

# 东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 31 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 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§4 管理人报告</b>	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
<b>§5 托管人报告</b>	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
<b>§6 审计报告</b>	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§7 年度财务报表</b>	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
<b>§8 投资组合报告</b>	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
8.12 投资组合报告附注.....	56
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>69</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
13.1 备查文件目录 .....	70
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东海祥龙定增混合
场内简称	东海祥龙
基金主代码	168301
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 21 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	863,058,457.47 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 2 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	报告期内通过选择优质项目积极参与定向增发项目报价。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 × 50%+ 中债综合指数收益率 × 50%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。

### 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	东海基金管理有限责任公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王恒	郭明
	联系电话	021-60586966	010-66105799
	电子邮箱	wangheng@donghaifunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-9595531		95588
传真	021-60586926		010-66105798

注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢360室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦15楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	葛伟忠	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.donghaifunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	东海基金管理有限责任公司	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦15楼

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年 12 月 21 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年
本期已实现收益	-1,070,146.28	-68,598.56	-
本期利润	-48,290,406.40	-68,598.56	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0560	-0.0001	-
本期加权平均净值利润率	-5.61%	-0.01%	-
本期基金份额净值增长率	-5.59%	-0.01%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-48,359,004.96	-68,598.56	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0560	-0.0001	-
期末基金资产净值	814,699,452.51	862,989,858.91	-
期末基金份额净值	0.9440	0.9999	-
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-5.60%	-0.01%	-

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) 本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 21 日，至本报告期末未满两年。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.74%	0.43%	1.96%	0.40%	-8.70%	0.03%
过去六个月	-5.42%	0.34%	4.24%	0.35%	-9.66%	-0.01%
过去一年	-5.59%	0.26%	8.60%	0.32%	-14.19%	-0.06%

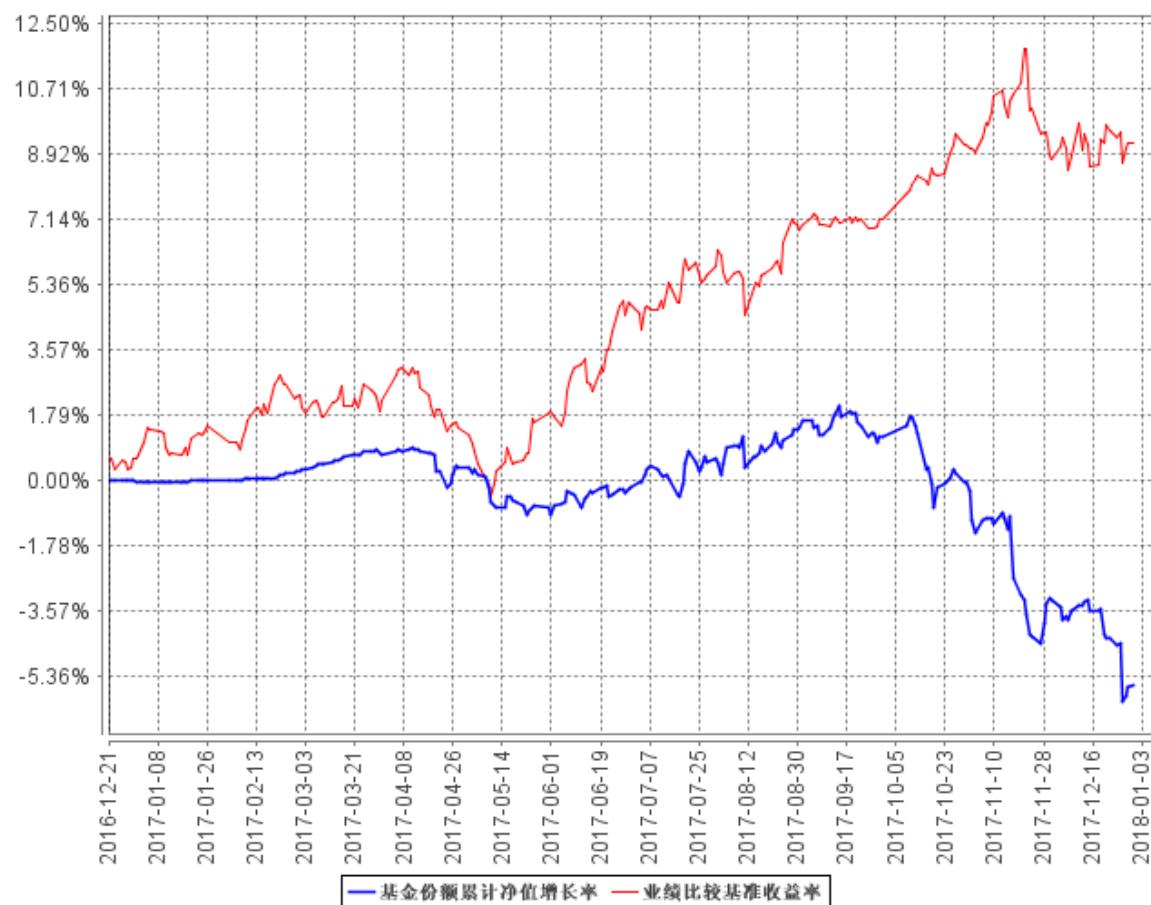
过去三年	0.00%	0.26%	0.00%	0.32%	0.00%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-5.60%	0.26%	9.26%	0.32%	-14.86%	-0.06%

