 合计 | 138,954,643.85 | 100.00 |

## 8.2 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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 18,396,684.82 | 13.39 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | 642,000.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,352,000.00 | 3.90 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,805,000.00 | 4.22 |
| J | 金融业 | 6,424,000.00 | 4.68 |
| K | 房地产业 | — | — |

| | | | |
|---|---|---|---|
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | — | — |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | — | — |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 18,502,900.00 | 13.47 |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 55,122,584.82 | 40.12 |

## 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 | 600030 | 中信证券 | 400,000 | 6,424,000.00 | 4.68 |
| 2 | 600687 | 刚泰控股 | 400,000 | 6,340,000.00 | 4.61 |
| 3 | 000049 | 德赛电池 | 150,000 | 6,307,500.00 | 4.59 |
| 4 | 002405 | 四维图新 | 300,000 | 5,805,000.00 | 4.22 |
| 5 | 000802 | 北京文化 | 300,000 | 5,802,000.00 | 4.22 |
| 6 | 002036 | 联创电子 | 300,000 | 5,748,000.00 | 4.18 |
| 7 | 300426 | 唐德影视 | 200,000 | 5,700,000.00 | 4.15 |
| 8 | 002245 | 澳洋顺昌 | 600,000 | 5,352,000.00 | 3.90 |
| 9 | 300364 | 中文在线 | 120,000 | 4,742,400.00 | 3.45 |
| 10 | 002343 | 慈文传媒 | 50,000 | 2,258,500.00 | 1.64 |
| 11 | 000018 | 神州长城 | 60,000 | 642,000.00 | 0.47 |
| 12 | 603566 | 普莱柯 | 49 | 1,184.82 | — |

