

东方策略成长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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	东方策略成长混合
基金主代码	400007
前端交易代码	400007
后端交易代码	400008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 3 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	166,263,200.88 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司，分享国民经济快速发展带来的成长性收益，追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析宏观经济发展战略，确定基金重点投资的行业，自上而下配置资产，自下而上精选证券。本基金从重点投资的行业中寻找成长性公司，通过成长风险值控制成长风险，以合理的价格投资于优秀公司和/或相对价值低估的其他公司；通过组合投资有效分散风险，谋求基金资产长期稳定的增长。
业绩比较基准	标普中国 A 股 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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		东方基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田青
	联系电话	010-66295888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tianqingl.zh@ccb.com

客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	010-67595096
传真	010-66578700	010-66275853

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	52,240,675.11	-81,192,741.36	-341,181,261.23
本期利润	73,178,865.46	-108,315,341.85	-328,557,644.60
加权平均基金份额本期利润	0.3872	-0.4727	-1.8139
本期基金份额净值增长率	15.26%	-17.07%	50.23%
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	0.2899	0.0034	0.3685
期末基金资产净值	472,835,976.93	518,874,742.46	674,686,055.33
期末基金份额净值	2.8439	2.4674	2.9753

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。

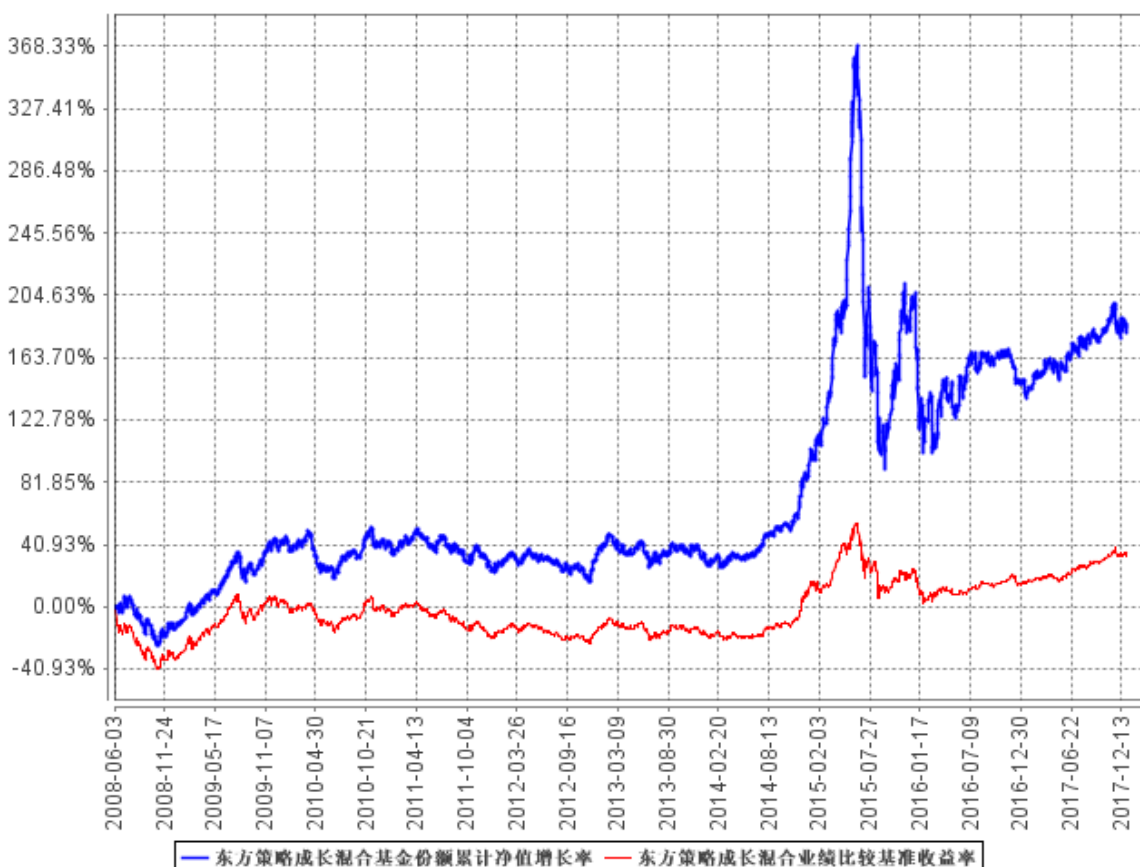
3.2 基金净值表现

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	2.56%	1.13%	4.08%	0.57%	-1.52%	0.56%
过去六个月	4.68%	0.95%	7.95%	0.49%	-3.27%	0.46%
过去一年	15.26%	0.88%	17.17%	0.45%	-1.91%	0.43%
过去三年	43.60%	2.16%	18.28%	1.15%	25.32%	1.01%
过去五年	106.09%	1.78%	56.49%	1.06%	49.60%	0.72%
自基金合同生效起至今	184.39%	1.55%	34.73%	1.17%	149.66%	0.38%