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%+中债综合指数收益率×50%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：(1) 本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 21 日，截止本报告期期末未满两年；

(2) 本基金的投资范围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（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允

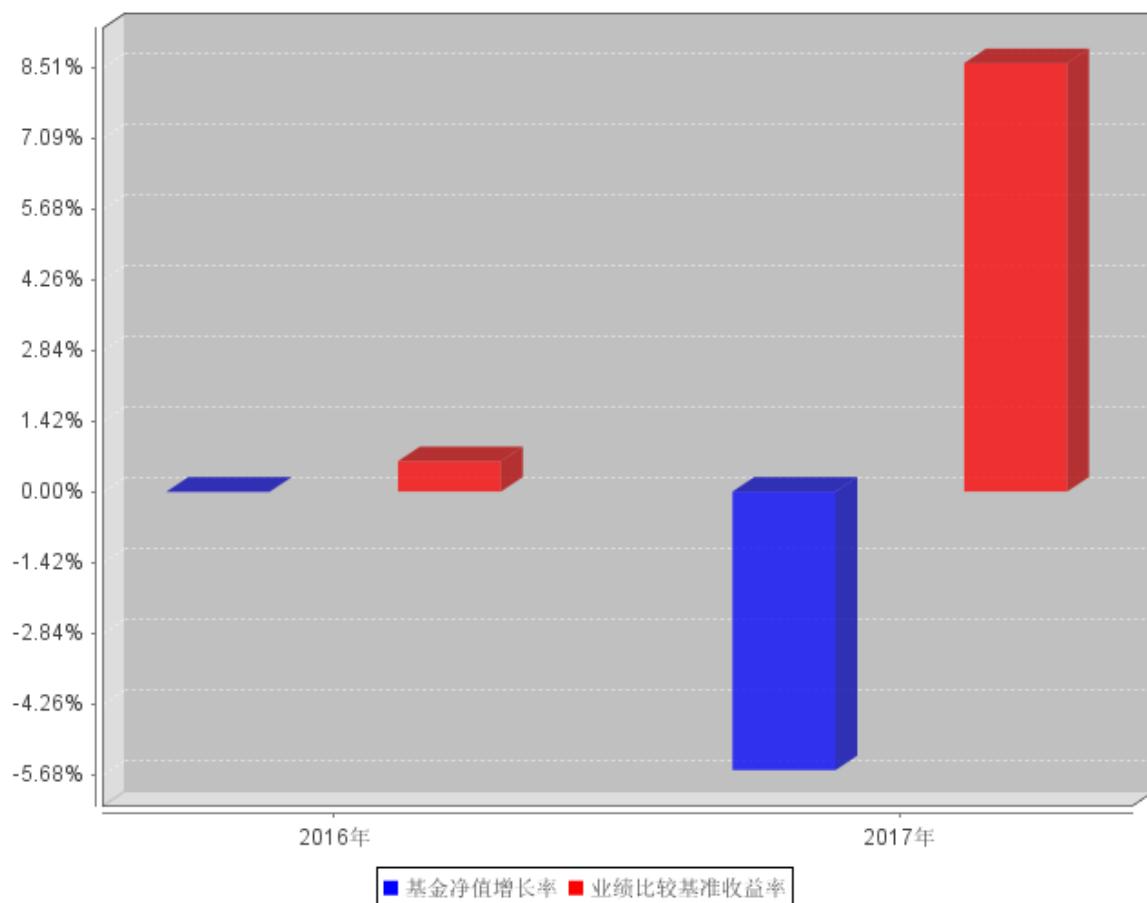
许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 21 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年