## 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 | 002405 | 四维图新 | 30,343,961.90 | 8.37 |
| 2 | 002048 | 宁波华翔 | 26,177,121.11 | 7.22 |
| 3 | 300373 | 扬杰科技 | 26,102,831.58 | 7.20 |
| 4 | 000802 | 北京文化 | 23,919,069.71 | 6.60 |
| 5 | 002284 | 亚太股份 | 23,339,879.08 | 6.44 |
| 6 | 300481 | 濮阳惠成 | 21,902,589.79 | 6.04 |
| 7 | 300376 | 易事特 | 21,552,629.44 | 5.95 |
| 8 | 002709 | 天赐材料 | 21,177,730.80 | 5.84 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 20,894,838.00 | 5.77 |
| 10 | 300479 | 神思电子 | 20,547,746.75 | 5.67 |
| 11 | 000858 | 五 粮 液 | 19,712,194.40 | 5.44 |
| 12 | 300100 | 双林股份 | 19,213,023.24 | 5.30 |
| 13 | 002597 | 金禾实业 | 19,137,090.18 | 5.28 |
| 14 | 002053 | 云南能投 | 18,900,041.78 | 5.22 |
| 15 | 002407 | 多氟多 | 18,786,787.90 | 5.18 |
| 16 | 002340 | 格林美 | 18,342,156.49 | 5.06 |
| 17 | 002466 | 天齐锂业 | 17,845,795.92 | 4.92 |
| 18 | 000070 | 特发信息 | 17,752,322.53 | 4.90 |
| 19 | 300014 | 亿纬锂能 | 17,492,866.03 | 4.83 |
| 20 | 002234 | 民和股份 | 17,392,473.63 | 4.80 |
| 21 | 300420 | 五洋科技 | 16,803,210.15 | 4.64 |
| 22 | 603456 | 九洲药业 | 16,784,658.20 | 4.63 |
| 23 | 000555 | 神州信息 | 16,577,105.10 | 4.57 |
| 24 | 002019 | 亿帆医药 | 16,557,983.62 | 4.57 |
| 25 | 600563 | 法拉电子 | 16,182,329.24 | 4.47 |
| 26 | 002117 | 东港股份 | 15,744,702.63 | 4.34 |
| 27 | 002456 | 欧菲光 | 15,528,511.10 | 4.28 |
| 28 | 000402 | 金 融 街 | 15,313,246.62 | 4.23 |
| 29 | 002664 | 信质电机 | 15,200,626.78 | 4.19 |
| 30 | 600816 | 安信信托 | 15,103,289.83 | 4.17 |
| 31 | 600074 | 保千里 | 15,066,973.70 | 4.16 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 32 | 300327 | 中颖电子 | 14,785,088.03 | 4.08 |
| 33 | 000980 | 金马股份 | 14,311,839.00 | 3.95 |
| 34 | 601618 | 中国中冶 | 14,285,684.06 | 3.94 |
| 35 | 600686 | 金龙汽车 | 14,263,729.10 | 3.94 |
| 36 | 002533 | 金杯电工 | 14,224,906.00 | 3.93 |
| 37 | 300059 | 东方财富 | 14,198,001.10 | 3.92 |
| 38 | 300037 | 新宙邦 | 14,176,847.01 | 3.91 |
| 39 | 002460 | 赣锋锂业 | 14,114,007.82 | 3.89 |
| 40 | 002013 | 中航机电 | 14,031,930.18 | 3.87 |
| 41 | 000558 | 莱茵体育 | 13,843,668.14 | 3.82 |
| 42 | 002329 | 皇氏集团 | 13,385,241.79 | 3.69 |
| 43 | 002325 | 洪涛股份 | 13,375,303.90 | 3.69 |
| 44 | 002343 | 慈文传媒 | 12,991,379.76 | 3.58 |
| 45 | 300279 | 和晶科技 | 12,933,103.40 | 3.57 |
| 46 | 600895 | 张江高科 | 12,441,669.00 | 3.43 |
| 47 | 300048 | 合康新能 | 12,107,716.00 | 3.34 |
| 48 | 300457 | 赢合科技 | 11,866,817.40 | 3.27 |
| 49 | 000998 | 隆平高科 | 11,809,688.33 | 3.26 |
| 50 | 600559 | 老白干酒 | 11,523,410.18 | 3.18 |
| 51 | 600887 | 伊利股份 | 11,424,965.95 | 3.15 |
| 52 | 600621 | XD华鑫股 | 11,271,528.28 | 3.11 |
| 53 | 600623 | 华谊集团 | 11,264,522.00 | 3.11 |
| 54 | 300313 | 天山生物 | 11,069,441.52 | 3.05 |
| 55 | 002630 | 华西能源 | 10,927,001.69 | 3.02 |
| 56 | 600708 | 光明地产 | 10,877,002.09 | 3.00 |
| 57 | 000573 | 粤宏远Ａ | 10,798,250.00 | 2.98 |
| 58 | 000049 | 德赛电池 | 10,560,544.11 | 2.91 |
| 59 | 002448 | 中原内配 | 10,495,340.94 | 2.90 |
| 60 | 601918 | *ST新集 | 10,262,381.00 | 2.83 |
| 61 | 601668 | 中国建筑 | 10,164,200.00 | 2.80 |
| 62 | 300353 | 东土科技 | 10,005,976.60 | 2.76 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 63 | 002736 | 国信证券 | 9,996,880.00 | 2.76 |
| 64 | 002537 | 海立美达 | 9,991,917.00 | 2.76 |
| 65 | 000413 | 东旭光电 | 9,850,418.00 | 2.72 |
| 66 | 600372 | 中航电子 | 9,742,993.00 | 2.69 |
