

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2017 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：二〇一八年一月十九日

§ 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 17 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 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	400015
交易代码	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
报告期末基金份额总额	136,688,107.73 份
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。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数或债券指数时，本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

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。
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

§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（2017年10月1日—2017年12月31日）
1. 本期已实现收益	8,828,394.28
2. 本期利润	9,265,007.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0143
4. 期末基金资产净值	190,434,417.60
5. 期末基金份额净值	1.3932

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。

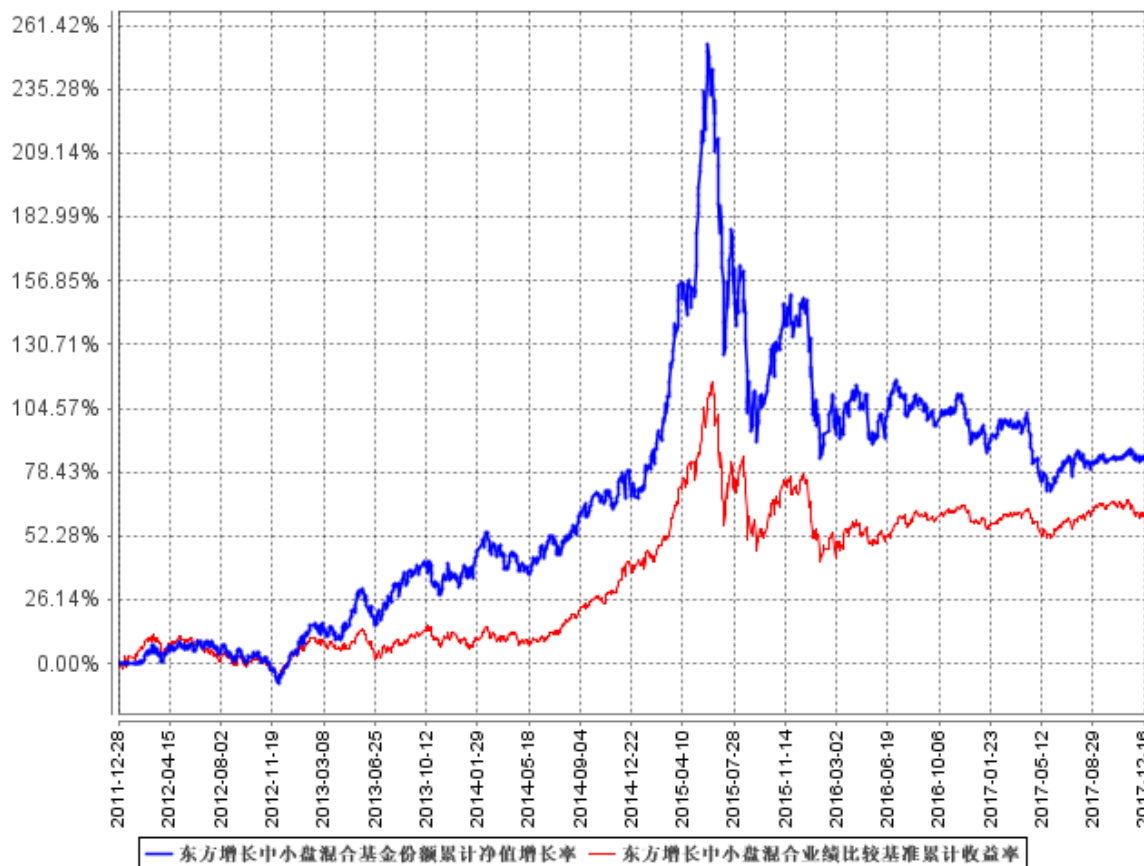
3.2 基金净值表现

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	1.43%	0.38%	-2.12%	0.54%	3.55%	-0.16%

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

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



§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		
薛子徵（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、中信基金管理有限责任公司助理研

					<p>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。现任东方增长中 小盘混合型开放式证 券投资基金基金经理、 东方核心动力混合型 证券投资基金基金经 理、东方睿鑫热点挖 掘灵活配置混合型证 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、东方大健康混合 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。</p>
李瑞（先生）	本基金基 金经理	2017 年 12 月 15 日	-	6 年	<p>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。</p>

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遵规守信情况的说明

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作基金资产，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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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中的公平交易程序；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。

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，未直接或通过与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。

4.3.2 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。

本报告期内，未出现涉及本基金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成交量 5% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场表现延续了 2017 年分化较大的特点。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。

报告期内本基金以银行等金融板块，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017 年 10 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 1.43%，业绩比较基准收益率为 -2.12%，高于业绩比较基准 3.55%。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	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	其他资产	52,912,352.45	10.70
9	合计	494,358,906.49	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	3,673,563.00	1.93
C	制造业	101,672,082.86	53.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	51,039.00	0.03
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

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	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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	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

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

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

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

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： $(\text{卖出均价 } 48.45 \text{ 元/股} - \text{买入均价 } 44.37 \text{ 元/股}) \times 700 \text{ 股} = 2,856 \text{ 元}$ ；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。

5.11.2

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备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

5.11.4 报告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。

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	23,774,655.68
报告期期间基金总申购份额	3,098,640,655.84
减：报告期期间基金总赎回份额	2,985,727,203.79
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	136,688,107.73

§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	11,271,108.18
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	11,271,108.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	8.25

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

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	2017-10-1 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%
	3	2017-10-19 至 2017-10-19	-	108,730,564.31	108,730,564.31	-	0.00%
	4	2017-10-	-	108,730,564.31	108,730,564.31	-	0.00%

		19 至 2017-10-19					
	5	2017-10-23 至 2017-10-30	-	652,528,004.35	652,528,004.35	-	0.00%
	6	2017-11-1 至 2017-12-31	-	108,754,214.24	-	108,754,214.24	79.56%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

(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。

(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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 一、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2018 年 1 月 19 日