度进行折算。

### **3.3 其他指标**

注： -

### **3.4 过去三年基金的利润分配情况**

注：自 2016 年 12 月 21 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60余人，业务骨干的平均从业年限在十年以上。公司秉承“基金份额持有人利益优先、管理创造价值、品质创造财富”的经营理念，在夯实基础上稳步推进创新发展步伐，努力建设成“运作稳健、专业精良、治理完善、诚信合规”在业内具有影响力的现代资产管理公司。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金、东海祥瑞债券型证券投资基金和东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡德军	本基金的基金经理	2016年12月21日	-	9年	国籍：中国。上海交通大学生物医学工程博士，曾任齐鲁证券有限公司研究所医药行业研究员，2013年6月加入东海基金，历任公司研究开发部高级研究员、专户理财部投资经理等职。现任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海祥龙定增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。

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

(2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2017 年定增市场受到监管政策变化影响较大，其中证监会对《上市公司非公开发行股票实施细则》部分条文进行了修订并发布了《发行监管问答—关于引导规范上市公司融资行为的监管要求》，主要针对三个方面进行了修改，一是上市公司申请非公开发行股票的，拟发行的股份数量不得超过本次发行前总股本的 20%。二是上市公司申请增发、配股、非公开发行股票的，本次发行董事会决议日距离前次募集资金到位日原则上不得少于 18 个月。前次募集资金包括首发、增发、配股、非公开发行股票。但对于发行可转债、优先股和创业板小额快速再融资的，不受此期限限制。三是上市公司申请再融资时，除金融类企业外，原则上最近一期末不得存在持有金额较大、期限较长的交易性金融资产和可供出售的金融资产、借予他人款项、委托理财等财务性投资的情形，因此 2017 年从再融资新规对定增基金影响巨大。

本报告期内，东海祥龙在整体操作上采取了相对比较谨慎的策略，在项目选择上始终将公司基本面放在第一位，精选项目为主，但受到整体市场低迷影响，整体净值表现不佳。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9439 元；本报告期基金份额净值增长率为 -5.59%，业绩比较基准收益率为 8.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年最大的挑战来源于全球主要央行逐步退出货币宽松；全球经济可能从货币刺激转向创新驱动，同时金融监管加强是新常态；中国经济如何从以前过度依靠金融地产转向更多依靠先进制造、消费和创新有望成为新的时代议题。中国经济的成功转型，改革将是其中重要的一环，因此科学的发展观将是未来社会前进的重要动力，这其中供给体系离不开研发支出，同时收入水平的提高和收入差距的缩小有望进一步提振消费需求，这既体现在高端商品与服务消费，也体现在必需品的消费，大力提高创新能力意味着未来高技术产业的生产、投资以及盈利前景更好。这样一种变化为我们指明了未来资本市场投资的重要方向。展望 2018 年，国内经济整体稳健，但去

杠杆可能导致短暂的流动性风险，因此 2018 年投资整体谨慎为主，其中消费升级和新进制造业板块将是投资的重要方向。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会由总经理、督察长、投资总监和运营总监及公司相关业务部门工作人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金管理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映其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 1、在封闭期内，本基金不进行收益分配。
- 2、转换为上市开放式基金（LOF）后，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 25%；
- 3、本基金场外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；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；本基金场内收益分配方式为现金分红；
- 4、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；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东海祥龙定增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，东海祥龙定增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祥龙定增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，东海祥龙定增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祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1800409 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 34 页的东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“东海祥龙定增混合型基金”) 财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度和自 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了东海祥龙定增混合型基金 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和自 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东海祥龙定增混合型基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司管理

