

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年三月三十日

§ 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 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。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	400015
前端交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 28 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	136,688,107.73 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资管理，精选受益于经济转型下产业结构调整方向的、具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票；努力把握市场趋势，积极进行适当范围内的大类资产配置调整，在严格控制风险的前提下，谋求本基金资产的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
业绩比较基准	本基金采用“中证 700 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%”作为投资业绩比较基准。
风险收益特征	本基金为混合型基金，股票部分主要投资于具有高成长潜力的中小市值上市公司股票，属于证券投资基金中预期风险和预期收益为中高风险等级的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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		东方基金管理有限责任公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田东辉
	联系电话	010-66295888	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tiantonghui@psbc.com

客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	95580
传真	010-66578700	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	7,541,685.67	-8,688,986.28	46,864,614.98
本期利润	7,800,839.83	-9,886,170.87	35,190,100.02
加权平均基金份额本期利润	0.0458	-0.7648	0.9349
本期基金份额净值增长率	-3.99%	-21.17%	45.30%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3932	0.9347	1.6719
期末基金资产净值	190,434,417.60	23,473,108.82	50,960,401.61
期末基金份额净值	1.3932	1.9347	2.4542

注：①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。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

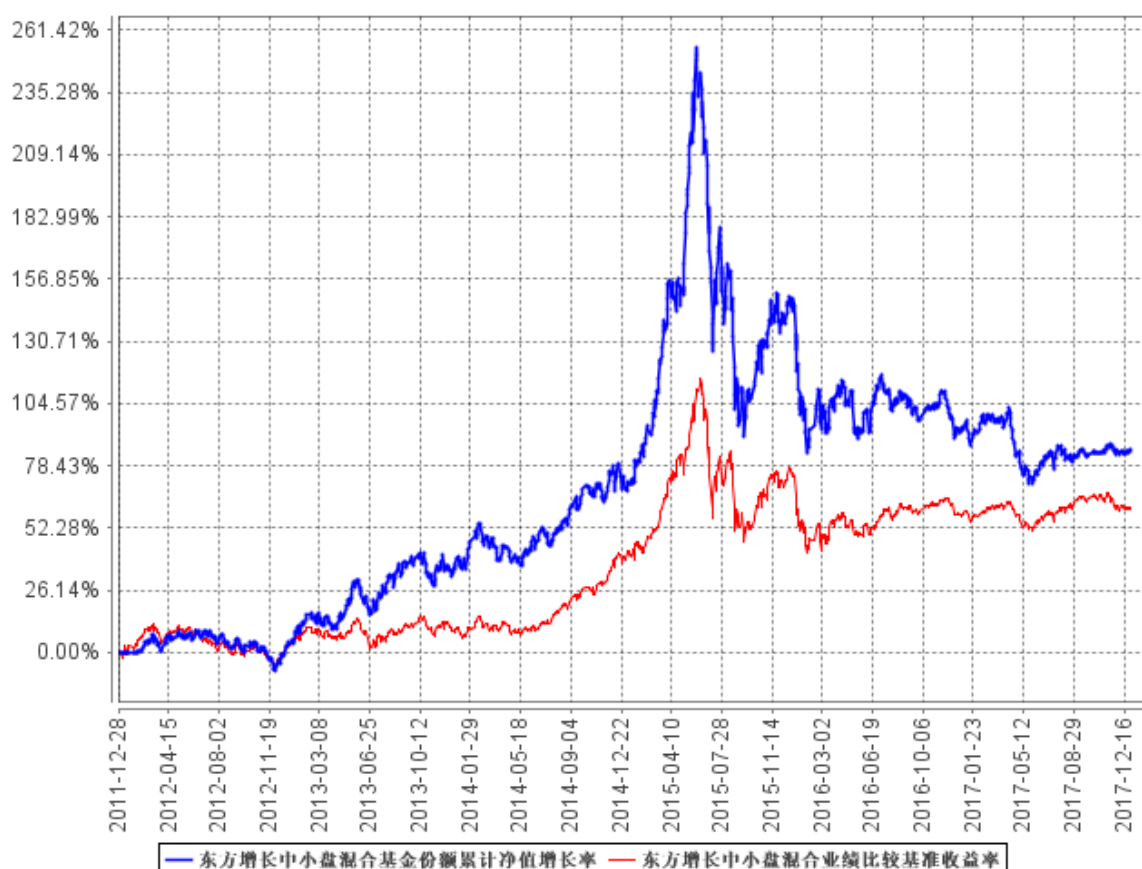
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	1.43%	0.38%	-2.12%	0.54%	3.55%	-0.16%
过去六个月	2.20%	0.61%	1.87%	0.52%	0.33%	0.09%
过去一年	-3.99%	0.75%	2.22%	0.50%	-6.21%	0.25%
过去三年	9.98%	1.67%	15.37%	1.19%	-5.39%	0.48%
过去五年	77.68%	1.49%	55.47%	1.05%	22.21%	0.44%
自基金合同 生效起至今	85.76%	1.40%	61.25%	1.02%	24.51%	0.38%

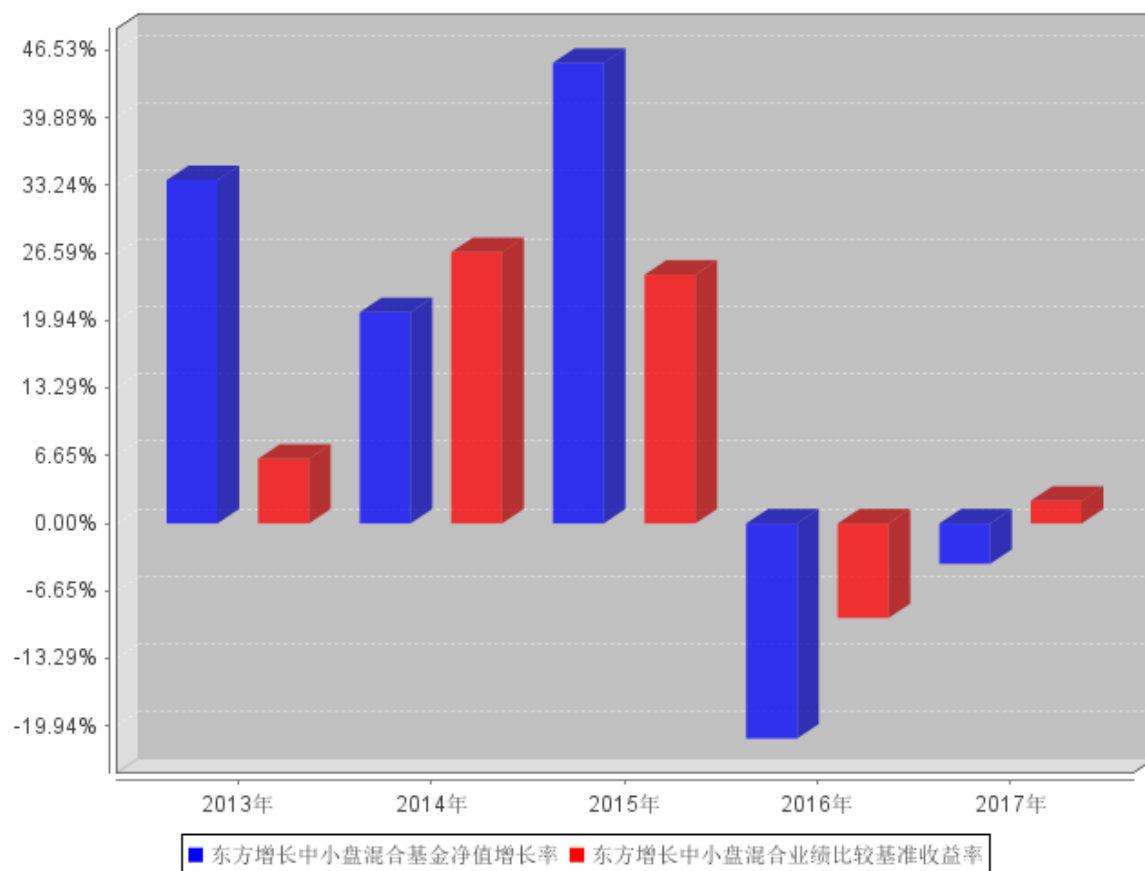
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方增长中小盘混合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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方增长中小盘混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	4.6000	1,431,625,127.56	1,502,921.52	1,433,128,049.08	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	4.6000	1,431,625,127.56	1,502,921.52	1,433,128,049.08	

