

基金管理人:东海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26日

§ 1 重要提示

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。
基金托管人承诺以诚实信用、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2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金主要财务指标

基金名称		东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金		
基金代码	000922	报告期	2015年第3季度	金额(元)
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014年11月14日			
报告期末基金份额总额	36,329,222.97份			

本基金通过定期报告,定期披露资产配置情况,并及时关注在建项目中的主要进展,受经济结构转型经济形势影响的年报,加以对金融工具适度控制系统风险,以获得中长期稳定回报率较高的投资回报。

投资目标

报告期未发生变更。

投资策略

本基金通过定期报告,定期披露资产配置情况,并及时关注在建项目中的主要进展,受经济结构转型经济形势影响的年报,加以对金融工具适度控制系统风险,以获得中长期稳定回报率较高的投资回报。

业绩比较基准

沪深300指数收益率×50%+上证国债收益率×50%

风险收益特征

本基金为偏债型基金,低于股票型基金产品,属于中高风险·中高预期收益的基金产品。

基金管理人

东海基金管理有限公司

基金托管人

中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益		-3,083,790.34
2.本期利润		-18,356,657.79
3.加权平均基金份额本期利润		-0.05329
4.期末基金资产净值		41,967,001.97
5.期末基金份额净值		1.171

注:(1)本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不计费用的情况。
(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。

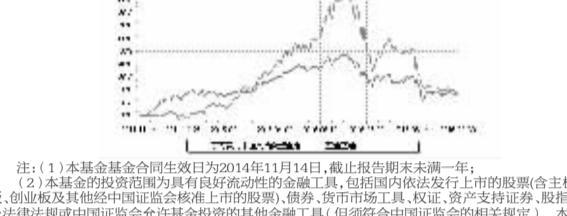
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长(%)	业绩比较基准(%)	业绩比较基准差(%)	①-③	②-④	
过去二个月	-31.90%	2.26%	-14.03%	1.67%	-12.22%	0.09%

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不计费用的情况。
(2)本基金的业绩基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债收益率×50%。

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



注:(1)本基金合同生效日为2014年11月14日,截至报告期末未满一年;
(2)本基金的净值增长率具有良好的流动性的金融工具,包括但不限于上市的股票(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(含国债、央行票据、政策性银行债券、企业债、短期融资券、公司债、可转债、可分离债、次级债等)、货币市场基金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 4 管理人报告

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期间 证券从业年限 说明

王庆红 副总经理,本公司基金经理 2014年11月14日 2015年8月6日 金融学博士,加拿大MCMASTER大学博士后,历任西班牙证券交易所有限责任公司股票投资部高级经理,东海基金管理有限公司股票投资部总监,东海基金管理有限公司股票投资部总监等。

杜斌 本基金的基金经理 2014年11月14日 - 16 经济学学士,中欧金融硕士,历任上海证券证券交易员,泰阳证券投资管理有限公司投资总监兼投资经理,东海基金管理有限公司股票投资部总监等。

投资目标

投资策略

业绩比较基准

风险收益特征

基金管理人

基金托管人

注:(1)本基金通过定期报告,定期披露资产配置情况,并及时关注在建项目中的主要进展,受经济结构转型经济形势影响的年报,加以对金融工具适度控制系统风险,以获得中长期稳定回报率较高的投资回报。

(2)本基金通过定期报告,定期披露资产配置情况,并及时关注在建项目中的主要进展,受经济结构转型经济形势影响的年报,加以对金融工具适度控制系统风险,以获得中长期稳定回报率较高的投资回报。

(3)本基金的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不计费用的情况。

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

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

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准差(%) ①-③ ②-④

阶段	净值增长(%)	业绩比较基准(%)	业绩比较基准差(%)	①-③	②-④	
过去二个月	-31.90%	2.26%	-14.03%	1.67%	-12.22%	0.09%

注:(1)本基金的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不计费用的情况。

(2)本基金的净值增长率具有良好的流动性的金融工具,包括但不限于上市的股票(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(含国债、央行票据、政策性银行债券、企业债、短期融资券、公司债、可转债、可分离债、次级债等)、货币市场基金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 31,691,132.14 67.40

2 固定收益投资 31,691,132.14 67.40

3 货币市场工具 - -

4 其他 - -

5 合计 47,322,691.64 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧、渔业 - -

B 采矿业 2,240,891.70 5.34

C 制造业 15,433,000.74 36.76

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 1,962,570.70 4.44

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 3,241,940.00 7.73

K 房地产业 2,953,444.00 6.54

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 12,164,670.00 28.97

O 道路运输、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 银行业 2,139,600.00 4.63

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000630 大秦铁路 2,240,891.70 5.34

2 600036 中国神华 335,500.00 0.74

3 000836 中国建筑 3,241,940.00 7.73

4 300077 东方雨虹 2,022,044.00 4.48

5 000908 东宝生物 1,962,570.70 4.44

6 000298 华东医药 2,040,000.00 4.48

7 000900 中国神华 14,000.00 0.03

8 000906 中国巨石 1,962,570.70 4.44

9 002733 国电南瑞 111,000.00 0.24

10 002692 通策医疗 99,000.00 0.21

5.4 报告期末按债券品种占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100001 国开债 160,000.00 17,067,200.00 39.34

2 010001 21国开债 160,000.00 17,067,200.00 39.34

3 010001 16农发债 40,000.00 4,196,113.16 8.99

4 010001 16农发债 30,000.00 3,636,000.00 7.67

5 010001 16农发债 20,000.00 2,369,600.00 5.07

6 010001 16农发债 10,000.00 1,139,200.00 2.41

7 010001 16农发债 10,000.00 1,139,200.00 2.41

8 010001 16农发债 10,000.00 1,139,200.00 2.41

9 010001 16农发债 10,000.00 1,139,200.00 2.41

10 010001 16农发债 10,000.00 1,139,200.00 2.41

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

序号 代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100001 金圆债 350 3,636,000.00 7.67

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(