	<p>层对其他信息负责。其他信息包括东海祥龙定增混合型基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司管理层负责评估东海祥龙定增混合型基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非东海祥龙定增混合型基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司治理层负责监督东海祥龙定增混合型基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重</p>

	<p>大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东海祥龙定增混合型基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东海祥龙定增混合型基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与东海祥龙定增混合型基金管理人东海基金管理有限责任公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	黄小熠 刘叶君
会计师事务所的地址	北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	100,857,129.25	795,444,665.26
结算备付金		137,397.38	-
存出保证金		9,964.50	-
交易性金融资产	7.4.7.2	703,627,094.66	-
其中：股票投资		234,699,094.66	-
基金投资		-	-
债券投资		468,928,000.00	-
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		-	67,821,257.15
应收利息	7.4.7.5	11,639,494.54	142,480.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		816,271,080.33	863,408,403.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,055,913.85	353,737.03
应付托管费		175,985.66	58,956.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	59,728.31	-
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	280,000.00	5,851.12
负债合计		1,571,627.82	418,544.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	863,058,457.47	863,058,457.47
未分配利润	7.4.7.10	-48,359,004.96	-68,598.56
所有者权益合计		814,699,452.51	862,989,858.91
负债和所有者权益总计		816,271,080.33	863,408,403.23

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9440 元，基金份额总额 863,058,457.47 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-32,767,537.61	350,545.76
1. 利息收入		13,458,330.48	350,545.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,594,493.31	229,963.58
债券利息收入		4,922,954.71	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,940,882.46	120,582.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		994,392.03	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,256,439.57	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,250,831.60	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-47,220,260.12	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		15,522,868.79	419,144.32

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,920,911.36	353,737.03
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,153,485.19	58,956.17
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	—	—
4. 交易费用	7.4.7.19	87,255.15	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.20	361,217.09	6,451.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-48,290,406.40	-68,598.56
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-48,290,406.40	-68,598.56

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	863,058,457.47	-68,598.56	862,989,858.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-48,290,406.40	-48,290,406.40
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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
四、本期间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）	863,058,457.47	-48,359,004.96	814,699,452.51
项目	上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-68,598.56	-68,598.56
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)	863,058,457.47	-	863,058,457.47
其中：1. 基金申购款	863,058,457.47	-	863,058,457.47
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）	863,058,457.47	-68,598.56	862,989,858.91

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

邓升军

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

东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），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[2016] 2305 号文《关于准予东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由东海基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同已于 2016 年 12 月 21 日生效，首次设立募集规模为 863,058,457.47 份基金份额，本基金为契约型，存续期限不定。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。本基金的封闭期是指自《基金合同》生效之日起包括（《基金合同》生效之日）至第 18 个月

后对应日（含该日）的期间，如遇非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。本基金的基金管理人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（以下简称“中国工商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和更新的《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围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（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债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相关规定）。

本基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所在地中国证监会派出机构备案。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、自 2016 年 12 月 21 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间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**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止和自 2016 年 12 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前持有的股票投资、债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### **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**

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

除特别声明外，本基金按下列原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生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，对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，

以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### **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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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**

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (累计亏损) ”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### **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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

在封闭期内，本基金不进行收益分配。本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，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 25%；

本基金场外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；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；本基金场内收益分配方式为现金分红；

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；每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017] 13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资

基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC) 基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017] 6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **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**

本基金在本年度及自 2016 年 12 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间均未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称“估值指引”）的处理标准，本基金自 2017 年 12 月 27 日起，对本基金持有的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票的估值方法进行调整，参考估值指引进行估值。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本年度及自 2016 年 12 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间均未发生重大会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

##### **(1) 主要税项说明**

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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〔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》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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〔2008〕1号文《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》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。
- (c) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