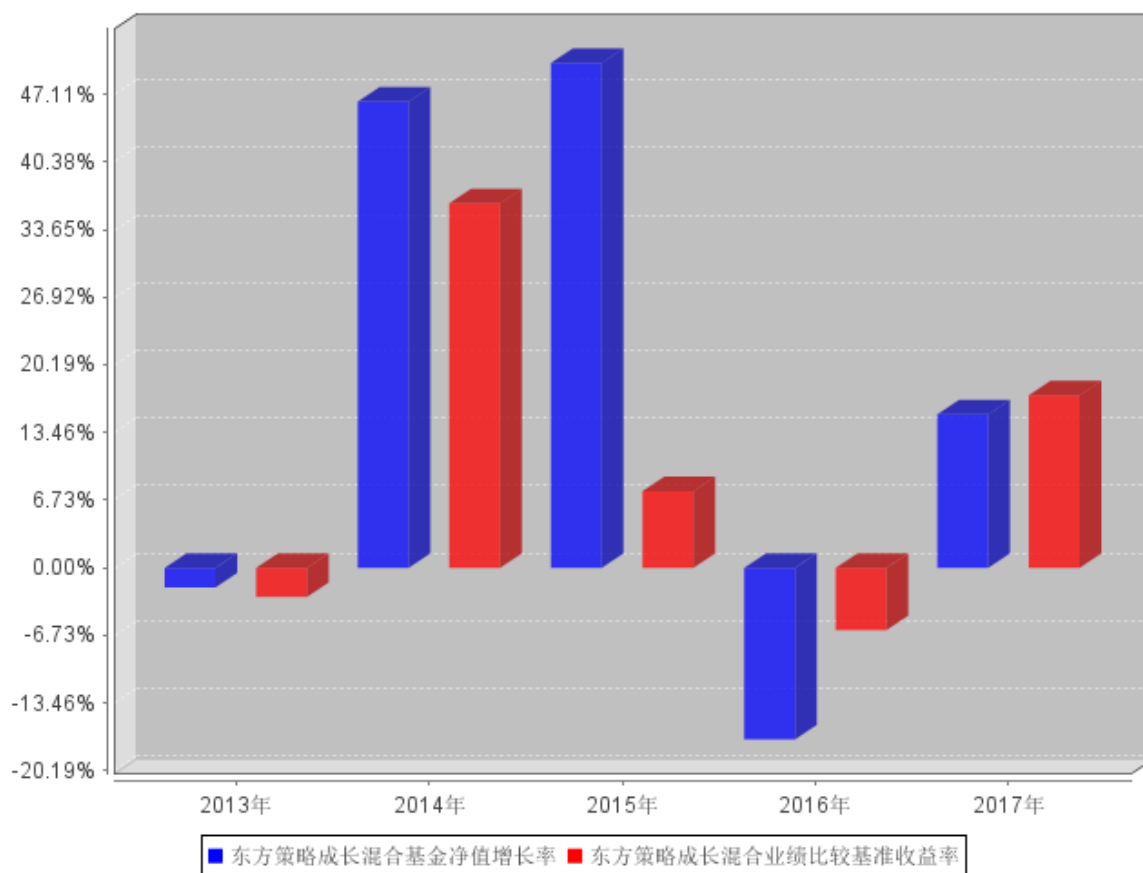
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方策略成长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

东方策略成长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

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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、东方中证通货币市场基金、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		
王然（女士）	本基金基金经理	2015 年 5 月 4 日	-	9 年	北京交通大学产业经济学硕士，9 年证券从业经历，曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010 年 4 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部交通运

				<p>输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于 2017 年 9 月 13 日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）</p>
--	--	--	--	---

					<p>基金经理，现任东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金经理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘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。</p>
郭瑞	本基金基金经理	2016 年 8 月 16 日	2017 年 9 月 13 日	6 年	<p>中国科学院研究生院概率论与数理统计硕士，6 年证券从业经历，曾任中国移动通信集团公司项目经理、宏源证券股份有限公司北京资产管理分公司高</p>

					<p>级研究员、润晖投资咨询（北京）有限公司高级研究员。2015 年 8 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、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理助理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理，现任东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于 2018 年 1 月 17 日更名为东方成长收益灵活配置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。</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

