东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海美丽中国灵活配置混合
基金主代码	000822
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	30,972,446.74份
投资目标	本基金通过在股票、固定收益类资产、现金等资产的积极灵活配置,重点关注在建设美丽中国的主旋律下,受益经济结构转型和经济品质改善的个股,辅以衍生金融工具适度对冲系统风险,以获得中长期稳定且超越比较基准的投资回报。
投资策略	中国经济增长正处在从数量扩张向质量改善转变的过程中,中央政府提出的美丽中国概念不光要点关注生态文明建设,更是融入了经济建设、政治建设、文化建设、社会建设各方面和全过程。围绕美丽中国的概念,中国经济结构转型和经济品质的改善会在很长时期贯穿中国经济增长的主线,由此带来一系列的投资机遇,而与美丽中国相关联的行业及企业将蕴含极高的投资价值。同时,本基金通过对宏观环境和市场风险特征的分析研究,不断优化组合资产配置,控制仓位和采用衍生品套期保值等策略,实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高预期收益的基金产品。
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

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-11,594,724.53
2.本期利润	-11,255,553.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3460
4.期末基金资产净值	30,533,609.34
5.期末基金份额净值	0.986

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。

3.2 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-27.02%	2.62%	-6.08%	1.21%	-20.94%	1.41%

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

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

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)本基金基金合同生效日为2014年11月14日;

(2)本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产净值的比例为0%-95%;权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%;任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(3)本基金的建仓期为本基金合同生效日起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜斌	本基的基金经理	2014年11月14日	-	19年	经济学学士,中级经济师。曾任泰阳证券湘证基金管理部经理助理,泰阳证券资产管理总部投资交易部经理,方正证券资产管理部债券型集合计划投资主办人等职,2013年2月加入东海基金任公司专户理财部投资经理。现任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的基金经理。
胡德军	本基的基金经理	2015年10月27日	-	6年	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。

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 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。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

受熔断机制和美国加息影响,本报告期内,A股整体呈现大幅波动特征,其中熔断机制的推出加剧了市场的恐慌,导致市场流动性的短期枯竭,而美国加息导致的资本外流在一定程度上影响国内的货币宽松预期;一季度下旬随着熔断暂停和美国加息预期暂缓,市场情绪有所好转;从国内经济看,得益于国家供给侧改革推进和稳增长相关措施的不断推出,一季度国内经济呈现逐渐探底回升态势,最新披露的3月份PMI数据低证了市场对经济短周期改善的预期,尽管这种改善的持续性还需要进一步观察。受益于政策托底,3月份PMI50.2%,较上个月回升1.2个百分点,主要分项指标全面回升,其中新订单和出口订单均回升至50以上,显示内外需改善。原材料购进指数回升至55.3,生产指数回升至52.3%。本报告期内,我们坚持建设美丽中国的投资主线,布局新能源产业、信息安全、先进制造及部分受益于国家经济刺激措施的行业,从这些行业中精选估值相对较低的个股积极布局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年1季度,本基金净值增长率为-27.02%,业绩基准增长率为-6.08%,低于业绩比较基准20.94%。自成立以来(2014年11月14日),本基金净值增长率为-1.4%,业绩基准增长率为19.03%,低于业绩比较基准20.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情况出现;本基金资产净值于2016年1月4日至2016年1月29日期间连续20个工作日低于6000万元,并于2016年2月1日恢复至5000万元以上。于2016年2月3日再次低于5000万元,截至报告期末,已持续37个交易日。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,世界经济可能持续低迷,国内外经济错综复杂,各国目前基准利率处于历史最低水平、资本过剩、债务高企,叠加日、欧、中、美等国的人口老龄化问题日益严重,都成为中期制约经济复苏的动能;同时各经济体货币政策将逐渐分化,其中美国经济复苏强劲,预计2016年二季度再次加息成大概率事件,而欧洲经济复苏不确定性较大,宽松的货币政策有望维持;2016年国内经济仍将处于结构调整期,需求持续萎靡,政策托底,虽然降息仍有空间,但相比2015年可操作性大幅降低,且降准可能更多是对冲美国加息导致的资金外流,对资本市场流动性将形成较大冲击。因此预计2016年国内资本市场将面临经济持续低迷和流动性相对2015年紧缩的新型特征,证券市场可能将受到业绩和估值的双重挤压;展望二季度,我们将遵循业绩稳健成长和低估值两条思路,在寻找成长性好的上市公司同时,注重各种宏观因素对市场估值造成的影响,整体采取谨慎的操作策略,控制风险。

§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	19,564,956.00	54.52
	其中:股票	19,564,956.00	54.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,115,231.77	44.91
8	其他资产	205,538.20	0.57
9	合计	35,885,725.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,253,729.72	40.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	890,240.00	2.92
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	3,668,715.00	12.02
J	金融业	987,900.00	3.24
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	946,323.28	3.10
R	文化、体育和娱乐业	818,048.00	2.68
S	综合	-	-
	合计	19,564,956.00	64.08