#### **7.4.7 重要财务报表项目的说明**

##### **7.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	100,857,129.25	795,444,665.26
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	100,857,129.25	795,444,665.26

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	281,351,764.78	234,699,094.66	-46,652,670.12
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	1,000.00	1,000.00	-
交易所市场	1,000.00	1,000.00	-
银行间市场	469,494,590.00	468,927,000.00	-567,590.00
合计	469,495,590.00	468,928,000.00	-567,590.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	750,847,354.78	703,627,094.66	-47,220,260.12
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-
银行间市场	-	-	-
合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	20,320.55	142,480.82
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	67.98	-
应收债券利息	11,619,101.06	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	4.95	-
合计	11,639,494.54	142,480.82

注：其他为应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	56,453.31	-
银行间市场应付交易费用	3,275.00	-
合计	59,728.31	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费		
预提费用	280,000.00	5,851.12
合计	280,000.00	5,851.12

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	863,058,457.47	863,058,457.47
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	863,058,457.47	863,058,457.47

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-68,598.56	-	-68,598.56
本期利润	-1,070,146.28	-47,220,260.12	-48,290,406.40
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,138,744.84	-47,220,260.12	-48,359,004.96

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	2,322,030.03	229,963.58

定期存款利息收入	200,000.00	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	72,438.11	-
其他	25.17	-
合计	2,594,493.31	229,963.58

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基金 合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	22,085,837.61	-
减： 卖出股票成本总额	24,342,277.18	-
买卖股票差价收入	-2,256,439.57	-

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末投资资产支持证券，资产支持证券投资收益为零。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具-其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,250,831.60	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,250,831.60	-

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合 同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-47,220,260.12	-
——股票投资	-46,652,670.12	-
——债券投资	-567,590.00	-

——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-47,220,260.12	-

#### 7.4.7.18 其他收入

注：注：本基金本报告期间及上年度可比期间未产生其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 21 日(基金合同生 效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	83,980.15	-
银行间市场交易费用	3,275.00	-
合计	87,255.15	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 21 日(基金合同生 效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	194,148.88	5,851.12
银行费用	2,063.21	600.00
上市年费	85,000.00	-
其他费用	5.00	-
合计	361,217.09	6,451.12

#### 7.4.7.21 分部报告

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无分部报告。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期末无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东海证券股份有限公司	12,778,748.95	20.83%	0.00	0.00%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日	

	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
东海证券股 份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016 年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东海证券股 份有限公司	9,954,300,000.00	100.00%	700,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东海证券股 份有限公司	11,900.85	21.08%	11,900.85	21.08%
上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日				
关联方名称	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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12	上年度可比期间 2016年12月21日(基金合同生效

	月 31 日	日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,920,911.36	353,737.03
其中：支付销售机构的客户维护费	539,087.78	22,032.76

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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效 日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,153,485.19	58,956.17

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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交 易的 各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
	债券交易金额 基金买入	基金卖 出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金 额	利息支出
中国工商银行 股份有限公司	-	-	30,064,110.00	462,574.34	-	-

(“中国工商银行”)						
上年度可比期间						
2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固定资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东海瑞京资产管理(上海)有限公司	4,999,450.00	0.5800%	4,999,450.00	0.5800%

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 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	100,857,129.25	2,322,030.03	795,444,665.26	229,963.58

注：(1) 除上表列示的金额外，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，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间获得的利息收入为人民币 72,438.11，2017 年 12 月 31 日结算备付金为人民币 137,397.38 元。

(2) 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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300195	长荣股份	2017 年 4 月 20 日	2018 年 4 月 23 日	非公开发行流通受限	15.51	13.68	2,675,693	41,499,998.43	36,603,480.24	-
300195	长荣股份	2017 年 4 月 20 日	2019 年 4 月 23 日	非公开发行流通受限	15.51	13.21	2,675,693	41,499,998.43	35,345,904.53	-
000885	同力水泥	2017 年 2 月 22 日	2018 年 2 月 23 日	非公开发行流通受限	13.90	14.84	2,000,000	27,800,000.00	29,680,000.00	-
000885	同力水泥	2017 年 2 月 22 日	2019 年 2 月 25 日	非公开发行流通	13.90	13.37	2,000,000	27,800,000.00	26,740,000.00	-