| 67 | 600869 | 智慧能源 | 9,664,575.80 | 2.67 |
| 68 | 002733 | 雄韬股份 | 9,661,291.58 | 2.67 |
| 69 | 300198 | 纳川股份 | 9,654,483.00 | 2.66 |
| 70 | 002590 | 万安科技 | 9,517,910.00 | 2.63 |
| 71 | 002006 | 精功科技 | 9,490,860.78 | 2.62 |
| 72 | 601186 | 中国铁建 | 9,485,082.00 | 2.62 |
| 73 | 600328 | 兰太实业 | 9,435,193.00 | 2.60 |
| 74 | 002224 | 三 力 士 | 9,428,091.27 | 2.60 |
| 75 | 002171 | 楚江新材 | 9,378,624.22 | 2.59 |
| 76 | 600392 | 盛和资源 | 9,255,172.95 | 2.55 |
| 77 | 603023 | 威帝股份 | 9,238,893.57 | 2.55 |
| 78 | 300377 | 赢时胜 | 9,200,900.00 | 2.54 |
| 79 | 002276 | 万马股份 | 9,178,141.32 | 2.53 |
| 80 | 600593 | 大连圣亚 | 9,171,058.34 | 2.53 |
| 81 | 603019 | 中科曙光 | 9,110,296.27 | 2.51 |
| 82 | 300068 | 南都电源 | 8,965,966.00 | 2.47 |
| 83 | 002473 | 圣莱达 | 8,958,491.00 | 2.47 |
| 84 | 000831 | *ST五稀 | 8,950,392.80 | 2.47 |
| 85 | 300287 | 飞利信 | 8,926,203.00 | 2.46 |
| 86 | 600531 | 豫光金铅 | 8,894,602.00 | 2.45 |
| 87 | 600260 | 凯乐科技 | 8,809,806.44 | 2.43 |
| 88 | 002646 | 青青稞酒 | 8,790,507.06 | 2.43 |
| 89 | 000797 | 中国武夷 | 8,719,913.57 | 2.41 |
| 90 | 600459 | 贵研铂业 | 8,697,952.00 | 2.40 |
| 91 | 300065 | 海兰信 | 8,694,640.00 | 2.40 |
| 92 | 603009 | 北特科技 | 8,691,573.17 | 2.40 |
| 93 | 600597 | 光明乳业 | 8,648,885.00 | 2.39 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 94 | 601689 | 拓普集团 | 8,605,300.34 | 2.37 |
| 95 | 601069 | 西部黄金 | 8,494,854.00 | 2.34 |
| 96 | 000762 | 西藏矿业 | 8,465,319.41 | 2.34 |
| 97 | 600201 | 生物股份 | 8,461,483.65 | 2.33 |
| 98 | 000625 | 长安汽车 | 8,443,533.00 | 2.33 |
| 99 | 600085 | 同仁堂 | 8,424,615.99 | 2.32 |
| 100 | 300001 | 特锐德 | 8,400,482.02 | 2.32 |
| 101 | 000158 | 常山股份 | 8,379,270.68 | 2.31 |
| 102 | 600775 | 南京熊猫 | 8,373,284.69 | 2.31 |
| 103 | 600489 | 中金黄金 | 8,263,456.00 | 2.28 |
| 104 | 601799 | 星宇股份 | 8,181,288.48 | 2.26 |
| 105 | 601233 | 桐昆股份 | 8,176,532.00 | 2.26 |
| 106 | 300311 | 任子行 | 8,093,540.20 | 2.23 |
| 107 | 300098 | 高新兴 | 8,022,986.50 | 2.21 |
| 108 | 002092 | 中泰化学 | 7,992,603.00 | 2.21 |
| 109 | 601877 | 正泰电器 | 7,988,614.62 | 2.20 |
| 110 | 300005 | 探路者 | 7,951,518.09 | 2.19 |
| 111 | 000608 | 阳光股份 | 7,904,486.00 | 2.18 |
| 112 | 002792 | 通宇通讯 | 7,904,358.70 | 2.18 |
| 113 | 000021 | 深科技 | 7,901,535.66 | 2.18 |
| 114 | 300066 | 三川智慧 | 7,898,110.80 | 2.18 |
| 115 | 600552 | 凯盛科技 | 7,814,065.00 | 2.16 |
| 116 | 300509 | 新美星 | 7,793,250.00 | 2.15 |
| 117 | 002108 | 沧州明珠 | 7,774,493.00 | 2.15 |
| 118 | 002142 | 宁波银行 | 7,712,510.20 | 2.13 |
| 119 | 300207 | 欣旺达 | 7,668,152.00 | 2.12 |
| 120 | 000630 | 铜陵有色 | 7,657,000.00 | 2.11 |
| 121 | 002488 | 金固股份 | 7,656,068.00 | 2.11 |
| 122 | 300291 | 华录百纳 | 7,653,922.00 | 2.11 |
| 123 | 002452 | 长高集团 | 7,584,584.46 | 2.09 |
| 124 | 000666 | 经纬纺机 | 7,527,850.00 | 2.08 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 125 | 601211 | 国泰君安 | 7,486,843.88 | 2.07 |
| 126 | 600418 | 江淮汽车 | 7,456,254.80 | 2.06 |
| 127 | 603589 | 口子窖 | 7,403,217.09 | 2.04 |
| 128 | 002631 | 德尔未来 | 7,393,353.00 | 2.04 |
| 129 | 300342 | 天银机电 | 7,330,625.00 | 2.02 |
| 130 | 600305 | 恒顺醋业 | 7,306,837.10 | 2.02 |
| 131 | 603997 | 继峰股份 | 7,260,753.00 | 2.00 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、"买入金额"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。