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、《东方策略成长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，海外美日欧等经济体也陆续进入经济复苏通道，各经济指标表现较好，美国进一步确认升息通道，但同时通胀预期渐起。2017 年，中国经济整体运行平稳，通过“去产能”“去杠杆”的继续深化，中国经济正在微观上进行着产业结构优化，企业盈利和银行不良资产率得到改善。人均可支配收入和城镇化率稳步提升，消费升级趋势明显，医疗教育等产业得到更多关注。战略新兴产业经过多年的培育后也开始显露头角，为国家战略转型积蓄力量。

报告期内，上证综指呈现震荡向上走势，全年上涨 6.5%，沪深 300 指数涨幅 21.8%，价值白马的龙头效应显著；而深圳成指上涨 8.5%，创业板指下跌 10.7%，分化明显。根据 wind 的数据统计，申万行业中 60% 的行业实现了正收益，其中有色金属、电子、钢铁、医药、建筑装饰涨幅居前，分别上涨了 35%、24%、20%、13%、10%；跌幅最大的三个行业是商贸、农业、纺织服装，分别下跌了 18%、15%、14%。行业分化明显，主要基于投资者对于业绩的追逐达到了近年来的高点，受益于政策且盈利可持续兑现的行业均有较好的表现，特别是行业龙头的股价表现更为可观。

报告期内，本基金以景气度提升或边际改善行业为优选行业，通过自上而下的优选行业，和自下而上优选行业龙头的方式，进行基金配置，特别是在年初抓住了化工品的旺季行情、白酒的景气回升行情以及年底的医药政策受益行情，实现了较好的绝对收益，并在相对排名中取得了较好的成绩。

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 15.26%，业绩比较基准收益率为 17.17%，低于业绩比较基准 1.91%。

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 2018 年，欧美经济复苏持续，美国一系列刺激美元回流和贸易摩擦再起的预期都对国内市场产生不利影响，2018 年海外市场对国内的负面影响加剧。而国内市场正处在转型升级的

关键阶段，不能一蹴而就，但机会和风险并存。一方面，“去杠杆、去产能、去库存、降成本、补短板”仍是未来一段时间的主要方向，另一方面，人工智能、生物技术、新能源等战略新兴产业经过近年来的培育也开始萌发动力，为经济结构转型升级积蓄力量。这里面蕴含的机会值得我们深入挖掘。

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，定期和实时监察，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

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

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数或基金资产净值预警情形的说明

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 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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 ZB30056

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	东方策略成长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	<p>我们审计了东方策略成长混合型开放式证券投资基金（以下简称东方策略成长基金）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。</p> <p>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，公允反映了东方策略成长基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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，我们独立于东方精选基金，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>
其他信息	<p>东方策略成长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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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，使其真实公允反映，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精选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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，</p>

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。

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：

(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。

(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。

(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。

(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，就可能导致对东方精选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精选基金不能持续经营。

(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：东方策略成长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	13,020,232.32	131,788,487.70
结算备付金	3,823,629.34	854,466.02
存出保证金	453,384.92	187,763.45
交易性金融资产	458,981,104.36	393,002,798.38
其中：股票投资	427,065,104.36	366,125,298.38
基金投资	-	-
债券投资	31,916,000.00	26,877,500.00
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	10,000,000.00	-
应收证券清算款	48,550.74	143,748.99
应收利息	818,663.39	346,629.63
应收股利	-	-
应收申购款	95,135.56	23,763.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	487,240,700.63	526,347,658.04
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	10,899,122.92	5,437,498.25
应付赎回款	386,127.03	361,900.91
应付管理人报酬	604,770.72	674,703.31
应付托管费	100,795.08	112,450.53

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,019,515.15	741,740.49
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	394,392.80	144,622.09
负债合计	14,404,723.70	7,472,915.58
所有者权益：		
实收基金	166,263,200.88	210,288,112.46
未分配利润	306,572,776.05	308,586,630.00
所有者权益合计	472,835,976.93	518,874,742.46
负债和所有者权益总计	487,240,700.63	526,347,658.04

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4396 元，基金份额总额 166,263,200.88 份。

7.2 利润表

会计主体：东方策略成长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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	93,072,790.59	-94,063,910.93
1. 利息收入	1,805,328.00	934,362.49
其中：存款利息收入	381,038.45	427,951.11
债券利息收入	867,627.41	296,520.54
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	556,662.14	209,890.84
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	70,168,265.90	-68,233,324.35
其中：股票投资收益	65,173,842.64	-68,870,127.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,756.00	-750,816.85
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	4,983,667.26	1,387,620.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	20,938,190.35	-27,122,600.49