			日	通受限							
600063	皖维 高新	2017 年 5 月 9 日	2018 年 5 月 9 日	非公 开发 行流 通受 限	4.65	3.65	6,451,613	30,000,000.45	23,548,387.45		-
000862	银星 能源	2017 年 1 月 16 日	2018 年 1 月 18 日	非公 开发 行流 通受 限	7.03	4.78	4,823,703	33,910,628.58	23,057,300.34		-
600063	皖维 高新	2017 年 5 月 9 日	2019 年 5 月 9 日	非公 开发 行流 通受 限	4.65	3.52	6,451,613	30,000,000.45	22,709,677.76		-
000862	银星 能源	2017 年 1 月 16 日	2019 年 1 月 18 日	非公 开发 行流 通受 限	7.03	4.57	4,823,702	33,910,628.57	22,044,318.14		-

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128034	宁行 转债	2017 年 12 月 5 日	2018 年 1 月 12 日	新债未 上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

## 7.4.13 金融工具风险及管理

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

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规与风险管理委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部对公司运作各环节的各类风险进行监控。

### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以

中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	149,612,000.00	-
合计	149,612,000.00	-

注：本基金本报告期末未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	1,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	319,315,000.00	-
合计	319,316,000.00	-

注：本基金本报告期末未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

截至 2017 年 12 月 31 日, 本基金目前仍处于封闭期, 无赎回风险及投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难问题。

本报告期末, 除完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外, 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2017年 12月 31日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资							

产							
银行存款	100,857,129.25	-	-	-	-	-	100,857,129.25
结算备付金	137,397.38	-	-	-	-	-	137,397.38
存出保证金	9,964.50	-	-	-	-	-	9,964.50
交易性金融资产	40,008,000.00	29,952,000.00	398,967,000.00	-1,000.00	234,699,094.66	703,627,094.66	
应收利息	-	-	-	-	-	11,639,494.54	11,639,494.54
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	141,012,491.13	29,952,000.00	398,967,000.00	-1,000.00	246,338,589.20	816,271,080.33	
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,055,913.85	1,055,913.85
应付	-	-	-	-	-	175,985.66	175,985.66

托管费							
应付交易费用						59,728.31	59,728.31
其他负债						280,000.00	280,000.00
负债总计						1,571,627.82	1,571,627.82
利率敏感度缺口	141,012,491.1 3	29,952,000.0 0	398,967,000.0 0	-1,000.0 0	244,766,961.3 8	814,699,452.5 1	
上年度末 2016年 12月 31日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	795,444,665.2 6						795,444,665.2 6
应收证券清						67,821,257.15	67,821,257.15

算 款						
应 收 利 息	-	-	-	-	142,480.82	142,480.82
资 产 总 计	795,444,665.2 6	-	-	-	67,963,737.97	863,408,403.2 3
负 债						
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	353,737.03	353,737.03
应 付 托 管 费					58,956.17	58,956.17
其 他 负 债	-	-	-	-	5,851.12	5,851.12
负 债 总 计	-	-	-	-	418,544.32	418,544.32
利 率 敏 感 度 缺 口	795,444,665.2 6	-	-	-	67,545,193.65	862,989,858.9 1

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况;
----	--------------------------------

	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末( 2017 年 12 月 31 日 )	上年度末 ( 2016 年 12 月 31 日 )
	市场利率上升 25 个基点	-246,249.56	-
	市场利率下降 25 个基点	246,605.21	-

注：2017 年年度末，本基金未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	234,699,094.66	28.81	-	-

交易性金融资产—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	468,928,000.00	57.56		
交易性金融资产—贵金属投资				
衍生金融资产—权证投资				
其他				
合计	703,627,094.66	86.37		

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
	本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）	
	业绩比较基准增加1%	1,910,387.81	-
	业绩比较基准减少1%	-1,910,387.81	-