### 8.4.2 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 | 002048 | 宁波华翔 | 28,502,730.39 | 7.86 |
| 2 | 300479 | 神思电子 | 28,333,847.90 | 7.82 |
| 3 | 300373 | 扬杰科技 | 27,452,037.00 | 7.57 |
| 4 | 002405 | 四维图新 | 23,561,633.72 | 6.50 |
| 5 | 002709 | 天赐材料 | 23,391,318.77 | 6.45 |
| 6 | 300100 | 双林股份 | 22,884,973.48 | 6.31 |
| 7 | 002284 | 亚太股份 | 22,661,493.97 | 6.25 |
| 8 | 300481 | 濮阳惠成 | 22,614,098.00 | 6.24 |
| 9 | 300457 | 赢合科技 | 21,194,529.18 | 5.85 |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 21,136,044.74 | 5.83 |
| 11 | 002597 | 金禾实业 | 20,134,433.90 | 5.56 |
| 12 | 300376 | 易事特 | 20,106,372.80 | 5.55 |
| 13 | 000858 | 五 粮 液 | 19,781,179.27 | 5.46 |
| 14 | 000558 | 莱茵体育 | 19,299,964.36 | 5.33 |
| 15 | 002340 | 格林美 | 19,237,307.29 | 5.31 |
| 16 | 002466 | 天齐锂业 | 19,017,396.00 | 5.25 |
| 17 | 002053 | 云南能投 | 18,608,489.78 | 5.13 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 18 | 000555 | 神州信息 | 18,567,957.49 | 5.12 |
| 19 | 002407 | 多氟多 | 18,464,656.30 | 5.10 |
| 20 | 000802 | 北京文化 | 17,955,249.81 | 4.95 |
| 21 | 002019 | 亿帆医药 | 17,527,940.83 | 4.84 |
| 22 | 002456 | 欧菲光 | 16,868,778.45 | 4.65 |
| 23 | 600563 | 法拉电子 | 16,415,268.26 | 4.53 |
| 24 | 002013 | 中航机电 | 16,313,640.98 | 4.50 |
| 25 | 000070 | 特发信息 | 16,205,703.38 | 4.47 |
| 26 | 002664 | 信质电机 | 16,029,678.20 | 4.42 |
| 27 | 002234 | 民和股份 | 15,878,273.20 | 4.38 |
| 28 | 300420 | 五洋科技 | 15,808,298.82 | 4.36 |
| 29 | 000413 | 东旭光电 | 15,791,605.57 | 4.36 |
| 30 | 600816 | 安信信托 | 15,471,791.88 | 4.27 |
| 31 | 601618 | 中国中冶 | 15,441,555.02 | 4.26 |
| 32 | 000980 | 金马股份 | 15,431,158.00 | 4.26 |
| 33 | 300037 | 新宙邦 | 15,414,296.00 | 4.25 |
| 34 | 002712 | 思美传媒 | 15,244,870.30 | 4.21 |
| 35 | 600074 | 保千里 | 15,219,835.92 | 4.20 |
| 36 | 300059 | 东方财富 | 15,216,945.00 | 4.20 |
| 37 | 000402 | 金 融 街 | 15,208,052.95 | 4.20 |
| 38 | 000608 | 阳光股份 | 14,893,653.91 | 4.11 |
| 39 | 002533 | 金杯电工 | 14,400,994.84 | 3.97 |
| 40 | 300001 | 特锐德 | 14,344,944.52 | 3.96 |
| 41 | 600030 | 中信证券 | 14,168,945.00 | 3.91 |
| 42 | 300327 | 中颖电子 | 14,099,867.19 | 3.89 |
| 43 | 603456 | 九洲药业 | 14,015,422.31 | 3.87 |
| 44 | 002460 | 赣锋锂业 | 13,946,096.34 | 3.85 |