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	161,006.34	357,651.42
减：二、费用	19,893,925.13	14,251,430.92
1. 管理人报酬	7,574,405.05	8,521,615.78
2. 托管费	1,262,400.72	1,420,269.25
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,648,288.44	4,121,546.60
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	408,830.92	187,999.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	73,178,865.46	-108,315,341.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	73,178,865.46	-108,315,341.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方策略成长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）	210,288,112.46	308,586,630.00	518,874,742.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	73,178,865.46	73,178,865.46
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）	-44,024,911.58	-75,192,719.41	-119,217,630.99
其中：1. 基金申购款	26,471,693.72	45,550,046.84	72,021,740.56
2. 基金赎回款	-70,496,605.30	-120,742,766.25	-191,239,371.55
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）	166,263,200.88	306,572,776.05	472,835,976.93
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）	226,761,288.62	447,924,766.71	674,686,055.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-108,315,341.85	-108,315,341.85
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）	-16,473,176.16	-31,022,794.86	-47,495,971.02
其中：1. 基金申购款	114,404,694.91	161,505,121.20	275,909,816.11
2. 基金赎回款	-130,877,871.07	-192,527,916.06	-323,405,787.13
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）	210,288,112.46	308,586,630.00	518,874,742.46

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：

刘鸿鹏	刘鸿鹏	肖向辉
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

东方策略成长股票型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2008 年 3 月 21 日中国证监会《关于核准东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可

【2008】407 号）和《关于同意东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集时间安排的函》

（基金部函【2008】121 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《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》自 2008 年

4月15日至2008年5月30日公开募集设立。本基金为股票型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集329,260,029.20元人民币，业经天华中兴会计师事务所有限公司“天华中兴验字【2008】第1058-01号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》于2008年6月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为329,346,406.20份基金单位，其中认购资金利息折合86,377.00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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

本基金自2015年8月7日起变更名称为“东方策略成长混合型开放式证券投资基金”，基金代码400007保持不变，详情可参阅《关于东方策略成长股票型开放式证券投资基金变更基金名称并修改基金合同的公告》。

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》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

本报告期本基金所采用的会计政策、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

本基金在本报告期间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
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、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

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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
东北证券股份 有限公司	-	-	125,214,356.02	4.72%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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 (%)
东北证券股份 有限公司	116,612.57	4.72%	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	7,574,405.05
其中：支付销售机构的 客户维护费	2,257,444.06	2,512,547.79

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计算，具体计算方法如下：

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

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支

付。

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	1,262,400.72	1,420,269.25

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：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 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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 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
基金合同生效日（ 2008 年 6 月 3 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,500,000.00	9,001,722.50
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	4,501,722.50
期末持有的基金份额	4,500,000.00	4,500,000.00
期末持有的基金份额	2.71%	2.14%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	13,020,232.32	326,222.99	131,788,487.70	397,661.67

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

7.4.10.1.1 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
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	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	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
--------	------	-------------	------	-------	-----------	-------	-----	-----------	-----------	---

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	427,065,104.36	87.65
	其中：股票	427,065,104.36	87.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,916,000.00	6.55
	其中：债券	31,916,000.00	6.55
	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	10,000,000.00	2.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,843,861.66	3.46
8	其他各项资产	1,415,734.61	0.29
9	合计	487,240,700.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,495,522.00	2.64
B	采矿业	7,100,000.00	1.50
C	制造业	240,830,339.85	50.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,217,500.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	16,666,445.67	3.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,201,648.55	7.44
J	金融业	93,028,505.09	19.67
K	房地产业	4,765,000.00	1.01
L	租赁和商务服务业	7,744,000.00	1.64
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	427,065,104.36	90.32

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	601318	中国平安	400,000	27,992,000.00	5.92
2	600519	贵州茅台	35,000	24,412,150.00	5.16
3	600887	伊利股份	750,000	24,142,500.00	5.11
4	600276	恒瑞医药	309,969	21,381,661.62	4.52
5	000651	格力电器	480,000	20,976,000.00	4.44
6	600036	招商银行	689,937	20,021,971.74	4.23
7	300059	东方财富	1,380,080	17,872,036.00	3.78
8	601398	工商银行	2,800,000	17,360,000.00	3.67
9	600196	复星医药	380,046	16,912,047.00	3.58
10	601336	新华保险	240,026	16,849,825.20	3.56

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	000568	泸州老窖	99,850,221.85	19.24
2	601318	中国平安	92,788,558.00	17.88
3	600519	贵州茅台	67,598,537.01	13.03
4	002456	欧菲科技	67,342,135.73	12.98
5	600887	伊利股份	64,603,420.69	12.45
6	000858	五粮液	57,304,625.80	11.04
7	600068	葛洲坝	56,809,921.66	10.95
8	601336	新华保险	56,080,583.92	10.81
9	601398	工商银行	53,957,647.45	10.40
10	000651	格力电器	51,752,838.70	9.97
11	000001	平安银行	48,366,962.23	9.32