§ 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

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2017年12月31日，本公司注

册资本 2 亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币 12800 万元，占公司注册资本的 64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币 5400 万元，占公司注册资本 27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币 1800 万元，占公司注册资本的 9%。截至 2017 年 12 月 31 日，本公司管理 44 只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方成长收益平衡混合型证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方臻悦纯债债券型证券投资基金。

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		
薛子微 (先生)	本基金基金经理	2015 年 4 月 30 日	-	10 年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士，10 年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中

				<p>信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员，投资经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理。现任东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方睿鑫</p>
--	--	--	--	--

					热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理。
李瑞（先生）	本基金基金经理	2017年12月15日	-	6年	中国人民大学金融学硕士，6年证券从业经历。2011年7月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理，现任东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011

年修订), 制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法, 各投资组合经理在授权范围内自主决策, 各投资组合共享研究平台, 在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度, 建立公平的交易分配制度, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易, 基金管理人执行交易系统内的公平交易程序; 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易, 各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量, 基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配; 对于银行间交易, 按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析, 投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定, 在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合, 未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度, 不同时间窗口(1日内、3日内、5日内)的同向交易样本, 在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下, 对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易, 不存在同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

2017年1季度, 经济数据如期回暖, 三四线地产销售持续超预期, 带动地产后周期如家电、

建材等板块出现上涨。同时，随着以茅台为代表的高端消费随经济出现复苏，食品饮料板块也出现了较大幅度上涨。总体看一季度经济不乏结构性亮点，一方面，PPI 连续数月处于扩张区间，增强了企业主动补库存意愿，而根据历史经验，企业补库存意愿提升后的 6 个月左右，中游制造业再投资有望启动；另一方面随着 16 年前两批入库的 PPP 项目落地，也对经济起到了支撑作用。基于此判断，我们加大了诸如基建、环保、机械等板块的配置比例。

2017 年 2 季度，经济数据持续回暖，尤其是地产开发商的补库存意愿高涨，带来地产开工、投资增速持续提升，显著超出了市场的一致预期。但由于市场对此的持续性始终持怀疑态度，导致地产上游产业链表现较差。而产业链下游更偏重于消费属性，受益确定性更强，如家电、家装、家居等板块均出现较好表现。而以茅台为代表的高端消费品价格仍然坚挺，食品饮料板块也出现了较大幅度上涨。我们判断地产投资启动将成为二、三季度经济的重要支撑，中游制造业再投资也将启动，多方共振，经济将呈现持续回暖态势。基于此判断，对于机械、环保、基建、银行以及偏重消费属性的医药等板块保持了较大幅度配置。

2017 年 3 季度，随着 7、8 月地产数据出现基数导致的波动，市场对于未来经济走势再次出现分歧，周期类板块呈现先扬后抑的走势。而消费板块受益于风险偏好回落，出现一波上涨行情。我们针对市场预期变化可能带来的波动积极应对，随股价上涨逐步兑现了周期板块的收益，降低配置比例，同时增加了消费、金融的配置比例，对于净值的增长起到了较好的保护。

2017 年 4 季度，市场表现延续了分化较大的特点。沪深 300 取得较大涨幅，创业板指下跌。市场风格方面整体呈现价值优于成长、低估值优于高估值、大市值龙头优于中小市值的风格。从行业来看，四季度涨幅最大的是食品饮料、家用电器和医药生物等消费板块以及大金融。跌幅较大的是有色金属、采掘、轻工等周期性行业以及纺织服装。4 季度我们以银行等金融板块、白酒和农林牧渔等消费板块作为底仓配置，净值取得了一定增长。临近年底，本基金进行了一定调仓，继续以金融作为底仓的基础上，增加了新能源新材料、高端制造等符合十九大政策方向和制造强国战略板块的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为-3.99%，业绩比较基准收益率为 2.22%，低于业绩比较基准 6.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年经济形势超预期，包含了多重因素的原因，地产销售、基建、出口、消费均表现出了

较好的增长。展望 2018 年，边际放缓是大概率事件，尤其是地产销售和基建都会比 2017 年减速，地产后周期对经济的支撑作用会消退，社零增速仍然会维持较快增速。综合来看，市场分歧点主要在于减速的幅度。政府也已经逐步淡化对经济增速的要求，经济增速下降容忍度提高，不再过度依赖社会融资规模大规模扩张的增长，取而代之的是追求高质量的经济增长。

从政策角度来看，目前货币、财政双紧，金融监管高压，也会给未来经济带来下行压力。尤其金融市场的高利率一定会通过金融机构转嫁到实体经济，贷款利率上浮比例已经出现了比较大幅的上升。

不过另一个趋势性的变化是中国经济周期性变弱，经济波动、通胀波动幅度都变小。所以，如果出现过度乐观或者过度悲观的市场反应，都意味着风险或机会。

此外，2018 年另一个关键词是转型。我国经济从 2011 年开始转型，尤其在 2016 年后，宏观开始淡化总量目标，更加注重结构调整。供给侧改革、金融防风险等政策助力经济加速转型，房地产和传统基建等传统增长动能对经济的拉动作用明显减弱。伴随顶层设计逐步完善，政策支持引导，先进制造、消费升级等“新经济”或将成为 2018 年经济重要发力点。

作为十九大后的第一年，中国经济正经历由大变强的转型过程，在价值龙头估值修复逻辑演绎之后，市场将更加关注成长龙头的业绩增长，市场风格也有望由价值龙头扩散到成长龙头。行业上，符合国家战略和政策方向的高端制造、新能源新材料等科技创新行业、金融消费等价值龙头都具备配置价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

（1）开展对公司各项业务的日常监管业务，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强了基金投资监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，

给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银

行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》的相关规定：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，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%，本年度基金管理人进行了一次收益分配，具体分配情况如下：