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002690	美亚光电	51,663	1,235,778.96	4.05
2	600030	中信证券	55,500	987,900.00	3.24
3	300182	捷成股份	54,500	986,450.00	3.23
4	300347	泰格医药	34,487	946,323.28	3.10
5	601028	玉龙股份	117,300	936,054.00	3.07
6	300296	利亚德	37,600	892,248.00	2.92
7	300059	东方财富	20,100	890,430.00	2.92
8	002589	瑞康医药	32,000	890,240.00	2.92
9	000568	泸州老窖	36,100	889,865.00	2.91
10	002460	赣锋锂业	17,200	881,328.00	2.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	177,601.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,301.57
5	应收申购款	24,634.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	205,538.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	31,371,434.70
报告期期间基金总申购份额	24,846,140.40
减:报告期期间基金总赎回份额	25,245,128.36
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	30,972,446.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,724,525.11
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,724,525.11
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.48

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、《东海美丽中国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

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
二〇一六年四月二十二日

东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期:2016年04月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海社会安全
基金主代码	001899
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月23日
报告期末基金份额总额	173,263,526.88份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金将采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当限制成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金经理可以对投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证社会发展安全产业主题指数收益率×95%+人民币税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的投资品种,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§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(2016年01月01日-2016年03月31日)
1.本期已实现收益	-15,962,633.29
2.本期利润	-45,399,539.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2370
4.期末基金资产净值	136,366,660.23
5.期末基金份额净值	0.787

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。

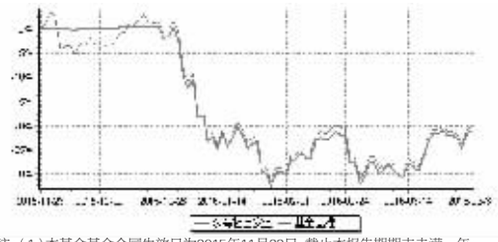
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-19.86%	3.33%	-20.30%	3.36%	0.44%	-0.03%

注:本基金业绩比较基准为:中证社会发展安全产业主题指数收益率×95%+人民币税后活期存款利率×5%。

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)本基金基金合同生效日为2015年11月23日,截止本报告期期末未满一年;

(2)本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证安全指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股票的资产比例不低于非现金基金资产的80%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(3)本基金的建仓期为本基金合同生效日起6个月,截止本报告期末,本基金尚处在建仓期。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜斌	本基金的基金经理	2015年11月23日	-	19年	经济学学士,中级经济师。曾任泰阳证券湘证基金管理部经理助理、泰阳证券资产管理总部投资交易部经理、方正证券资产管理部债券型集合计划投资主办人等职,2013年2月加入东海基金任公司专户理财部投资经理。现任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 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。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在报告期内,本基金管理人根据基金合同规定,采取了对指数的完全被动复制策略,将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内,本基金达到了基金合同配置比例的要求,因投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产比例不低于非现金基金资产的80%。

报告期内基金的跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于停牌或舍入取整等原因,申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人采取了适当的组合调整策略,尽可能地控制了基金的跟踪偏离度与跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年1季度,本基金净值增长率为-19.86%,业绩基准增长率-20.30%,高于业绩比较基准0.44%。自成立以来(2015年11月23日),本基金净值增长率为-21.30%,业绩基准增长率-21.55%,高于业绩比较基准0.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,我们认为由于管理层依然维持积极的财政政策,货币政策仍继续维持流动性宽松的积极取向,宏观经济数据有望逐步改善。同时目前股市整体估值相对较低,股市做多气氛可以得到上述因素的支撑,市场信心有望逐步恢复。A股市场二季度存在结构性机会,中小市值的成长股有交易性机会。

§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	129,846,880.41	94.86
	其中:股票	129,846,880.41	94.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,969,670.13	5.09
8	其他资产	70,160.91	0.05
9	合计	136,886,711.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,677,767.45	63.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,111,167.40	2.28
E	建筑业	1,754,181.00	1.29
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	15,845,104.96	11.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,662,018.41	1.95
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,711,209.89	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	16,594,744.30	12.17
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	490,687.00	0.36
	合计	129,846,880.41	95.22

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	377,089	11,621,882.98	8.52
2	002236	大华股份	211,754	7,631,614.16	5.60
3	600100	同方股份	515,000	6,597,150.00	4.84
4	300070	碧水源	121,600	4,741,184.00	3.48
5	002030	达安基因	153,811	4,554,343.71	3.34
6	002573	国电清新	180,900	4,059,396.00	2.98
7	300367	东方网力	124,805	3,810,296.65	2.79
8	000826	桑德环境	96,899	3,154,062.45	2.31
9	300203	聚光科技	110,500	2,895,100.00	2.12
10	002022	科华生物	138,393	2,752,636.77	2.02

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,428.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,732.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,160.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002573	国电清新	4,059,396.00	2.98	停牌或网下申购锁定期

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期期末持有积极投资股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	226,656,784.40
报告期期间基金总申购份额	1,277,333.79
减:报告期期间基金总赎回份额	54,670,591.31
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	173,263,526.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金设立的文件;

2、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金基金合同》;

3、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金招募说明书》;

4、《东海中证社会发展安全产业主题指数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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
二〇一六年四月二十二日

国金沪深300指数分级证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金沪深300
场内简称	国金300
交易代码	167601
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	2013年7月26日
报告期末基金份额总额	36,468,337.56份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的,力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如遇特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)致使基金无法顺利足够数量的股票时,基金管理人将对投资组合管理进行适