注：(1) 本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

(2) 本基金成立于2016年12月21日，2016年年度末，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 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 234699094.66 元，属于第二层次的余额为人民币 468928000.00 元，无划分为第三层次的余额。

#### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	234,699,094.66	28.75
	其中：股票	234,699,094.66	28.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	468,928,000.00	57.45
	其中：债券	468,928,000.00	57.45
	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	100,994,526.63	12.37
8	其他各项资产	11,649,459.04	1.43
9	合计	816,271,080.33	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	133,177,476.18	16.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,101,618.48	5.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	56,420,000.00	6.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	234,699,094.66	28.82

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300195	长荣股份	5,351,386	71,949,384.77	8.83
2	000885	同力水泥	4,000,000	56,420,000.00	6.93
3	600063	皖维高新	12,903,226	56,258,065.21	5.68
4	000862	银星能源	9,647,405	45,101,618.48	5.54
5	000568	泸州老窖	124,638	8,226,108.00	1.01
6	601689	拓普集团	161,700	4,000,458.00	0.49
7	600518	康美药业	122,695	2,743,460.20	0.34

## 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	300195	长荣股份	82,999,996.86	9.62
2	000862	银星能源	67,821,257.15	7.86
3	600063	皖维高新	60,000,000.90	6.95
4	000885	同力水泥	55,600,000.00	6.44

5	000568	泸州老窖	11,410,499.24	1.32
6	600297	广汇汽车	6,995,190.14	0.81
7	600196	复星医药	5,173,492.14	0.60
8	300364	中文在线	4,993,996.95	0.58
9	601689	拓普集团	4,590,398.00	0.53
10	600518	康美药业	4,291,372.58	0.50
11	603788	宁波高发	1,794,778.00	0.21
12	601019	山东出版	10,160.00	0.00
13	600025	华能水电	6,510.00	0.00
14	002903	宇环数控	6,390.00	0.00

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交量）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	600297	广汇汽车	6,515,434.15	0.75
2	600196	复星医药	5,110,482.90	0.59
3	000568	泸州老窖	3,999,366.03	0.46
4	300364	中文在线	3,316,993.46	0.38
5	603788	宁波高发	1,587,121.00	0.18
6	600518	康美药业	1,499,067.07	0.17
7	002903	宇环数控	29,023.00	0.00
8	601019	山东出版	15,270.00	0.00
9	600025	华能水电	13,080.00	0.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	438,904,669.41
卖出股票收入（成交）总额	155,296,465.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	99,840,000.00	12.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	369,087,000.00	45.30
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	468,928,000.00	57.56

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150207	15 国开 07	800,000	79,952,000.00	9.81
2	110223	11 国开 23	800,000	79,552,000.00	9.76
3	150309	15 进出 09	700,000	69,888,000.00	8.58
4	170408	17 农发 08	700,000	69,790,000.00	8.57
5	150409	15 农发 09	500,000	49,915,000.00	6.13

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

#### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金暂不投资国债期货。

#### **8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

#### **8.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### **8.12 投资组合报告附注**

#### **8.12.1**

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### **8.12.2**

报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### **8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,964.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,639,494.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	11, 649, 459. 04

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300195	长荣股份	71, 949, 384. 77	8. 83	非公开发行
2	000885	同力水泥	56, 420, 000. 00	6. 93	非公开发行
3	600063	皖维高新	46, 258, 065. 21	5. 68	非公开发行
4	000862	银星能源	45, 101, 618. 48	5. 54	非公开发行

#### 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
5, 504	156, 805. 68	144, 551, 429. 94	16. 75%	718, 507, 027. 53	83. 25%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额 比例
1	江苏省国际信托有限责任公司	50, 004, 500. 09	5. 79%
2	鲁涛	24, 801, 960. 00	2. 87%
3	阳光万恒集团有限公司	19, 999, 900. 00	2. 32%
4	融通资本—广州农商银行—易方达资产管理有限公司	13, 686, 359. 00	1. 59%
5	李文娣	12, 037, 477. 42	1. 39%
6	郭新民	10, 002, 333. 00	1. 16%
7	张孔沛	7, 921, 307. 00	0. 92%
8	孙芸	6, 999, 315. 00	0. 81%
9	上海铂绅投资中心(有限合伙)－铂绅二号证券投资基金(私募)	6, 617, 202. 00	0. 77%
10	宁波万坤投资管理合伙企业(有限合伙)－万坤全套利量化 1 号私募	6, 406, 754. 00	0. 74%