2017 年 10 月 18 日为收益分配基准日，基准日基金可供分配利润 22,192,164.13 元，实际分配金额 1,433,128,049.08 元，每 10 份基金份额分配现金红利 4.60 元，现金红利发放日 2017 年 10 月 31 日。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.10 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并将采取适当措施。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

基金托管人依据《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》与《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金托管协议》，自 2011 年 12 月 28 日起托管东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金已分配利润 1,433,128,049.08 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2018]第 ZB30037

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下简称东方增长中小盘基金）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方增长中小盘基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我

	<p>们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东方增长中小盘基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>其他信息</p>	<p>东方增长中小盘基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司(以下简称基金管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人负责评估东方增长中小盘基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方增长中小盘基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方增长中小盘基金不能持续经营。</p>

	(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	朱锦梅	赵立卿
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层	
审计报告日期	2018 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	13,170,609.23	2,397,608.62
结算备付金	716,704.97	99,957.51
存出保证金	189,957.49	55,987.25
交易性金融资产	269,146,537.61	20,279,716.25
其中：股票投资	118,601,115.81	15,230,356.25
基金投资	-	-
债券投资	150,545,421.80	5,049,360.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	158,412,702.23	-
应收证券清算款	49,998,712.12	1,704,868.84
应收利息	2,689,372.72	97,735.88
应收股利	-	-
应收申购款	34,310.12	4,922.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	494,358,906.49	24,640,796.83
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	300,141,661.63	8,716.07
应付管理人报酬	722,742.20	29,827.94
应付托管费	120,457.01	4,971.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,593,996.85	959,397.93
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,345,631.20	164,774.75
负债合计	303,924,488.89	1,167,688.01
所有者权益：		
实收基金	136,688,107.73	12,132,745.77
未分配利润	53,746,309.87	11,340,363.05
所有者权益合计	190,434,417.60	23,473,108.82
负债和所有者权益总计	494,358,906.49	24,640,796.83

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3932 元，基金份额总额 136,688,107.73 份。

7.2 利润表

会计主体：东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	13,892,894.52	-8,740,385.07
1. 利息收入	4,896,207.13	214,178.56
其中：存款利息收入	652,132.70	22,556.36
债券利息收入	1,533,167.53	191,622.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,710,906.90	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,577,167.76	-7,787,439.72

其中：股票投资收益	3,693,313.46	-7,840,747.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-251,219.60	-28,786.34
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	135,073.90	82,093.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	259,154.16	-1,197,184.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,160,365.47	30,060.68
减：二、费用	6,092,054.69	1,145,785.80
1. 管理人报酬	3,861,342.62	395,546.84
2. 托管费	643,557.17	65,924.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,449,754.90	546,714.54
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	137,400.00	137,600.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,800,839.83	-9,886,170.87
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,800,839.83	-9,886,170.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	12,132,745.77	11,340,363.05	23,473,108.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	7,800,839.83	7,800,839.83
三、本期基金份额交易产	124,555,361.96	1,467,733,156.07	1,592,288,518.03

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	3, 113, 460, 023. 69	2, 610, 994, 672. 05	5, 724, 454, 695. 74
2. 基金赎回款	-2, 988, 904, 661. 73	-1, 143, 261, 515. 98	-4, 132, 166, 177. 71
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)	-	-1, 433, 128, 049. 08	-1, 433, 128, 049. 08
五、期末所有者权益(基金净值)	136, 688, 107. 73	53, 746, 309. 87	190, 434, 417. 60
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	20, 764, 754. 13	30, 195, 647. 48	50, 960, 401. 61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-9, 886, 170. 87	-9, 886, 170. 87
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)	-8, 632, 008. 36	-8, 969, 113. 56	-17, 601, 121. 92
其中: 1. 基金申购款	5, 003, 279. 62	5, 098, 826. 19	10, 102, 105. 81
2. 基金赎回款	-13, 635, 287. 98	-14, 067, 939. 75	-27, 703, 227. 73
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)	12, 132, 745. 77	11, 340, 363. 05	23, 473, 108. 82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>肖向辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)根据 2011 年 10 月 20 日

中国证监会《关于核准东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1687号）和《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2011]860号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》自2011年11月21日至2011年12月23日公开募集设立。本基金为混合型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集335,816,080.11元人民币，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）“信会师报字（2011）第82483号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》于2011年12月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为335,865,199.76份基金单位，其中认购资金利息折合49,119.65份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于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（包括中小板、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）。其中，股票主要包括基本面良好、具有较高成长性的中小盘股票；债券主要包括具有相对投资价值的国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、短期融资券与可转换债券等固定收益品种。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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XBRL模板第3号—年度报告和半年度报告》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《财政部、国家税务总局关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，存款利息收入不征收增值税。

根据规定，基金产品运营过程中发生的增值税应税行为，以基金产品管理人为增值税纳税人。

2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、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。

5、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、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,861,342.62	395,546.84
其中：支付销售机构的客户维护费	569,619.34	151,008.46

注：①本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

②基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	643,557.17	65,924.42

注：①在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.25\%$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

②基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	11,271,108.18	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	11,271,108.18	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.25%	-

注：根据东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书中对申购费用的规定，申购金额大于或等于 500 万元的，申购费用为 1000 元/笔。由于本基金投资交易方式由其他基金转换入，转换补差费为 0 元。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国邮政储蓄 银行股份有限 公司	13,170,609.23	558,610.91	2,397,608.62	17,879.62
------------------------	---------------	------------	--------------	-----------

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
603080	新疆火炬	2017年12月27日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	48,200	782,146.00	761,078.00	-
600686	金龙汽车	2017年12月28日	重大事项	13.03	2018年1月10日	13.03	51,900	661,413.00	676,257.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	临时停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	临时停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本年度报告报出日, 本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	118,601,115.81	23.99
	其中: 股票	118,601,115.81	23.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,545,421.80	30.45
	其中: 债券	150,545,421.80	30.45
	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	158,412,702.23	32.04
	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	13,887,314.20	2.81
8	其他各项资产	52,912,352.45	10.70
9	合计	494,358,906.49	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,673,563.00	1.93
C	制造业	100,733,521.86	52.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	989,600.00	0.52
F	批发和零售业	945,522.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,674,342.76	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,842,750.55	1.49
J	金融业	6,852,225.44	3.60
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	873,447.00	0.46
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	118,601,115.81	62.28

8.3 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	002594	比亚迪	71,300	4,638,065.00	2.44

2	601288	农业银行	1,037,200	3,972,476.00	2.09
3	600066	宇通客车	133,800	3,220,566.00	1.69
4	603799	华友钴业	37,600	3,016,648.00	1.58
5	002179	中航光电	68,600	2,701,468.00	1.42
6	002709	天赐材料	57,400	2,639,826.00	1.39
7	600884	杉杉股份	114,700	2,222,886.00	1.17
8	600885	宏发股份	51,400	2,126,418.00	1.12
9	002460	赣锋锂业	28,937	2,076,229.75	1.09
10	603993	洛阳钼业	274,600	1,889,248.00	0.99

