

东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 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：2019 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

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。本半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 2019 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

自 2018 年 6 月 22 日起，本基金的基金名称由“东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金”变更为“东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。本基金的封闭期自 2016 年 12 月 21 日起至 2018 年 6 月 21 日止，自 2018 年 6 月 22 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东海祥龙混合(LOF)
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	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同转型日	2018 年 6 月 22 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	316,916,051.74 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

注:根据本基金合同约定,本基金的封闭期自 2016 年 12 月 21 日起至 2018 年 6 月 21 日止,自 2018 年 6 月 22 日起,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。自 2018 年 6 月 22 日起,本基金的基金名称由“东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金”变更为“东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

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	(1) 类别资产配置策略 本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别,对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。本基金采用多因素分析框架,将综合考量宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策,来动态调整大类资产的配置比例。 (2) 股票投资策略 深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会,积极把握宏观经济和 market 发展趋势,精选具有估值优势的公司股票进行投资。 基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相结合的分析方法,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、

	竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。 本基金在进行个股筛选时，将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司：1）定性分析：通过分析上市公司所处行业、主营业务、同行业竞争水平、公司内部管理水平、盈利能力、资本负债结构、商誉等，评估上市公司的“内在价值”。2）定量分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备成长性，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等；ROE、ROIC、毛利率、净利率等；PE、PEG、PB、PS 等。 （3）股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。 （4）国债期货投资策略 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货提高投资组合的运作效率。 （5）债券投资策略 根据流动性管理、资产配置等需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略、久期策略等，由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。 （6）权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的高科技公司发行的权证。 （7）资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 （8）中小企业私募债券投资策略 中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级
--	--

	市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。
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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.donghaifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-51,512,492.03
本期利润	65,278,477.24
加权平均基金份额本期利润	0.1832
本期基金份额净值增长率	20.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2093
期末基金资产净值	312,403,505.51
期末基金份额净值	0.9858

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)本基金于 2018 年 6 月 22 日正式转型为东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

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
过去一个月	2.51%	1.21%	2.84%	0.59%	-0.33%	0.62%
过去三个月	1.43%	1.52%	-0.54%	0.76%	1.97%	0.76%
过去六个月	20.66%	1.27%	13.30%	0.77%	7.36%	0.50%
过去一年	11.14%	1.02%	6.61%	0.76%	4.53%	0.26%
自基金合同生效起至今	-1.42%	0.71%	10.12%	0.60%	-11.54%	0.11%

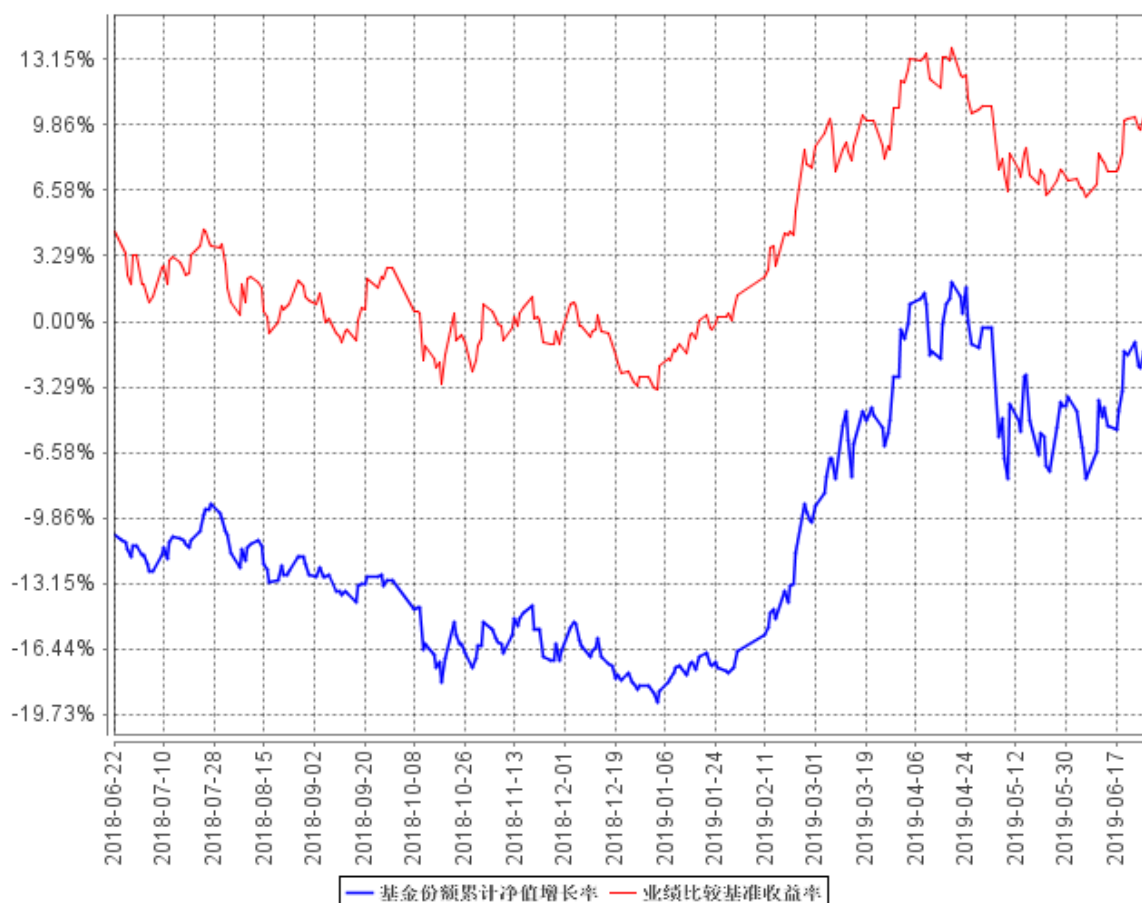
注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(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)本基金于 2018 年 6 月 22 日正式转型为东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

