东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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
报告送出日期:2018年7月20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2018年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海社会安全
场内简称	-
交易代码	001899
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	2015年11月23日
报告期末基金份额总额	76,638,876.67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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	381,300.22
2.本期利润	-9,689,901.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.121
4.期末基金资产净值	52,115,195.89
5.期末基金份额净值	0.680

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。

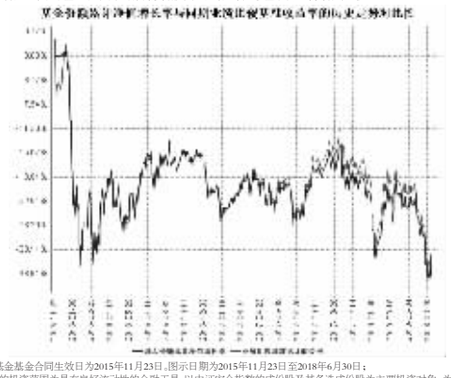
(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-15.21%	1.42%	-16.04%	1.45%	0.83%	-0.03%

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,图示日期为2015年11月23日至2018年6月30日;

(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票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%。

3.3 其他指标

§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		
胡德军	本基金的基金经理	2017年5月22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以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资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 报告期内基金投资策略和运作分析

从宏观看,在1-5月工业企业盈利能力较强和产业政策支持的共同影响下,制造业投资需求较为强劲。经济中周期支撑下,制造业投资增速有望持续回升,实体经济信贷需求较强,支撑信贷平稳增长。从流动看,存款类金融机构表外回表的需求进一步支撑表内信贷较强韧性。虽然资管新规延长了“新老划断”过渡期,但在金融监管和宏观审慎推进下,金融机构执行效率较高,导致表外融资渠道萎缩收缩,市场流动性不佳。本报告期内,东海中证社会发展安全基金在操作策略上采取了相对积极的策略,通过控制仓位和组合调整来提升收益,但受到流动性持续紧缩影响,A股市场整体表现不佳,本基金在二季度表现不佳。

4.5 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0.680元;本报告期基金份额净值增长率为-15.21%,业绩比较基准收益率为-16.04%。

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,本基金未有连续二十个交易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 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	49,994,086.13	94.24
	其中:股票	49,994,086.13	94.24
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	3,033,572.60	5.72
8	其他资产	24,065.94	0.05
9	合计	53,051,724.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	31,881,925.79	61.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,857,900.87	9.32
E	建筑业	473,360.22	0.91
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	6,080,767.93	11.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,950,381.43	3.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	711,951.24	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	3,762,217.58	7.22
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	275,581.07	0.53
	合计	49,994,086.13	95.93

5.2.2 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投资股票。

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	002415	海康威视	157,793	5,858,854.09	11.24
2	000540	中天金融	400,489	1,950,381.43	3.74
3	300203	聚光科技	67,976	1,740,185.60	3.34
4	002236	大华股份	74,963	1,690,415.65	3.24
5	000977	浪潮信息	66,169	1,578,130.65	3.03
6	002690	美亚光电	63,600	1,516,224.00	2.91
7	600584	长电科技	85,992	1,456,704.48	2.80
8	300137	先河环保	84,498	1,350,278.04	2.59
9	600498	烽火通信	54,300	1,349,355.00	2.59
10	300070	碧水源	78,115	1,088,141.95	2.09

5.4 报告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。

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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					0.00
国债期货投资本期收益(元)					0.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					0.00

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,465.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	619.76
5	应收申购款	15,980.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,065.94

5.11.2 报告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。

5.11.3 报告期末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	000540	中天金融	1,950,381.43	3.74	临时停牌

5.11.4 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	82,221,895.77
报告期期间基金总申购份额	356,590.83
减:报告期期间基金总赎回份额	5,939,609.93
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	76,638,876.67

§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

注:本报告期,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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: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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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7月20日

东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2018 第二季度 报告

2018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
报告送出日期:2018年7月20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2018年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海祥龙混合(LOF)
场内简称	东海祥龙
交易代码	168301
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2016年12月21日
报告期末基金份额总额	863,058,457.47份
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。
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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-24,384,297.48
2.本期利润	-38,582,189.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0447
4.期末基金资产净值	765,504,930.17
5.期末基金份额净值	0.8870

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	-4.80%	0.33%	-4.52%	0.57%	-0.28%	-0.24%

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2016年12月21日,图示日期为2016年12月21日至2018年6月30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: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%。

3.3 其他指标

§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		
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以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资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 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内本基金主要以持有现有可增项目和现金管理为主。本报告期内,东海祥龙持有的定增项目有银星能源、同力水泥、皖维高新和长荣股份,具体信息可参见东海基金官方公司网站或上市公告,其中银星能源和同力水泥2018年一季度解禁,长荣股份和皖维高新在二季度相继解禁,解禁后将根据合规要求择机卖出。二季度东海祥龙定增基金剩余资金主要以现金管理为主。

4.5 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0.8870元;本报告期基金份额净值增长率为-4.80%,业绩比较基准收益率为-4.52%。

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,本基金未有连续二十个交易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 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	170,683,844.76	22.25
	其中:股票	170,683,844.76	22.25
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	596,246,056.67	77.73
8	其他资产	148,616.46	0.02
9	合计	767,078,517.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	110,057,787.27	14.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,334,979.88	2.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	30,000,272.00	3.92
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	5,708,396.00	0.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,582,409.61	0.99
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	170,683,844.76	22.30

5.2.2 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投资股票。

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	000885	同力水泥	3,114,200	30,000,272.00	3.92
2	300195	长荣股份	2,551,386	28,068,378.19	3.67
3	600063	皖维高新	8,903,226	22,917,419.86	2.99
4	000862	银星能源	5,846,556	17,334,979.88	2.26
5	000651	格力电器	205,400	9,684,610.00	1.27
6	600566	济川药业	192,900	9,295,851.00	1.21
7	600519	贵州茅台	12,600	9,216,396.00	1.20
8	601888	中国国旅	117,721	7,582,409.61	0.99
9	002376	新北洋	446,548	7,385,903.92	0.96
10	002236	大华股份	311,906	7,033,480.30	0.92

5.4 报告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。

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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					0.00
国债期货投资本期收益(元)					0.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					0.00

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,087.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	124,529.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,616.46

5.11.2 报告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。

5.11.3 报告期末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	000885	同力水泥	30,000,272.00	3.92	非公开发行,流通受限
2	300195	长荣股份	28,068,378.19	3.67	非公开发行,流通受限
3	600063	皖维高新	22,917,419.86	2.99	非公开发行,流通受限
4	000862	银星能源	17,334,979.88	2.26	非公开发行,流通受限

5.11.4 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	863,058,457.47
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	863,058,457.47

§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

注:本报告期,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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: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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)设立的文件

2、《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

3、《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》

4、《东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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7月20日

东海祥瑞债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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
报告送出日期:2018年7月20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2018年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东海祥瑞基金	
场内简称	-	
交易代码	002381	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年3月24日	
报告期末基金份额总额	7,306,489.54份	
投资目标	在一定程度上有效控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。	
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	
下属分级基金的基金简称	东海祥瑞A级	东海祥瑞C级
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	002381	002382
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	2,340,114.39份	4,966,375.15份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)	
	东海祥瑞A级	东海祥瑞C级
1. 本期已实现收益	10,627.05	16,406.52
2. 本期利润	29,863.20	55,224.85
3. 加权平均基金份额本期利润	0.012	0.010
4. 期末基金资产净值	2,365,973.44	4,966,756.45
5. 期末基金份额净值	1.011	1.000

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

东海祥瑞A级

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