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601939	建设银行	21,337,958.45	90.90
2	600809	山西汾酒	16,488,412.40	70.24
3	600702	舍得酒业	16,048,656.06	68.37
4	000858	五粮液	15,971,494.10	68.04
5	603993	洛阳钼业	15,046,365.23	64.10
6	600887	伊利股份	14,973,007.40	63.79
7	000568	泸州老窖	14,700,669.10	62.63
8	000002	万科A	13,730,563.00	58.49
9	002714	牧原股份	13,388,958.00	57.04
10	000797	中国武夷	12,948,387.00	55.16
11	600507	方大特钢	12,815,263.72	54.60
12	002142	宁波银行	12,749,943.56	54.32
13	600383	金地集团	11,808,798.24	50.31
14	002385	大北农	10,528,392.00	44.85
15	000898	鞍钢股份	9,790,974.00	41.71
16	603799	华友钴业	9,712,744.27	41.38
17	002709	天赐材料	9,690,647.00	41.28
18	600782	新钢股份	9,096,658.00	38.75
19	600362	江西铜业	8,464,181.00	36.06

20	300055	万邦达	8,181,681.00	34.86
21	000825	太钢不锈	7,549,592.00	32.16
22	600872	中炬高新	7,268,380.22	30.96
23	002594	比亚迪	6,822,113.34	29.06
24	002157	正邦科技	6,456,501.00	27.51
25	000878	云南铜业	6,295,574.00	26.82
26	300409	道氏技术	5,907,980.00	25.17
27	002128	露天煤业	5,867,885.00	25.00
28	600516	方大炭素	5,699,855.00	24.28
29	300498	温氏股份	5,147,645.00	21.93
30	000983	西山煤电	5,071,196.00	21.60
31	000759	中百集团	4,775,887.00	20.35
32	600066	宇通客车	4,688,073.55	19.97
33	600779	水井坊	4,434,198.00	18.89
34	600808	马钢股份	4,280,000.00	18.23
35	002518	科士达	4,121,383.40	17.56
36	002460	赣锋锂业	4,056,383.60	17.28
37	002285	世联行	3,942,920.14	16.80
38	600219	南山铝业	3,940,000.00	16.79
39	601288	农业银行	3,910,616.00	16.66
40	002179	中航光电	3,874,729.48	16.51
41	600885	宏发股份	3,865,495.37	16.47
42	002440	闰土股份	3,613,443.00	15.39
43	600884	杉杉股份	3,258,008.28	13.88
44	000408	藏格控股	2,903,564.31	12.37
45	601933	永辉超市	2,823,343.00	12.03
46	300124	汇川技术	2,659,778.91	11.33
47	002340	格林美	2,627,437.00	11.19
48	600197	伊力特	2,623,724.00	11.18
49	002245	澳洋顺昌	2,553,001.00	10.88
50	002466	天齐锂业	2,460,469.00	10.48
51	600967	内蒙一机	2,383,307.62	10.15
52	000630	铜陵有色	2,320,000.00	9.88
53	600104	上汽集团	2,091,610.00	8.91
54	300037	新宙邦	2,076,937.00	8.85
55	300014	亿纬锂能	2,044,425.00	8.71

56	002176	江特电机	2,010,800.06	8.57
57	600549	厦门钨业	2,006,370.00	8.55
58	002091	江苏国泰	1,983,312.60	8.45
59	000839	中信国安	1,976,554.00	8.42
60	600418	江淮汽车	1,960,450.00	8.35
61	002074	国轩高科	1,958,109.30	8.34
62	002411	必康股份	1,950,891.14	8.31
63	603868	飞科电器	1,558,544.00	6.64
64	000400	许继电气	1,537,963.00	6.55
65	601881	中国银河	1,455,100.00	6.20
66	300207	欣旺达	1,392,858.00	5.93
67	002373	千方科技	1,359,485.00	5.79
68	600006	东风汽车	1,356,754.00	5.78
69	600036	招商银行	1,344,998.85	5.73
70	300477	合纵科技	1,340,389.98	5.71
71	002407	多氟多	1,339,330.00	5.71
72	002249	大洋电机	1,334,200.00	5.68
73	000559	万向钱潮	1,333,085.60	5.68
74	601127	小康股份	1,330,238.00	5.67
75	000970	中科三环	1,327,582.00	5.66
76	600580	卧龙电气	1,326,149.00	5.65
77	002126	银轮股份	1,318,068.00	5.62
78	300450	先导智能	1,316,320.90	5.61
79	300398	飞凯材料	1,313,886.00	5.60
80	600563	法拉电子	1,311,974.12	5.59
81	600166	福田汽车	1,311,848.00	5.59
82	300340	科恒股份	1,311,711.34	5.59
83	002056	横店东磁	1,311,043.00	5.59
84	600028	中国石化	1,310,595.00	5.58
85	002454	松芝股份	1,308,003.55	5.57
86	002239	奥特佳	1,306,842.40	5.57
87	002426	胜利精密	1,305,540.00	5.56
88	603416	信捷电气	1,304,713.20	5.56
89	300618	寒锐钴业	1,304,521.00	5.56
90	300438	鹏辉能源	1,302,678.00	5.55
91	300432	富临精工	1,302,410.00	5.55

92	600217	中再资环	1,301,107.00	5.54
93	600970	中材国际	1,300,846.09	5.54
94	300558	贝达药业	1,299,805.08	5.54
95	300376	易事特	1,297,111.00	5.53
96	300088	长信科技	1,295,329.33	5.52
97	002427	ST 尤夫	1,294,573.20	5.52
98	603818	曲美家居	1,294,566.00	5.52
99	600030	中信证券	1,292,564.00	5.51
100	002611	东方精工	1,292,547.17	5.51
101	000888	峨眉山 A	1,291,744.44	5.50
102	000786	北新建材	1,291,615.00	5.50
103	002797	第一创业	1,291,333.80	5.50
104	002418	康盛股份	1,285,645.00	5.48
105	600741	华域汽车	1,281,917.22	5.46
106	002812	创新股份	1,278,689.00	5.45
107	002050	三花智控	1,278,454.00	5.45
108	300316	晶盛机电	1,277,608.00	5.44
109	300068	南都电源	1,274,578.00	5.43
110	002341	新纶科技	1,269,122.00	5.41
111	002595	豪迈科技	1,267,448.00	5.40
112	002673	西部证券	1,262,265.90	5.38
113	603197	保隆科技	1,261,912.00	5.38
114	002080	中材科技	1,249,352.00	5.32
115	601369	陕鼓动力	1,160,184.00	4.94
116	601318	中国平安	1,159,400.00	4.94
117	000848	承德露露	1,074,604.00	4.58
118	300152	科融环境	1,010,271.00	4.30
119	600201	生物股份	938,272.80	4.00
120	600038	中直股份	929,386.00	3.96
121	000157	中联重科	917,500.00	3.91
122	000425	徐工机械	878,000.00	3.74
123	000333	美的集团	877,007.92	3.74
124	600388	龙净环保	873,454.00	3.72
125	600169	太原重工	836,000.00	3.56
126	002851	麦格米特	804,885.00	3.43
127	002430	杭氧股份	799,200.00	3.40