12	600036	招商银行	43,027,923.44	8.29
13	600584	长电科技	38,479,873.42	7.42
14	000933	神火股份	38,261,870.71	7.37
15	000333	美的集团	36,599,980.99	7.05
16	600809	山西汾酒	36,480,854.70	7.03
17	000878	云南铜业	34,244,364.96	6.60
18	600019	宝钢股份	33,405,466.68	6.44
19	601668	中国建筑	33,349,047.00	6.43
20	000063	中兴通讯	32,877,037.01	6.34
21	002415	海康威视	32,454,703.88	6.25
22	002475	立讯精密	30,411,019.23	5.86
23	300212	易华录	29,756,680.32	5.73
24	000049	德赛电池	29,556,862.98	5.70
25	601233	桐昆股份	29,025,624.84	5.59
26	600808	马钢股份	28,686,227.00	5.53
27	000002	万科A	28,342,367.44	5.46
28	300433	蓝思科技	27,797,060.66	5.36
29	600056	中国医药	26,984,347.04	5.20
30	600487	亨通光电	26,762,218.04	5.16
31	601800	中国交建	26,571,646.79	5.12
32	600276	恒瑞医药	25,945,240.51	5.00
33	300059	东方财富	25,738,721.48	4.96
34	601607	上海医药	25,709,805.88	4.95
35	000797	中国武夷	25,435,436.30	4.90
36	002078	太阳纸业	25,005,155.37	4.82
37	300136	信维通信	23,871,294.24	4.60
38	000825	太钢不锈	23,656,934.32	4.56
39	000807	云铝股份	23,597,402.78	4.55
40	002410	广联达	23,553,815.17	4.54
41	600048	保利地产	22,799,654.03	4.39
42	601601	中国太保	22,769,092.96	4.39
43	600125	铁龙物流	22,618,877.83	4.36
44	600030	中信证券	22,328,425.00	4.30
45	600585	海螺水泥	21,825,698.00	4.21
46	002241	歌尔股份	21,272,001.36	4.10
47	601166	兴业银行	20,940,021.36	4.04

48	600801	华新水泥	20,308,470.06	3.91
49	300450	先导智能	19,962,103.00	3.85
50	600104	上汽集团	19,949,838.44	3.84
51	300296	利亚德	19,053,501.98	3.67
52	600816	安信信托	18,802,224.40	3.62
53	600569	安阳钢铁	17,708,196.18	3.41
54	000725	京东方A	17,677,000.00	3.41
55	600967	内蒙一机	17,177,698.00	3.31
56	002466	天齐锂业	16,660,887.60	3.21
57	600196	复星医药	16,604,875.40	3.20
58	000728	国元证券	16,591,587.50	3.20
59	000928	中钢国际	16,012,782.33	3.09
60	002371	北方华创	15,823,271.00	3.05
61	601211	国泰君安	15,731,431.48	3.03
62	000065	北方国际	15,622,794.16	3.01
63	600779	水井坊	15,491,599.48	2.99
64	300115	长盈精密	15,420,528.34	2.97
65	600362	江西铜业	15,322,931.81	2.95
66	002146	荣盛发展	15,182,131.00	2.93
67	002304	洋河股份	15,163,543.00	2.92
68	600549	厦门钨业	14,861,445.00	2.86
69	000980	众泰汽车	14,643,001.00	2.82
70	601288	农业银行	14,491,500.00	2.79
71	000959	首钢股份	14,431,635.39	2.78
72	601118	海南橡胶	14,390,851.50	2.77
73	600050	中国联通	14,317,000.00	2.76
74	000661	长春高新	14,299,473.00	2.76
75	300166	东方国信	14,280,986.22	2.75
76	002027	分众传媒	14,050,643.36	2.71
77	002008	大族激光	13,988,431.00	2.70
78	000538	云南白药	13,620,677.39	2.63
79	000717	韶钢松山	13,407,898.08	2.58
80	601333	广深铁路	13,282,000.00	2.56
81	000401	冀东水泥	13,247,629.00	2.55
82	603799	华友钴业	13,215,434.18	2.55
83	300075	数字政通	13,061,645.00	2.52