### 9.3 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	781, 274. 09	0. 0905%

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月21日）基金份额总额	863,058,457.47
本报告期期初基金份额总额	863,058,457.47
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-填列）	-
本报告期末基金份额总额	863,058,457.47

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人 2017 年 3 月 28 日公告，新任邓升军先生为公司副总经理。
- 2、基金管理人 2017 年 6 月 2 日公告，刘建锋先生不再担任公司总经理，由邓升军先生代履行总经理职责。
- 3、基金管理人 2017 年 8 月 30 日公告，新任邓升军先生为公司总经理，邓升军先生不再担任公司副总经理。
- 4、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人自 2017 年 4 月 20 日起改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东海证券	2	12,778,748.95	20.83%	11,900.85	21.08%	-
华鑫证券	2	20,135,548.08	32.83%	18,752.34	33.22%	-
宏源证券	2	27,922,241.13	45.52%	25,445.16	45.07%	-
恒泰证券	2	499,026.50	0.81%	354.96	0.63%	-

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，经相关部门确认后，报公司领导审批；
- (3) 基金业务部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
东海证券	-	-	-	-	-	-

华鑫证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金 2016 年年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 1 月 3 日
2	《东海基金管理有限责任公司关于参加东海期货有限责任公司费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 1 月 5 日
3	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 1 月 19 日
4	《关于东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金开通系统内转托管和跨系统转托管业务的公告》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 2 月 22 日
5	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 2 月 22 日

6	《东海基金管理有限责任公司关于网上交易系统升级的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年2月23日
7	《关于东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告-同力水泥》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年2月24日
8	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易提示性公告》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年2月27日
9	《东海基金管理有限责任公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年3月2日
10	《东海基金管理有限责任公司关于网上交易系统升级的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年3月28日
11	《东海基金管理有限责任公司关于副总经理任职的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年3月28日
12	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业	2017年4月21日

	1 季度报告》	务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	
13	《关于东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 4 月 22 日
14	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 4 月 22 日
15	《东海基金管理有限责任公司关于新增长江证券股份有限公司为代销机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 5 月 4 日
16	《关于祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 5 月 11 日
17	《东海基金管理有限责任公司关于新增平安证券股份有限公司为代销机构的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 5 月 15 日
18	《东海基金管理有限责任公司关于总经理变更的公告》	《上海证券报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 6 月 2 日

19	《东海基金管理有限责任公司关于网上交易系统升级的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年6月29日
20	《关于执行〈证券期货投资者适当性管理办法〉、〈非居民进入账户涉税信息尽职调查管理办法〉的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年6月29日
21	《关于旗下基金 2017 年半年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年7月1日
22	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告》	《上海证券报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年7月19日
23	《东海基金管理有限责任公司关于网上交易系统升级的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年8月1日
24	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2017年第1号)》及《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要更新(2017年第1号)》	《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017年8月5日

25	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告》、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要》	《上海证券报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 8 月 25 日
26	《东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》	《上海证券报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 8 月 30 日
27	《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告》	《上海证券报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 10 月 27 日
28	《东海基金管理有限责任公司关于网上交易系统升级的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 11 月 1 日
29	《东海基金管理有限责任公司关于参加平安证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 11 月 3 日
30	《东海基金管理有限责任公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 12 月 27 日
31	《东海基金管理有限责任公司关于旗下产品自 2018 年 1	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所基金业务专区和基金管理人网站 (www.donghaifunds.com)	2017 年 12 月 30 日

	月 1 日起缴纳增值税的公告》 交易所基金业务专区和基金 管理人网站 (www.donghaifunds.com)	
--	--	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
注：本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处

### 13.3 查阅方式

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

东海基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 31 日