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） 本基金转型日期为 2018 年 6 月 22 日。

（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：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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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 70 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、东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东海核心价值精选混合型证券投资基金、东海祥利纯债债券型证券投资基金和东海科技动力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	—	10 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 9 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、东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金和东海核心价值精选混合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合规守信情况的说明

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，并定期分析组合间的同向交易。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

本报告期内，A 股呈现结构特征明显，其中蓝筹表现优异，而中小市值个股整体表现一般。回顾目前市场的投资机会，除了行业相关信息触发的短期交易交易机会外，投资机会整体跟随北上资金流量而发生变化。从近期各国经济表现看，全球经济表现不佳，因此部分国家央行纷纷降

息，美元指数也有所回落，新兴经济体权益市场表现有所恢复，北上资金也以持续净流入为主。本报告期内东海祥龙采取了相对稳健的中等仓位策略，主要配置方向为医药、新能源、农林牧渔以及白酒等消费类板块，从结果看，整体表现良好。

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 0.9858 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.66%，业绩比较基准收益率为 13.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，主要受全球经济增长动能弱化，以及中美经贸摩擦影响，我国出口或出现一定幅度的负增长。但伴随国内稳外贸政策加码，对出口企业支持力度加强，出口增速出现深跌的可能性不大。同时下半年宏观政策进一步转向稳增长，将对进口需求形成一定支撑，进口较快下降的局面会有所改观，整体来看下半年经济触底概率较大，根据过去库存周期和政策拐点推演，我们认为净利润累计同比低点或在 19Q3、ROE 低点 19Q4。从证券市场看，随着中美贸易摩擦缓和和国内刺激政策出台，市场有望进入新一轮上升周期。特别随着科创板的开闸，市场赚钱效应增强，成长性板块有望得到阶段性表现。

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行业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应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。

4.7 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》的约定，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 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的 20%；

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的管理人——东海基金管理有限责任公司在东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 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，东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	59,322,973.19	67,072,623.26
结算备付金		27,643.96	2,135,762.04
存出保证金		20,070,199.36	111,405.22
交易性金融资产	6.4.7.2	235,661,301.11	132,447,344.76
其中：股票投资		235,661,301.11	132,447,344.76
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	120,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,972.87	158,073.29
应收股利		-	-
应收申购款		1,182.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		315,098,272.75	321,925,208.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,666,645.53	86,311.19
应付管理人报酬		378,755.27	420,150.75
应付托管费		63,125.88	70,025.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	448,552.19	445,512.78
应交税费		18,675.26	12,162.78

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,013.11	180,000.00
负债合计		2,694,767.24	1,214,162.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	316,916,051.74	392,563,583.97
未分配利润	6.4.7.10	-4,512,546.23	-71,852,538.03
所有者权益合计		312,403,505.51	320,711,045.94
负债和所有者权益总计		315,098,272.75	321,925,208.57

