

# 信息披露 Disclosure

## 东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

### 【2015】第三季度报告

—3%；任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%。持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在1个月以内的国债逆回购不得低于基金资产净值的5%。

(3)本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束前各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

#### 4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
王庆仁	副总经理、基金经理	2014年11月14日	2015年8月14日	15
杜斌	基金经理	2014年11月14日	-	16

注: (1)此表的任职日期、离任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,则任职日期与基金合同生效日;

(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

(3)截至本报告送出日,本基金基金经理王庆仁先生已辞去公司副总经理及基金经理职务,相关公告已于2015年9月6日通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及公司官网(www.donghaifund.com)对外披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》及中国证监会颁布的其它有关规定,严格遵守基金合同,恪守诚信、勤勉尽责的原则,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资组合,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、交易合规性控制、投资决策、交易执行、风险控制等方面对公平交易进行定期和不定期评估。

4.3.2 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规则,同时加强对申购和赎回交易和同日反向交易的监控和报告。公司利用公平交易分析系统,对同一投资组合内不同时间窗口下的所有投资组合进行持续跟踪,并定期对各投资组合的申购和赎回交易、对同一投资组合内不同时间窗口下的所有投资组合,对采用类似投资策略的投资组合与其他投资组合的同一日反向交易进行监控和分析。本报告期内本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未成交的成交量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为0次。

4.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.5 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.6 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.7 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.8 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.9 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.10 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.11 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.12 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.13 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.14 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.15 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.16 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.17 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.18 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.19 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.20 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.21 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.22 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.23 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.24 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.25 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.26 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.27 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.28 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.29 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.30 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.31 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.32 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.33 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.34 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.35 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.36 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.37 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.38 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.39 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.40 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.41 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.42 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.43 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.44 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

4.45 报告期内本基金的投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情形。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	31,691,137.14	67.40
其中:股票	31,691,137.14	67.40	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
4	银行存款	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-	-
7	银行承兑票据和货币资金合计	10,416,071.06	22.15
8	其他资产	4,915,364.44	10.46
9	合计	47,022,501.64	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林、牧、渔业	-	-
2	采矿业	2,240,891.70	5.34
3	制造业	15,435,000.74	36.78
4	电力、热力、燃气及生产和服务供应	-	-
5	建筑业	1,862,507.70	4.44
6	批发和零售业	-	-
7	交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	金融业	-	-
10	房地产业	-	-
11	租赁和商务服务业	-	-
12	科学研究和技术服务业	-	-
13	水利、环境和公共设施管理业	12,154,674.00	28.97
14	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
15	文化、体育和娱乐业	-	-
16	合计	21,691,137.14	75.63

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	东方钨业	2,963,444.00	7.04	停牌
2	600529	广厦有色	2,240,891.70	5.34	停牌