84	603626	科森科技	13,020,168.63	2.51
85	002273	水晶光电	13,005,631.00	2.51
86	300408	三环集团	12,977,551.78	2.50
87	600703	三安光电	12,880,694.00	2.48
88	600963	岳阳林纸	12,814,891.44	2.47
89	000423	东阿阿胶	12,777,504.00	2.46
90	002092	中泰化学	12,777,184.00	2.46
91	300078	思创医惠	12,591,603.47	2.43
92	600720	祁连山	12,536,265.00	2.42
93	002405	四维图新	12,443,608.50	2.40
94	600497	驰宏锌锗	12,344,676.00	2.38
95	300367	东方网力	12,183,270.80	2.35
96	600782	新钢股份	12,118,895.00	2.34
97	002234	民和股份	12,112,915.00	2.33
98	601117	中国化学	11,700,219.00	2.25
99	600266	北京城建	11,349,450.00	2.19
100	300422	博世科	11,276,376.70	2.17
101	600990	四创电子	11,200,018.50	2.16
102	600169	太原重工	11,111,120.00	2.14
103	000983	西山煤电	10,921,278.80	2.10
104	000703	恒逸石化	10,866,149.00	2.09
105	002310	东方园林	10,838,610.99	2.09
106	600835	上海机电	10,801,639.00	2.08
107	002074	国轩高科	10,742,088.58	2.07
108	600383	金地集团	10,632,045.00	2.05
109	600111	北方稀土	10,624,151.00	2.05
110	600038	中直股份	10,603,574.48	2.04
111	601857	中国石油	10,576,949.38	2.04
112	300401	花园生物	10,559,166.65	2.04
113	601998	中信银行	10,507,340.00	2.03

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	000568	泸州老窖	112,561,524.64	21.69
2	002456	欧菲科技	88,811,009.59	17.12
3	000858	五粮液	85,346,728.84	16.45
4	601318	中国平安	71,035,750.43	13.69
5	600519	贵州茅台	56,770,967.84	10.94
6	600068	葛洲坝	54,357,721.62	10.48
7	600887	伊利股份	50,731,506.83	9.78
8	601336	新华保险	40,414,170.39	7.79
9	601800	中国交建	39,494,485.00	7.61
10	000333	美的集团	39,453,217.93	7.60
11	600809	山西汾酒	38,323,649.89	7.39
12	000933	神火股份	38,228,968.58	7.37
13	600584	长电科技	37,957,665.88	7.32
14	000001	平安银行	37,915,187.68	7.31
15	601398	工商银行	36,980,592.05	7.13
16	000651	格力电器	35,487,279.90	6.84
17	000063	中兴通讯	34,090,583.75	6.57
18	600019	宝钢股份	34,040,079.24	6.56
19	601668	中国建筑	32,217,389.40	6.21
20	300433	蓝思科技	31,715,557.80	6.11
21	000065	北方国际	31,663,533.01	6.10
22	600409	三友化工	30,895,123.65	5.95
23	000002	万科A	30,522,567.29	5.88
24	002475	立讯精密	30,345,814.32	5.85
25	600487	亨通光电	29,255,054.68	5.64
26	000049	德赛电池	28,617,480.01	5.52
27	601233	桐昆股份	28,482,854.88	5.49
28	000928	中钢国际	28,359,985.78	5.47
29	600808	马钢股份	28,328,436.00	5.46
30	000807	云铝股份	27,372,811.19	5.28
31	000878	云南铜业	27,182,281.40	5.24
32	002410	广联达	26,239,969.88	5.06
33	600056	中国医药	26,145,211.00	5.04
34	000797	中国武夷	25,884,981.40	4.99
35	300136	信维通信	25,626,513.30	4.94
36	601601	中国太保	25,278,645.02	4.87

37	601607	上海医药	25,139,883.60	4.85
38	002078	太阳纸业	24,847,604.60	4.79
39	600585	海螺水泥	24,686,342.23	4.76
40	002241	歌尔股份	24,661,397.17	4.75
41	600036	招商银行	24,276,034.72	4.68
42	300422	博世科	23,686,117.89	4.56
43	300212	易华录	23,353,840.62	4.50
44	600801	华新水泥	23,234,692.24	4.48
45	002415	海康威视	23,139,456.39	4.46
46	600048	保利地产	22,736,123.12	4.38
47	000825	太钢不锈	22,300,577.00	4.30
48	600030	中信证券	21,958,217.00	4.23
49	600104	上汽集团	20,975,872.00	4.04
50	601166	兴业银行	20,840,887.62	4.02
51	600816	安信信托	19,187,114.46	3.70
52	300296	利亚德	19,137,071.83	3.69
53	300450	先导智能	18,998,491.00	3.66
54	600569	安阳钢铁	18,701,716.69	3.60
55	600643	爱建集团	17,839,930.52	3.44
56	600967	内蒙一机	17,536,265.95	3.38
57	600125	铁龙物流	16,730,490.45	3.22
58	002236	大华股份	16,049,969.70	3.09
59	000980	众泰汽车	16,017,671.00	3.09
60	600779	水井坊	15,932,022.83	3.07
61	002092	中泰化学	15,704,353.00	3.03
62	300115	长盈精密	15,596,026.74	3.01
63	002466	天齐锂业	15,583,811.72	3.00
64	600362	江西铜业	15,383,738.88	2.96
65	000728	国元证券	15,261,923.66	2.94
66	000050	深天马A	14,969,802.00	2.89
67	000717	韶钢松山	14,955,266.96	2.88
68	000959	首钢股份	14,906,944.80	2.87
69	002304	洋河股份	14,872,842.64	2.87
70	002008	大族激光	14,844,561.00	2.86
71	300367	东方网力	14,793,962.00	2.85
72	601211	国泰君安	14,774,251.00	2.85
73	002055	得润电子	14,738,350.34	2.84
74	000538	云南白药	14,414,403.23	2.78