| 45 | 600686 | 金龙汽车 | 13,806,022.34 | 3.81 |
| 46 | 002117 | 东港股份 | 13,430,158.00 | 3.71 |
| 47 | 002630 | 华西能源 | 13,214,401.00 | 3.65 |
| 48 | 300279 | 和晶科技 | 12,789,751.65 | 3.53 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 49 | 600552 | 凯盛科技 | 12,654,797.75 | 3.49 |
| 50 | 000998 | 隆平高科 | 12,391,983.00 | 3.42 |
| 51 | 600621 | XD华鑫股 | 12,117,956.00 | 3.34 |
| 52 | 600623 | 华谊集团 | 11,993,130.72 | 3.31 |
| 53 | 600895 | 张江高科 | 11,900,403.26 | 3.28 |
| 54 | 300048 | 合康新能 | 11,797,401.40 | 3.26 |
| 55 | 002004 | 华邦健康 | 11,526,147.60 | 3.18 |
| 56 | 600887 | 伊利股份 | 11,507,837.59 | 3.18 |
| 57 | 600559 | 老白干酒 | 11,450,443.07 | 3.16 |
| 58 | 002343 | 慈文传媒 | 11,374,979.30 | 3.14 |
| 59 | 002325 | 洪涛股份 | 11,217,912.19 | 3.10 |
| 60 | 002329 | 皇氏集团 | 11,009,198.80 | 3.04 |
| 61 | 002276 | 万马股份 | 10,924,348.13 | 3.01 |
| 62 | 002448 | 中原内配 | 10,908,939.00 | 3.01 |
| 63 | 601668 | 中国建筑 | 10,772,700.00 | 2.97 |
| 64 | 600869 | 智慧能源 | 10,545,799.40 | 2.91 |
| 65 | 002537 | 海立美达 | 10,506,493.77 | 2.90 |
| 66 | 600708 | 光明地产 | 10,391,911.76 | 2.87 |
| 67 | 002590 | 万安科技 | 10,355,185.61 | 2.86 |
| 68 | 002641 | 永高股份 | 10,133,186.48 | 2.80 |
| 69 | 002733 | 雄韬股份 | 9,971,717.00 | 2.75 |
| 70 | 601069 | 西部黄金 | 9,956,400.51 | 2.75 |
| 71 | 300287 | 飞利信 | 9,923,156.74 | 2.74 |
| 72 | 601186 | 中国铁建 | 9,907,590.34 | 2.73 |
| 73 | 000573 | 粤宏远A | 9,900,387.12 | 2.73 |
| 74 | 002736 | 国信证券 | 9,894,833.92 | 2.73 |
| 75 | 300313 | 天山生物 | 9,631,663.00 | 2.66 |
| 76 | 600392 | 盛和资源 | 9,613,115.46 | 2.65 |
| 77 | 600593 | 大连圣亚 | 9,462,133.00 | 2.61 |
| 78 | 002473 | 圣莱达 | 9,441,798.55 | 2.61 |
| 79 | 300377 | 赢时胜 | 9,437,130.00 | 2.60 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 80 | 601689 | 拓普集团 | 9,383,072.50 | 2.59 |
| 81 | 601918 | *ST新集 | 9,289,581.85 | 2.56 |
| 82 | 300198 | 纳川股份 | 9,278,581.02 | 2.56 |
| 83 | 600372 | 中航电子 | 9,273,425.94 | 2.56 |
| 84 | 600489 | 中金黄金 | 9,170,485.40 | 2.53 |
| 85 | 300068 | 南都电源 | 9,089,492.00 | 2.51 |
| 86 | 002792 | 通宇通讯 | 9,000,708.84 | 2.48 |
| 87 | 600531 | 豫光金铅 | 8,766,919.64 | 2.42 |
| 88 | 002646 | 青青稞酒 | 8,608,431.00 | 2.38 |
| 89 | 300353 | 东土科技 | 8,600,192.00 | 2.37 |