128	600525	长园集团	782,146.00	3.33
129	600031	三一重工	775,452.00	3.30
130	000807	云铝股份	764,987.00	3.26
131	603338	浙江鼎力	763,416.00	3.25
132	300224	正海磁材	757,396.00	3.23
133	600262	北方股份	732,330.00	3.12
134	000680	山推股份	725,779.00	3.09
135	002766	索菱股份	707,834.00	3.02
136	300103	达刚路机	699,671.00	2.98
137	300307	慈星股份	697,800.00	2.97
138	600685	中船防务	694,282.00	2.96
139	000768	中航飞机	693,680.00	2.96
140	600435	北方导航	692,726.00	2.95
141	000762	西藏矿业	690,483.00	2.94
142	002765	蓝黛传动	690,366.00	2.94
143	000792	盐湖股份	686,642.00	2.93
144	600499	科达洁能	682,420.00	2.91
145	601222	林洋能源	678,558.00	2.89
146	002353	杰瑞股份	676,500.00	2.88
147	000887	中鼎股份	674,061.00	2.87
148	002497	雅化集团	673,295.00	2.87
149	603969	银龙股份	671,400.00	2.86
150	600871	石化油服	669,800.00	2.85
151	300141	和顺电气	669,108.00	2.85
152	300073	当升科技	668,512.00	2.85
153	002389	南洋科技	666,532.00	2.84
154	300568	星源材质	663,064.00	2.82
155	000852	石化机械	662,367.00	2.82
156	002190	成飞集成	662,150.00	2.82
157	000733	振华科技	661,500.00	2.82
158	600686	金龙汽车	661,413.00	2.82
159	300001	特锐德	660,464.00	2.81
160	000980	众泰汽车	659,632.00	2.81
161	600815	*ST 厦工	659,600.00	2.81
162	600562	国睿科技	659,449.56	2.81
163	600366	宁波韵升	658,872.00	2.81

164	600835	上海机电	658,348.00	2.80
165	002405	四维图新	655,206.00	2.79
166	300274	阳光电源	650,844.00	2.77
167	300159	新研股份	649,350.00	2.77
168	600114	东睦股份	649,163.00	2.77
169	603633	徕木股份	648,962.00	2.76
170	600761	安徽合力	648,500.00	2.76
171	600705	中航资本	648,396.00	2.76
172	600585	海螺水泥	641,135.22	2.73
173	300455	康拓红外	640,231.00	2.73
174	600875	东方电气	634,200.00	2.70
175	600855	航天长峰	634,013.00	2.70
176	300097	智云股份	626,264.40	2.67
177	600297	广汇汽车	619,500.00	2.64
178	000039	中集集团	619,203.00	2.64
179	000951	中国重汽	617,306.00	2.63
180	600089	特变电工	615,200.00	2.62
181	600501	航天晨光	612,981.00	2.61
182	300395	菲利华	600,163.74	2.56
183	600879	航天电子	595,700.00	2.54
184	603111	康尼机电	571,951.00	2.44
185	300510	金冠电气	559,697.00	2.38
186	300470	日机密封	549,714.00	2.34
187	603066	音飞储存	538,477.60	2.29
188	002120	韵达股份	525,999.00	2.24
189	600406	国电南瑞	525,000.00	2.24
190	002757	南兴装备	515,287.00	2.20
191	300385	雪浪环境	500,782.00	2.13
192	600150	中国船舶	496,598.00	2.12
193	002531	天顺风能	485,632.00	2.07

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”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。

8.4.2 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	601939	建设银行	20,988,839.30	89.42
2	600702	舍得酒业	18,699,083.00	79.66
3	000858	五粮液	17,512,363.50	74.61
4	600809	山西汾酒	15,850,143.83	67.52
5	002714	牧原股份	15,838,516.42	67.48
6	000568	泸州老窖	15,395,852.86	65.59
7	600887	伊利股份	14,683,122.00	62.55
8	000002	万科A	14,386,439.46	61.29
9	600507	方大特钢	13,955,299.53	59.45
10	603993	洛阳钼业	13,287,929.00	56.61
11	000797	中国武夷	12,881,919.20	54.88
12	002142	宁波银行	12,691,937.70	54.07
13	600383	金地集团	11,478,826.98	48.90
14	002385	大北农	9,573,700.00	40.79
15	600782	新钢股份	9,430,391.31	40.18
16	000898	鞍钢股份	9,184,242.00	39.13
17	300055	万邦达	8,844,870.00	37.68
18	600362	江西铜业	8,785,216.00	37.43
19	002709	天赐材料	7,335,885.00	31.25
20	600872	中炬高新	7,290,709.80	31.06
21	000825	太钢不锈	7,269,201.17	30.97
22	000878	云南铜业	6,412,186.00	27.32
23	603799	华友钴业	6,265,409.97	26.69
24	002157	正邦科技	5,571,198.91	23.73
25	002128	露天煤业	5,561,583.99	23.69
26	600516	方大炭素	5,182,338.00	22.08
27	300498	温氏股份	4,691,312.00	19.99
28	000983	西山煤电	4,571,282.00	19.47
29	300409	道氏技术	4,547,367.00	19.37
30	000759	中百集团	4,215,937.00	17.96
31	600779	水井坊	4,194,717.00	17.87
32	600808	马钢股份	4,078,501.00	17.38
33	600219	南山铝业	3,762,107.00	16.03
34	002440	闰土股份	3,714,463.00	15.82
35	002285	世联行	3,603,359.42	15.35
36	601933	永辉超市	2,754,038.00	11.73

37	000408	藏格控股	2,367,581.00	10.09
38	002518	科士达	2,345,814.50	9.99
39	002594	比亚迪	2,178,907.00	9.28
40	002460	赣锋锂业	2,012,880.00	8.58
41	600967	内蒙一机	1,857,000.00	7.91
42	600885	宏发股份	1,668,111.00	7.11
43	600104	上汽集团	1,618,842.00	6.90
44	600031	三一重工	1,616,000.00	6.88
45	002074	国轩高科	1,590,633.00	6.78
46	600066	宇通客车	1,516,669.00	6.46
47	000400	许继电气	1,451,097.48	6.18
48	603868	飞科电器	1,403,461.00	5.98
49	600036	招商银行	1,345,909.76	5.73
50	601318	中国平安	1,297,420.00	5.53
51	002595	豪迈科技	1,288,334.83	5.49
52	601881	中国银河	1,283,073.00	5.47
53	002179	中航光电	1,270,493.00	5.41
54	000528	柳工	1,187,369.00	5.06
55	603969	银龙股份	1,125,595.00	4.80
56	300401	花园生物	1,125,296.00	4.79
57	002797	第一创业	1,115,000.00	4.75
58	002673	西部证券	1,113,796.00	4.74
59	000711	京蓝科技	1,104,928.00	4.71
60	601100	恒立液压	1,100,216.52	4.69
61	603111	康尼机电	1,092,748.00	4.66
62	002091	江苏国泰	1,086,055.32	4.63
63	601689	拓普集团	1,078,816.39	4.60
64	601369	陕鼓动力	1,045,754.00	4.46
65	600884	杉杉股份	1,044,421.00	4.45
66	002202	金风科技	994,809.00	4.24
67	300152	科融环境	977,848.00	4.17
68	002430	杭氧股份	961,146.00	4.09
69	603338	浙江鼎力	946,982.00	4.03
70	000848	承德露露	944,627.94	4.02
71	000425	徐工机械	927,500.00	3.95
72	000157	中联重科	914,000.00	3.89
73	000333	美的集团	873,554.26	3.72
74	600038	中直股份	868,420.00	3.70