75	601288	农业银行	14,076,400.00	2.71
76	000902	新洋丰	14,036,048.89	2.71
77	000018	神州长城	14,015,881.14	2.70
78	601333	广深铁路	13,974,291.00	2.69
79	000423	东阿阿胶	13,945,864.34	2.69
80	300166	东方国信	13,913,614.86	2.68
81	002570	贝因美	13,851,639.45	2.67
82	601118	海南橡胶	13,532,559.60	2.61
83	603626	科森科技	13,409,439.68	2.58
84	600720	祁连山	13,318,113.00	2.57
85	600549	厦门钨业	13,185,306.00	2.54
86	300075	数字政通	13,176,413.97	2.54
87	000683	远兴能源	13,146,553.00	2.53
88	600963	岳阳林纸	13,039,855.00	2.51
89	600050	中国联通	12,939,151.00	2.49
90	601888	中国国旅	12,424,642.00	2.39
91	000401	冀东水泥	12,365,522.00	2.38
92	300078	思创医惠	12,040,092.81	2.32
93	300408	三环集团	11,997,298.00	2.31
94	600782	新钢股份	11,960,662.00	2.31
95	002234	民和股份	11,821,455.82	2.28
96	600266	北京城建	11,551,746.00	2.23
97	000703	恒逸石化	11,547,073.64	2.23
98	603799	华友钴业	11,527,404.00	2.22
99	601117	中国化学	11,488,890.00	2.21
100	600759	洲际油气	11,413,075.82	2.20
101	300294	博雅生物	11,270,156.74	2.17
102	300232	洲明科技	11,249,055.89	2.17
103	000983	西山煤电	11,202,490.90	2.16
104	600169	太原重工	10,753,303.74	2.07
105	600990	四创电子	10,745,531.00	2.07
106	002051	中工国际	10,688,634.00	2.06
107	002074	国轩高科	10,641,060.70	2.05
108	002310	东方园林	10,611,722.00	2.05
109	601998	中信银行	10,492,129.00	2.02
110	002146	荣盛发展	10,453,473.61	2.01
111	600383	金地集团	10,387,062.16	2.00
112	601857	中国石油	10,384,913.00	2.00

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	3,488,564,594.01
卖出股票收入（成交）总额	3,513,641,685.02

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,916,000.00	6.75
	其中：政策性金融债	31,916,000.00	6.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,916,000.00	6.75

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	170408	17 农发 08	200,000	19,940,000.00	4.22

2	170204	17 国开 04	120,000	11,976,000.00	2.53
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金所持有的东方财富（300059）于 2017 年 3 月 6 日公告，公司涉及一项欠款纠纷，该案已由华南国际经济贸易仲裁委员会受理。案件内容为：本公司（东方财富）购买了由安徽蓝博旺机械集团下属三家企业作为联合发起人发行的 2012 中小企业集合私募债券（其中第一期债券“12 蓝博 01”面值 2,400 万元、第二期债券“12 蓝博 02”面值 4,500 万元），上述债券的债券