| 90 | 000762 | 西藏矿业 | 8,575,035.00 | 2.37 |
| 91 | 300379 | 东方通 | 8,563,826.00 | 2.36 |
| 92 | 603023 | 威帝股份 | 8,545,726.99 | 2.36 |
| 93 | 601233 | 桐昆股份 | 8,527,554.00 | 2.35 |
| 94 | 300065 | 海兰信 | 8,453,182.00 | 2.33 |
| 95 | 002171 | 楚江新材 | 8,446,287.00 | 2.33 |
| 96 | 603019 | 中科曙光 | 8,386,637.00 | 2.31 |
| 97 | 603009 | 北特科技 | 8,363,053.05 | 2.31 |
| 98 | 300005 | 探路者 | 8,357,717.25 | 2.31 |
| 99 | 000797 | 中国武夷 | 8,297,870.00 | 2.29 |
| 100 | 002452 | 长高集团 | 8,270,305.00 | 2.28 |
| 101 | 000831 | *ST五稀 | 8,267,953.18 | 2.28 |
| 102 | 002006 | 精功科技 | 8,266,370.73 | 2.28 |
| 103 | 300509 | 新美星 | 8,261,000.00 | 2.28 |
| 104 | 600775 | 南京熊猫 | 8,177,262.64 | 2.26 |
| 105 | 600597 | 光明乳业 | 8,160,361.81 | 2.25 |
| 106 | 600085 | 同仁堂 | 8,111,443.74 | 2.24 |
| 107 | 300311 | 任子行 | 8,101,507.00 | 2.24 |
| 108 | 603997 | 继峰股份 | 8,079,181.45 | 2.23 |
| 109 | 000625 | 长安汽车 | 8,000,049.00 | 2.21 |
| 110 | 300066 | 三川智慧 | 7,952,759.01 | 2.19 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 111 | 600260 | 凯乐科技 | 7,927,105.00 | 2.19 |
| 112 | 002631 | 德尔未来 | 7,897,856.65 | 2.18 |
| 113 | 002721 | 金一文化 | 7,889,933.00 | 2.18 |
| 114 | 002224 | 三 力 士 | 7,854,356.00 | 2.17 |
| 115 | 601211 | 国泰君安 | 7,815,465.22 | 2.16 |
| 116 | 600459 | 贵研铂业 | 7,811,923.08 | 2.16 |
| 117 | 002108 | 沧州明珠 | 7,802,412.15 | 2.15 |
| 118 | 600622 | 嘉宝集团 | 7,761,371.93 | 2.14 |
| 119 | 600201 | 生物股份 | 7,656,114.82 | 2.11 |
| 120 | 002142 | 宁波银行 | 7,644,689.79 | 2.11 |
| 121 | 000630 | 铜陵有色 | 7,626,000.00 | 2.10 |
| 122 | 600328 | 兰太实业 | 7,571,055.08 | 2.09 |
| 123 | 601799 | 星宇股份 | 7,550,591.08 | 2.08 |
| 124 | 002577 | 雷柏科技 | 7,542,467.89 | 2.08 |
| 125 | 300342 | 天银机电 | 7,537,125.46 | 2.08 |
| 126 | 000666 | 经纬纺机 | 7,440,525.58 | 2.05 |
| 127 | 300291 | 华录百纳 | 7,436,027.02 | 2.05 |
| 128 | 000158 | 常山股份 | 7,409,317.51 | 2.04 |
| 129 | 002518 | 科士达 | 7,399,849.74 | 2.04 |
| 130 | 601877 | 正泰电器 | 7,356,155.11 | 2.03 |
| 131 | 000021 | 深科技 | 7,348,489.00 | 2.03 |
| 132 | 601311 | 骆驼股份 | 7,288,460.32 | 2.01 |
| 133 | 002304 | 洋河股份 | 7,275,380.94 | 2.01 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、"卖出金额"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。