75	300124	汇川技术	867,355.00	3.70
76	002340	格林美	855,856.00	3.65
77	300432	富临精工	839,080.00	3.57
78	600197	伊力特	825,069.00	3.51
79	002245	澳洋顺昌	774,764.00	3.30
80	600169	太原重工	773,172.00	3.29
81	000630	铜陵有色	750,080.00	3.20
82	002466	天齐锂业	738,760.00	3.15
83	000768	中航飞机	717,600.00	3.06
84	600685	中船防务	693,573.00	2.95
85	300129	泰胜风能	690,368.20	2.94
86	000807	云铝股份	687,747.00	2.93
87	300037	新宙邦	687,560.00	2.93
88	601989	中国重工	679,500.00	2.89
89	000839	中信国安	677,682.00	2.89
90	601222	林洋能源	670,765.00	2.86
91	600549	厦门钨业	669,684.00	2.85
92	000039	中集集团	668,318.46	2.85
93	600871	石化油服	666,400.00	2.84
94	300014	亿纬锂能	666,144.00	2.84
95	600761	安徽合力	654,373.00	2.79
96	002176	江特电机	644,838.00	2.75
97	300395	菲利华	642,000.00	2.74
98	600297	广汇汽车	639,989.00	2.73
99	600562	国睿科技	632,212.00	2.69
100	002411	必康股份	629,535.00	2.68
101	002765	蓝黛传动	629,049.00	2.68
102	600418	江淮汽车	624,274.00	2.66
103	600875	东方电气	622,423.00	2.65
104	300444	双杰电气	621,835.00	2.65
105	600835	上海机电	619,153.00	2.64
106	000951	中国重汽	606,500.00	2.58
107	000852	石化机械	606,109.40	2.58
108	000733	振华科技	605,423.00	2.58
109	300307	慈星股份	600,000.00	2.56
110	600855	航天长峰	594,434.00	2.53
111	300159	新研股份	594,000.00	2.53
112	600089	特变电工	594,000.00	2.53

113	600879	航天电子	590,509.00	2.52
114	002578	闽发铝业	589,354.00	2.51
115	600435	北方导航	584,945.00	2.49
116	603678	火炬电子	582,460.00	2.48
117	300470	日机密封	579,933.00	2.47
118	600213	亚星客车	574,950.00	2.45
119	000680	山推股份	571,273.96	2.43
120	300103	达刚路机	570,853.00	2.43
121	600501	航天晨光	558,734.00	2.38
122	600262	北方股份	556,503.00	2.37
123	300440	运达科技	553,077.01	2.36
124	002757	南兴装备	533,402.00	2.27
125	600150	中国船舶	522,502.00	2.23
126	002353	杰瑞股份	514,597.00	2.19
127	300455	康拓红外	513,171.00	2.19
128	600406	国电南瑞	504,226.00	2.15
129	002120	韵达股份	485,900.00	2.07
130	300034	钢研高纳	481,800.00	2.05
131	603066	音飞储存	472,358.92	2.01

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”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。

8.4.3 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	545,917,076.15
卖出股票收入（成交）总额	446,951,732.41

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	8,551,660.00	4.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	139,368,000.00	73.18
	其中：政策性金融债	139,368,000.00	73.18
4	企业债券	1,243,000.00	0.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,382,761.80	0.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	150,545,421.80	79.05

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	170410	17 农发 10	600,000	59,682,000.00	31.34
2	170308	17 进出 08	500,000	49,830,000.00	26.17
3	170207	17 国开 07	300,000	29,856,000.00	15.68
4	019563	17 国债 09	50,000	4,992,500.00	2.62
5	019557	17 国债 03	26,000	2,596,360.00	1.36

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资的华友钴业、杉杉股份、赣锋锂业存在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、处罚的情况：

本基金所持有的浙江华友钴业股份有限公司 2017 年 4 月 15 日公告，近日查询到公司高级管理人员王云先生的证券账户存在违规买卖公司股票情况，将有关事项披露如下：

1、本次买卖公司股票的基本情况

自王云先生于 2017 年 1 月 9 日被聘任为公司高级管理人员至今，其证券账户共计发生 9 笔交易，期间累计买入公司股票 800 股，成交均价 44.37 元/股，成交金额 35,495 元；累计卖出公司股票 700 股，成交均价 48.45 元/股，成交金额 33,912 元。截至目前，王云先生尚持有公司股票 100 股。

上述交易系在王云先生本人不知悉的情况下由其亲属操作。以上交易的发生主要由于王云先生为公司新任高级管理人员，其本人及其亲属均未及时学习相关法律法规及规范运作指引。

上述行为，王云先生作为公司高级管理人员，未能尽到交易报备责任，且违反了《证券法》

第四十七条的规定，构成了短线交易。经公司自查，王云先生的上述交易行为未发生在公司披露定期报告的敏感期内，亦不存在因获悉内幕信息而交易公司股票的情况。

2、本事项的处理情况

1) 公司对王云先生进行了严肃批评教育，要求其认真学习《上海证券交易所股

票上市规则》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等相关法律法规和规范性文件，并要求其严格执行；

2) 王云先生本人对本次违规买卖公司股票行为进行了深刻反省，并承诺约束其家属股票交易行为，避免此类事件再次发生；

3) 公司董事会将依法收回王云先生本次交易差价金额所得。王云先生所得收益为：(卖出均价 48.45 元/股-买入均价 44.37 元/股)×700 股=2,856 元；剩余持有公司股票 100 股将在按规定卖出后，所得收益归公司所有。

王云先生对发生此次违规交易行为深表歉意，并愿意接受公司做出的上述处理决定。

公司将进一步加强组织董事、监事、高级管理人员对《证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等相关法律法规、规范性文件的学习，并要求各相关人员自身及其亲属严格遵守有关规定，杜绝此类情况的再次发生。

本基金所持有的宁波杉杉股份有限公司及公司间接控股股东杉杉控股有限公司于 2017 年 8 月 22 日收到中国证券监督管理委员会宁波监管局下发的《关于对宁波杉杉股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》([2017]19 号)和《关于对杉杉控股有限公司采取责令改正监管措施的决定》([2017]20 号)。具体内容如下：

1、宁波证监局下发的《关于对宁波杉杉股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》([2017]19 号)