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9858 元，基金份额总额 316,916,051.74 份。

6.2 利润表

会计主体：东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 22 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		68,809,059.76	-41,781,395.27
1.利息收入		564,093.72	8,059,801.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	370,270.09	600,716.91
债券利息收入		-	7,459,085.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		193,823.63	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,697,312.79	-28,277,720.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-49,883,394.53	-28,551,442.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	109,031.42
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,186,081.74	164,690.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	116,790,969.27	-21,563,476.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	151,309.56	-
减：二、费用		3,530,582.52	7,413,127.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,440,659.43	5,948,475.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	406,776.54	991,412.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	554,060.85	290,462.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		697.77	-
7. 其他费用	6.4.7.20	128,387.93	182,775.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65,278,477.24	-49,194,522.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65,278,477.24	-49,194,522.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	392,563,583.97	-71,852,538.03	320,711,045.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,278,477.24	65,278,477.24
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）	-75,647,532.23	2,061,514.56	-73,586,017.67
其中：1.基金申购款	12,664,783.87	-2,104,172.68	10,560,611.19
2.基金赎回款	-88,312,316.10	4,165,687.24	-84,146,628.86
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）	316,916,051.74	-4,512,546.23	312,403,505.51
项目	上年度可比期间 2018 年 6 月 22 日至 2018 年 6 月 30 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	-48,359,004.96	814,699,452.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-49,194,522.34	-49,194,522.34
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	-97,553,527.30	765,504,930.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名为“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”)，是根据《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，由东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金转型而来。东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金于 2016 年 12 月 21 日成立，根据《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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》的相关约定，东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金封闭期自 2016 年 12 月 21 日起至 2018 年 6 月 21 日止。

自 2018 年 6 月 22 日起，东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称变更为“东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”(以下简称“本基金”)，场外基金简称变更为“东海祥龙混合(LOF)”。场内基金简称及基金代码不变，场内基金简称为“东

海祥龙”，基金代码为 168301。本基金的基金管理人为东海基金管理有限责任公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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。

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%。

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资组合比例为：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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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 日以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。

(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。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注：本基金本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情

况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东海证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
苏州市相城区江南化纤集团有限公司	基金管理人的股东
深圳鹏博实业集团有限公司	基金管理人的股东
东海瑞京资产管理（上海）有限公司	基金管理人子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月22日至2018年6月30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	4,976,400.00	1.20%	43,195,618.00	23.04%

6.4.8.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	4,707.22	1.44%	34,639.64	7.72%
关联方名称	上年度可比期间 2018年6月22日至2018年6月30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	40,496.62	23.99%	28,543.40	16.91%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年6月22日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,440,659.43	5,948,475.93
其中：支付销售机构的客户维护费	116,097.04	242,720.10

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月22日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	406,776.54	991,412.66

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	1.5775%	4,999,450.00	1.2735%

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 6 月 22 日至 2018 年 6 月 30 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	59,322,973.19	361,165.07	596,246,056.67	600,716.91

行股份有限 公司				
-------------	--	--	--	--

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601236	红塔 证券	2019 年 6 月 28 日	2019 年 7 月 5 日	新股未 上市	3.46	3.46	1,000	3,460.00	3,460.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	235,661,301.11	74.79
	其中：股票	235,661,301.11	74.79
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	59,350,617.15	18.84
8	其他各项资产	20,086,354.49	6.37
9	合计	315,098,272.75	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,013,722.00	1.92
B	采矿业	—	—
C	制造业	136,320,887.61	43.64
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	5,501,600.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	13,594,561.70	4.35
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	35,762,101.00	11.45
K	房地产业	15,086,814.00	4.83
L	租赁和商务服务业	23,381,614.80	7.48
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	235,661,301.11	75.43

7.2.2 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。

7.3 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

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	601888	中国国旅	263,752	23,381,614.80	7.48
2	002157	正邦科技	1,293,265	21,545,794.90	6.90
3	000858	五 粮 液	150,200	17,716,090.00	5.67
4	000661	长春高新	41,173	13,916,474.00	4.45
5	002202	金风科技	1,110,984	13,809,531.12	4.42
6	601318	中国平安	154,300	13,672,523.00	4.38
7	600009	上海机场	162,265	13,594,561.70	4.35
8	600036	招商银行	354,100	12,740,518.00	4.08
9	600438	通威股份	794,534	11,171,148.04	3.58
10	600276	恒瑞医药	169,006	11,154,396.00	3.57