### 8.4.3 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 | 2,180,949,044.05 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 2,222,974,105.95 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股

票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、"买入股票成本"、"卖出股票收入"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名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名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名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

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本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。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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 | 518,307.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,497,515.24 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 15,939.07 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 5,031,761.63 |

### 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

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价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600687 | 刚泰控股 | 6,340,000.00 | 4.61 | 重大资产重组停牌 |

## §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 |
| 1,920 | 92,199.51 | 7,099,083.87 | 4.01% | 169,923,980.39 | 95.99% |

### 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 | 1,724,128.70 | 0.97% |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2015年12月23日)基金份额总额 | 365,145,575.66 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 365,145,575.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,672,687.68 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 190,795,199.08 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 177,023,064.26 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金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

本基金管理人（以下简称"本公司"或"公司"）于2015年12月8日召开2015年第二次临时会议，审议通过选举印建民先生担任公司董事的议案。印建民先生于2016年1月28日取得证券公司董事任职资格，自前述资格取得之日起正式就任公司第三届董事会董事。

本公司于2015年12月8日召开2015年第二次临时会议，审议通过选举秦斌先生担任公司董事的议案。秦斌先生于2016年1月28日取得证券公司董事任职资格，自前述资格取得之日起正式就任公司第三届董事会董事。

本公司第三届董事会第二十八次会议于2016年11月7日在北京以现场及电话方式举行，董事会同意聘任刘亮先生、陈海先生为公司副总经理。刘亮先生仍兼任公司董事会秘书。刘亮先生、陈海先生均已取得中国证监会核准的高级管理人员任职资格。

本公司于2016年12月6日在公司总部召开职工代表大会，选举杜斌先生、郝洁女士为公司第四届监事会职工代表监事。杜斌先生、郝洁女士将与公司股东大会选举产生的非职工代表监事共同组成公司第四届监事会，任期与第四届监事会任期一致。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内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

本基金本报告期内未更换会计师事务所，本报告期应支付给瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用10,000.00元；截至2016年12月31日，该审计机构向本基金提供审计服务不满2年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

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监管部门稽查或处罚。

## 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 | |
| 东兴证券股份有限公司 | 2 | 4,403,923,150.00 | 100.00% | 4,013,290.55 | 100.00% | |

注：1、此处的佣金指本基金通过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合计,不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能在租赁其他证券公司的交易单元。

4、本基金本报告期内未新增租用交易单元。

### 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 | 占债券成交总额比例 | 成交金额 | 占债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占权证成交总额比例 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 东兴证券股份有限公司 | — | — | 150,000,000.00 | 100.00% | — | — |

**东兴证券股份有限公司**

**二〇一七年三月二十七日**