宁波杉杉股份有限公司：

根据《上市公司现场检查办法》等相关规定，我局于 2017 年 6 月 5 日起对你公司开展了现场检查。经检查，发现你公司存在以下问题：

1) 你公司使用募集资金置换预先投入自筹资金时，其中 6,050.79 万元的置换资金系公司董事会于 2015 年 5 月 5 日审议通过非公开发行预案前发生的投资；其中 6,224.56 万元的置换资金系部分子公司于 2016 年 4 月 13 日成为募投项目实施主体前发生的投资。在募集资金使用用途方面，截至 2017 年 5 月底，你公司“年产 35000 吨锂离子动力电池材料项目”实际用于土建投资的募集资金金额为 13,211.03 万元，与公司方案披露的“杉杉股份负责项目的厂房土建，拟投入 9250

万元”的内容不符。上述事项违反了《上市公司监管指引第 2 号——上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第五条相关规定。

2) 你公司对 2016 年 4 月 15 日公告的服装业务与融资租赁业务分拆上市事项、2016 年 8 月 19 日停牌涉及的 Pampa Calichera 股权收购事项、2016 年 12 月 13 日公告的宁波尤利卡太阳能科技发展有限公司 90.035%股权收购事项,均未制作和报送重大事项备忘录。违反了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十条相关规定。

根据《上市公司现场检查办法》第二十一条和《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条相关规定,我局决定对你公司采取责令改正的监管措施,要求你公司于收到本决定后 30 日内报送整改报告,进一步提升规范意识,强化募集资金管理,并将不符合使用要求的资金归还到募集资金专户。

如果对本监督管理措施不服的,可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请,也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间,上述监督管理措施不停止执行。

公司将根据宁波证监局的要求进行整改,尽快形成整改报告,并根据相关规定及时履行信息披露义务。公司将进一步提升规范意识,强化募集资金管理,并将不符合使用要求的资金归还到募集资金专户;同时,严格按照《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》的相关要求,就公司收购、重大资产重组、发行证券、合并、分立、回购股份等重大事项,除填写上市公司内幕信息知情人档案外,制作和报送重大事项进程备忘录。

2、宁波证监局下发的《关于对杉杉控股有限公司采取责令改正监管措施的决定》([2017]20 号)

杉杉控股有限公司:

根据《上市公司现场检查办法》等相关规定,我局于 2017 年 6 月 5 日起对杉杉股份开展了现场检查。经检查,发现存在以下问题:

1) 你公司提供给杉杉股份的关联方名单不完整、不准确。你公司控制的宁波艾缤股权投资合伙企业(有限合伙)、通过宁波市鄞州鸿发实业有限公司投资并委派董事的君康人寿保险股份有限公司等公司均系杉杉股份关联方,但你公司提供给杉杉股份的关联方清单中未包含上述公司。该行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第四十八条“上市公司董事、监事、高级管理人员、持股 5%以上的股东及其一致行动人、实际控制人应当及时向上市公司董事会报送上市公司关联人名单及关联关系的说明”相关规定。

2) 你公司在杉杉股份合并范围外控制多家开展股权投资或产业投资的公司,如宁波星通创富

股权投资合伙企业（有限合伙）的经营范围为股权投资、股权投资管理、股权投资咨询，宁波梅山港保税区杉岩股权投资管理有限公司的经营范围为股权投资管理及其相关咨询服务，和杉杉股份子公司宁波杉杉创业投资有限公司的经营范围存在重合。在杉杉股份合并范围外你公司所投资的杉杉恒盛融资租赁有限责任公司，其经营范围为融资租赁业务、租赁业务等，与杉杉股份子公司富银融资租赁（深圳）股份有限公司的经营范围存在重合。上述事项违反了贵公司出具的避免同业竞争承诺函相关内容。

根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条和《上市公司监管指引第 4 号——上市公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及上市公司承诺及履行》第六条规定，决定对你公司采取责令改正的监管措施，你公司应在收到本决定之日起 30 日内向我局提交书面整改方案，并提升合规意识，避免同业竞争，做好关联方关系的识别和管理，杜绝此类事件再次发生。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

公司间接控股股东杉杉控股将根据宁波证监局的要求进行整改，尽快形成整改方案，并根据相关规定及时履行信息披露义务。杉杉控股将提升合规意识，避免同业竞争，做好关联方关系的识别和管理，杜绝类似事件再次发生。

对此，公司与 2017 年 9 月 12 日公告了整改报告。

本基金所持有的江西赣锋锂业股份有限公司 2017 年 7 月 8 日公告，近期收到深圳证券交易所中小板公司管理部出具的《关于对江西赣锋锂业股份有限公司及相关当事人的监管函》（中小板监管函【2017】第 111 号）和《关于对江西赣锋锂业股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2017】第 115 号）（以下简称“监管函”），公司就相关事项进行了认真核查整改。具体内容如下：

1、监管函的主要内容

1) 监管函【2017】第 111 号：2016 年 10 月 25 日，你公司披露 2016 年第三季度报告，预计 2016 年度归属于上市公司股东的净利润（以下简称“净利润”）为 62,577 万元至 68,835 万元。2017 年 2 月 28 日，公司披露业绩快报，预计 2016 年度净利润为 45,626 万元。2017 年 4 月 12 日，公司披露 2016 年度经审计的净利润为 46,437 万元。公司 2016 年度经审计的净利润与业绩预告中披露的净利润存在较大差异，且未在规定期限内对业绩预告作出修正。

你公司上述行为违反了深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 2.1 条、第 2.5 条、第 2.7 条和第 11.3.3 条的规定。公司董事长兼总裁李良彬、副总裁兼财务总监杨满英违反了深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 2.2 条和第 3.1.5 条的规定，对公司上述违规行为负有重要责任。

2) 监管函【2017】第 115 号：你公司属于“深圳 100 指数”公司，但未按规定在披露 2016 年度报告的同时披露社会责任报告，直至 2017 年 7 月 4 日才对外披露《2016 年度社会责任报告》，且社会责任报告未经公司董事会审议。

你公司的上述行为违反了本所《股票上市规则》第 1.4 条和第 2.1 条以及《中小企业板信息披露业务备忘录第 2 号：定期报告披露相关事项》第二条第七款第一项的规定。

2、原因分析

1) 公司 2016 年度经审计的净利润与业绩预告中披露的净利润存在差异的主要原因为全资子公司深圳市美拜电子有限公司（以下简称“深圳美拜”）2016 年发生两次火灾事故，公司对其商誉计提了减值准备 21,743.10 万元，公司在第三季度对其损失预计不足。

深圳美拜于 2016 年末补偿测算期间届满后，公司聘请了具有证券业务资格的中联资产评估有限公司、立信会计师事务所对深圳美拜进行减值测试。为了保证对深圳美拜减值测试程序的合理性和谨慎性，不损害公司及全体股东特别是中小投资者利益，客观、公允的反映深圳美拜的财务状况和经营成果，公司和中介机构对减值测试方法反复论证，对减值测试的基础工作做得非常细致，工作量较大。公司未能在 2017 年 1 月 31 日前完成减值测试工作。