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000063	中兴通讯	20,500,347.00	6.39
2	002157	正邦科技	13,980,088.72	4.36
3	002202	金风科技	13,735,998.68	4.28
4	601318	中国平安	12,011,560.40	3.75
5	000858	五 粮 液	11,955,521.64	3.73
6	600030	中信证券	10,995,271.00	3.43
7	601012	隆基股份	10,500,871.74	3.27
8	600276	恒瑞医药	9,996,884.70	3.12

9	601628	中国人寿	9,495,010.00	2.96
10	000002	万科A	9,478,778.30	2.96
11	600438	通威股份	8,991,325.35	2.80
12	601288	农业银行	6,999,244.00	2.18
13	600031	三一重工	6,993,832.00	2.18
14	000333	美的集团	6,278,581.18	1.96
15	300498	温氏股份	6,153,966.88	1.92
16	000651	格力电器	6,116,584.00	1.91
17	600009	上海机场	6,114,192.06	1.91
18	600436	片仔癀	6,025,571.00	1.88
19	002007	华兰生物	5,564,294.00	1.73
20	603108	润达医疗	4,976,400.00	1.55

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	000885	城发环境	22,902,931.09	7.14
2	600063	皖维高新	20,568,308.59	6.41
3	000862	银星能源	18,430,982.38	5.75
4	002475	立讯精密	15,822,947.97	4.93
5	000063	中兴通讯	11,969,055.12	3.73
6	600566	济川药业	11,482,753.05	3.58
7	600030	中信证券	11,241,775.35	3.51
8	300195	长荣股份	9,964,654.65	3.11
9	601288	农业银行	7,368,548.00	2.30
10	600031	三一重工	7,031,664.00	2.19
11	002456	欧菲光	6,321,845.00	1.97
12	600436	片仔癀	6,244,719.00	1.95
13	000651	格力电器	6,205,295.65	1.93
14	002007	华兰生物	5,813,066.10	1.81
15	600346	恒力石化	4,999,836.28	1.56
16	002157	正邦科技	4,001,708.49	1.25
17	600887	伊利股份	3,833,183.00	1.20
18	002027	分众传媒	3,440,734.00	1.07
19	601155	新城控股	3,407,491.00	1.06

20	300316	晶盛机电	3,192,587.00	1.00
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.3 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	226,008,281.65
卖出股票收入（成交）总额	189,701,900.04

注：“买入股票成本”或“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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金可在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3 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	20,070,199.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,972.87
5	应收申购款	1,182.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,086,354.49

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,361	134,229.59	79,048,399.35	24.94%	237,867,652.39	75.06%

8.2 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	15.78%
2	鲁涛	24,801,960.00	7.83%
3	华夏人寿保险股份有限公司 -自有资金	17,817,427.26	5.62%
4	李文娣	12,037,477.42	3.80%
5	郭新民	10,002,333.00	3.16%
6	张孔沛	7,921,307.00	2.50%
7	王美英	6,000,000.00	1.89%
8	南京宝丰投资咨询有限公司	5,000,575.00	1.58%
9	陈洪发	5,000,097.00	1.58%
10	东海瑞京资产管理（上海） 有限公司	4,999,450.00	1.58%

8.3 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	65,319.48	0.0206%

8.4 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同转型日基金份额总额	863,058,457.47
本报告期期初基金份额总额	392,563,583.97
本报告期期间基金总申购份额	12,664,783.87
减:本报告期期间基金总赎回份额	88,312,316.10
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	316,916,051.74

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
德邦证券	2	109,080,655.65	26.35%	77,589.60	23.68%	-
东北证券	2	81,972,813.68	19.80%	74,701.74	22.80%	-

长江证券	1	75,716,556.68	18.29%	53,857.55	16.43%	-
华鑫证券	2	71,367,877.44	17.24%	66,464.96	20.28%	-
恒泰证券	2	70,838,565.56	17.11%	50,386.84	15.38%	-
东海证券	2	4,976,400.00	1.20%	4,707.22	1.44%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

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，经相关业务部门确认后，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。

10.7.2 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
德邦证券	-	-	220,000,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

东海基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 27 日