票面年利率为 9.8%，按年付息，存续期为 3 年（附第 2 年末投资者回售选择权）。2015 年 1 月、2 月本公司分别对“12 蓝博 01”、“12 蓝博 02”行使回售选择权。因三家联合发起人及担保公司未能支付上述债券的本金及利息，本公司向华南国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。仲裁庭于 2015 年 8 月 21 日就本案进行庭前调解和开庭审理，但本次调解未能就相关债务清偿、违约责任承担及担保责任承担达成一致意见。2016 年 6 月 1 日，东方财富证券收到中国国际经济贸易仲裁委员会作出的书面撤案决定，撤销定向债务融资工具仲裁案件。根据华南国际经济贸易仲裁委员会 2016 年 6 月 30 日下达的华南国仲深裁[2016]D208 号裁决书。第一被申请人安徽蓝博旺机械集团合诚机械有限公司、第二被申请人安徽蓝博旺机械集团液压流体机械有限责任公司、第三被申请人安徽蓝博旺机械集团精密液压件有限责任公司（以下简称—三家被申请人 II）向东方财富证券支付 12 蓝博 01 和 12 蓝博 02 私募债本金合计人民币 69,000,000.00 元，利息合计人民币 6,762,000.00 元，12 蓝博 01 违约金人民币 1,093,608.00 元，12 蓝博 01 违约金人民币 617,625.00 元。因三家被申请人一直未按裁决书履行还款义务，东方财富证券于 2016 年 9 月 5 日向安徽省淮南市中级人民法院申请强制执行，执行案号为（2016）皖 04 执 527 号。截至报告期末，强制执行尚未完成。

公司公告以上欠款纠纷不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的格力电器（000651）于 2017 年 7 月 26 日公告：公司近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》（〔2017〕39 号，以下简称“《决定书》”），《决定书》的主要内容为：“徐自发，经查，你于 2015 年 6 月起至今任格力电器董事。2016 年 11 月 24 日，你通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票 575,300 股，成交均价为 26.39 元/股，成交金额 1518.22 万元。2017 年 5 月 22 日，你再次通过交易所集中竞价交易的方式，卖出格力电器股票 400,825 股，成交均价为 33.45 元/股，成交金额 1340.76 万元。你作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足 6 个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，现对你采取出具警示函的监管措施。你应该认真吸取教训，加强证券法律法规学习，严格规范买卖上市公司股票行为，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生。”公司同时给出相关说明：“徐自发先生于 2017 年 5 月 22 日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中，因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差，出现本次短线交易。公司已于 2017 年 5 月 27 日对相关情况进行了公告（公告编号：2017-020），徐自发先生因本次短线交易产生的收益 2,829,824.5 元已经收归公司所有。”

格力电器于 2017 年 10 月 19 日公告：公司董事徐自发先生于 2017 年 10 月 18 日收到中

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（编号：粤证调查通字 170202 号），该通知书内容为“因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你立案调查，请予以配合。”

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

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。

本基金投资东方财富主要基于以下原因：公司是中国互联网消费金融综合服务商龙头企业，在证券、基金、金融数据业务领域具备较强的领先优势。伴随近年来市场的调整，公司在该领域的市占率提升，盈利能力得到改善，具备一定的投资价值。

本基金投资格力电器主要基于以下原因：长期来看，空调行业还有较大的成长空间，竞争格局优良，格力电器作为行业龙头具备强大的品牌优势，空间尚大。短期来看，地产 2017 年正增长滞后一年对空调仍然是正贡献，目前渠道库存较低，内销量不必过忧，格力同时作为竞争优势明显的龙头企业销量增速有望高于行业；同时格力 18 年出厂均价提升较确定，毛利率有望提升，业绩稳定增长无忧。对标国际国内同行，公司处于估值折价；历史上分红率高，今年有望继续维持高分红，极具价值属性。

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	453,384.92
2	应收证券清算款	48,550.74
3	应收股利	-
4	应收利息	818,663.39
5	应收申购款	95,135.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,415,734.61

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
19,609	8,478.92	4,621,547.90	2.78%	161,641,652.98	97.22%

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	77,826.50	0.05%

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	0~10
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（2008年6月3日）基金份额总额	329,346,406.20
本报告期期初基金份额总额	210,288,112.46
本报告期基金总申购份额	26,471,693.72
减：本报告期基金总赎回份额	70,496,605.30
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	166,263,200.88

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

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。本报告期内，基金管理人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 40,000.00 元；截至 2017 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 10 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	
兴业证券股份有限公司	1	12,195,843,010.84	31.39%	2,044,992.65	31.39%	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	610,060,949.87	8.72%	568,150.90	8.72%	-
中泰证券股份有限公司	3	402,035,991.98	5.75%	374,415.95	5.75%	-
中信证券股份有限公司	1	867,457,478.74	12.40%	807,861.96	12.40%	-
南京证券股份有限公司	3	1,412,043,545.54	20.19%	1,315,033.14	20.19%	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
银河证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	11,506,841,139.20	21.54%	1,403,321.43	21.54%	-	-

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资历雄厚，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，能为基金提供全面的信息服；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人，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 7 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
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	10,000,000.00	1.48%	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	125,000,000.00	18.53%	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	73,000,000.00	10.82%	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	466,500,000.00	69.16%	-	-

§ 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

东方基金管理有限责任公司
2018 年 3 月 30 日