深圳美拜于 2016 年 7 月第二次火灾事故后虽一直处于停产状态，但事故的主要损失为对周边居民的财产赔偿和员工遣散金，深圳美拜的主要生产线设备和产品均未受到损坏，完全具备恢复生产的条件。2016 年 9 月至 2017 年 1 月，公司多次派人前往深圳，与龙华新区安全生产监督管理部门、龙华新区公安分局消防大队进行了大量的沟通协调，希望在事故处理完毕后允许深圳美拜尽快恢复生产，同时，深圳美拜也在积极探索圆柱型动力电池的贸易业务，开发了深圳市倍斯特科技股份有限公司、江苏孚安科技能源有限公司等新客户，2016 年 7-12 月实现贸易业务的销售收入 6316 万元，公司财务部门和原股东李万春据此才认为深圳美拜仍然存在恢复生产的可能性和持续盈利能力，应该采用收益法进行评估，而采用收益法核算的商誉减值准备和火灾事故造成的经济损失已经包含在公司业绩预告的范围内，公司不需要对业绩预告作出修正；但中介机构经现场调研后则认为，只要深圳美拜没有收到政府同意恢复生产的批复，就具有不确定性；深圳美拜没有生产，就不具备持续盈利能力；圆柱型动力电池的贸易业务尚处于早期阶段，未来的经营效果同样具有不确定性，深圳美拜不适于采用收益法进行评估，应该采用资产基础法进行评估，而采用资产基础法核算的商誉减值准备就超出了业绩预告的范围，公司需要对业绩预告作出修正。公司和中介机构对深圳美拜减值测试应该采用的方法未达成一致意见，对公司计提商誉减值准备的具体金额造成了巨大影响，直接导致了公司是否需要对业绩预告作出修正。

深圳美拜 2016 年发生的两次火灾事故及后续进展情况公司均予以了及时、准确、完整的信息

披露，未对市场造成不良影响；深圳美拜 2016 年两次火灾事故共计造成经济损失 4962.04 万元，公司已经与原股东李万春签订了损失赔偿协议，由李万春个人全部承担；同时，公司严格按照盈利补偿协议的约定实施回购注销原股东应补偿的股份，未损害公司及全体股东特别是中小投资者利益；2016 年 10 月至 2017 年 2 月期间，公司全体董事、监事、高级管理人员未发生减持公司股票的行为，此次业绩预告未及时修正主要是各方在规定期限内尚存在意见分歧，公司财务部门对评估方法等专业判断问题认识不足，并非公司主观过错或疏忽造成的。公司在未如期披露业绩预告修正公告后，主动向深交所反映了相关情况，积极配合深交所的工作安排。

2) 因工作人员疏忽，未及时知悉公司已经纳入“深圳 100 指数”公司，应以单独报告的形式在披露年度报告的同时对外披露社会责任报告，且公司已于第四届董事会第二次会议审议的 2016 年年度报告第五节重要事项十八社会责任情况中就相关内容进行了审议，公司误认为可以视同《2016 年度社会责任报告》经过了董事会审议，导致该报告未按要求进行披露。

3、整改情况

公司董事会始终要求公司严格遵守国家法律法规，及时、公平地披露有关信息，并保证所披露的信息真实、准确、完整，不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。收到监管函后，公司充分重视上述问题，认真分析了原因，吸取教训，及时整改，杜绝类似问题的再次发生。现将整改情况说明如下：

1) 加强对相关业务部门人员的培训学习

公司董事会迅速组织全体董事、监事、高级管理人员及相关业务部门的人员进行业务培训，认真学习《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》、《中小企业板信息披露业务备忘录第 1 号：业绩预告、业绩快报及其修正》、《中小企业板信息披露业务备忘录第 2 号：定期报告披露相关事项》等有关法律法规以及公司《信息披露事务管理制度》，并要求公司相关业务部门认真落实整改措施，提高公司信息披露工作水平和规范意识，保证信息披露工作制度有效执行。加强财务管理工作，强化各级会计核算工作的准确性和及时性。

2) 加强公司与中介机构及公司各部门间的沟通

公司将加强与评估机构、会计师事务所的有效沟通，同时做好公司各部门间的沟通，更加严格把控重大事项完成的时间节点，及时发现问题、解决问题，确保重大信息的及时传递，以保证及时履行信息披露义务。

公司将以本次整改为契机，不断提高相关工作人员的业务水平，提升公司信息披露质量，杜绝类似事情的再次发生。对于此次未按规定履行信息披露的行为，公司董事会深表歉意。公司将认真吸取教训，组织落实整改措施，进一步树立规范运作意识，确保真实、准确、完整地履行信

息披露义务，维护公司及全体股东利益，促进公司健康持续稳定发展。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资华友钴业主要基于以下原因：钴资源紧俏，未来有望价量齐升。公司作为国内钴业龙头，资源储备丰富，建立了自有矿、当地贸易系统以及大宗贸易商直接采购三大原矿供应体系，上游资源供应得到有效保障。

本基金投资杉杉股份主要基于以下原因：公司积极布局电池材料全产业链，已经实现正极、负极、电解液等核心材料的全面爆发，利用已有客户打开市场，通过优化产品结构、提供全包服务持续提升客户黏性，全产业链全球材料霸主雏形已现。

本基金投资赣锋锂业主要基于以下原因：公司是国内唯一同时拥有卤水提锂、锂辉石提锂和锂云母提锂的企业。由于新能源汽车行业景气度的持续上行，锂资源处于量价齐升阶段，公司作为锂资源的龙头企业，将持续受益。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	189,957.49
2	应收证券清算款	49,998,712.12
3	应收股利	-

4	应收利息	2,689,372.72
5	应收申购款	34,310.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,912,352.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
4,210	32,467.48	122,743,499.78	89.80%	13,944,607.95	10.20%

9.3 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	3,702.74	0.00%

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年12月28日）基金份额总额	335,865,199.76
本报告期期初基金份额总额	12,132,745.77
本报告期基金总申购份额	3,113,460,023.69
减:本报告期基金总赎回份额	2,988,904,661.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	136,688,107.73

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 50000 元；截至 2017 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 7 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
太平洋证券股份有限公司	2	828,958,186.44	83.54%	762,160.17	83.46%	-
五矿证券有限公司	1	108,359,079.37	10.92%	100,913.77	11.05%	-
国信证券股份有限公司	1	55,016,446.38	5.54%	50,136.45	5.49%	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资金雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签

约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本报告期内，本基金新增租用 2 个交易单元。

11.7.2 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
太平洋证券股份有限公司	-	-	3,600,000,000.00	83.72%	-	-
五矿证券有限公司	10,783,829.60	100.00%	700,000,000.00	16.28%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-9-14 至 2017-10-18	-	11,271,108.18	-	11,271,108.18	8.25%
	2	2017-10-19 至 2017-10-19	-	135,913,341.30	135,913,341.30	0.00	0.00%
	3	2017-10-19 至 2017-10-19	-	108,730,564.31	108,730,564.31	0.00	0.00%
	4	2017-10-19 至 2017-10-19	-	108,730,564.31	108,730,564.31	0.00	0.00%

	5	2017-11-1 至 2017-12-31	-	108,754,214.24	-	108,754,214.24	79.56%
	6	2017-10-23 至 2017-10-30	-	652,528,004.35	652,528,004.35	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

东方基金管理有限责任公司
2018 年 3 月 30 日