

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2018 年第 1 季度报告

2018 年 3 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：二〇一八年四月十九日

§ 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 4 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 2018 年 1 月 1 日起至 3 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 | 26,132,062.53 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（2018年1月1日—2018年3月31日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 693,527.40 |
| 2. 本期利润 | 1,602,631.38 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0167 |
| 4. 期末基金资产净值 | 37,575,906.24 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4379 |

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。

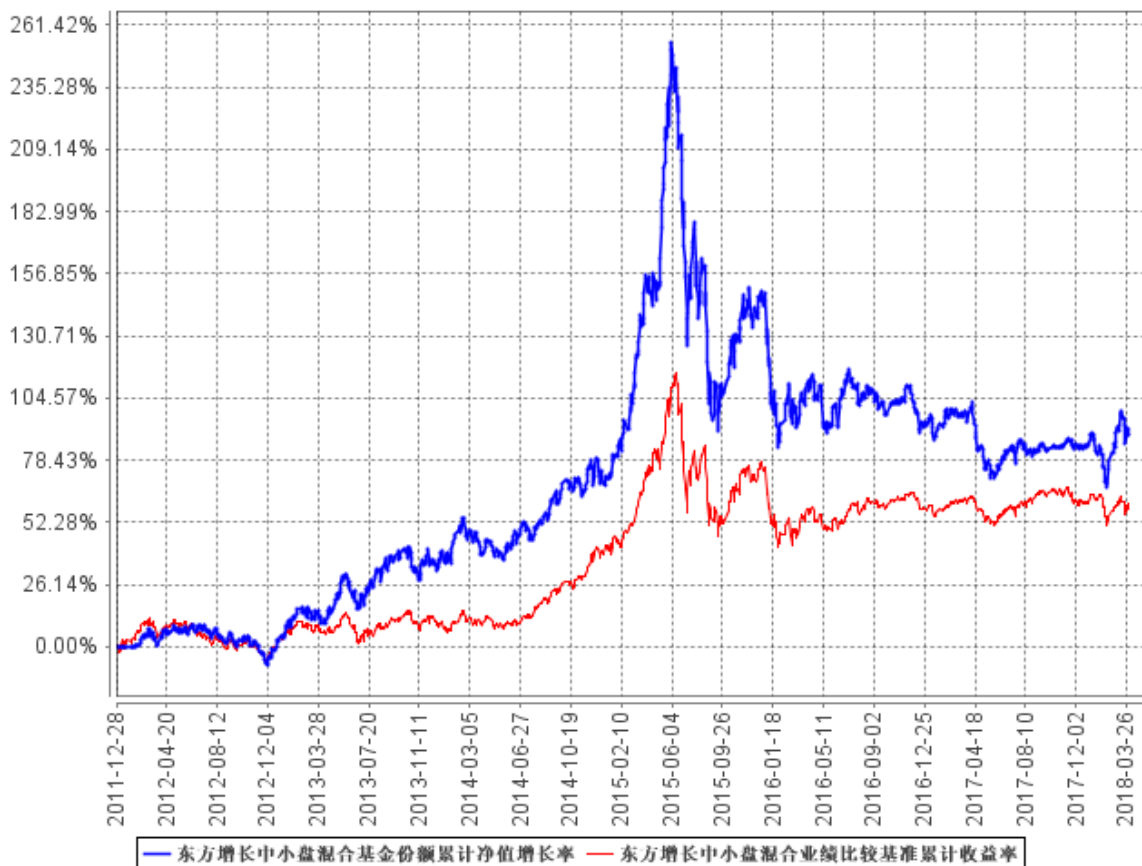
3.2 基金净值表现

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 | 3.21% | 1.37% | -0.63% | 0.83% | 3.84% | 0.54% |

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 | | |
| 薛子微（先生） | 本基金基金经理 | 2015年4月30日 | 2018年1月24日 | 11年 | 山西大学工商管理、应用心理学专业学士，11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 日转型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、东方大健康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、东方增长中小盘混合型开放式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。 |
| 李瑞（先生） | 本基金基金经理 | 2017 年 12 月 15 日 | - | 7 年 | 中国人民大学金融学硕士，7 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

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

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，对经济的支撑作用会消退，社零增速仍然会维持较快增速。

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，取而代之的是追求高质量的经济增长，不再过度依赖社会融资规模大规模扩张的增长。

高质量发展作为政治目标重要性凸显，也成为资本市场重点目标。资本市场政策在高质量发展上与政府目标相呼应，提升上市公司的质量，去伪存真成为政策主线。降低 IPO 通过率，IPO 大检查劝退一些盈利不符合规定的公司，鼓励独角兽回归和 CDR 发行都是政策体现。

2018 年 1 季度，市场表现延续了分化较大的特点。沪深 300 下跌 3.28%，上证综指下跌 4.18%，深证成指下跌 1.56%，中小板指下跌 1.47%，创业板指上涨 8.43%，万得全 A 下跌 3.24%。1 季度本基金净值取得了一定增长，主要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

2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 3 月 31 日，本基金净值增长率为 3.21%，业绩比较基准收益率为 -0.63%，高于业绩比较基准 3.84%。

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，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二十个工作日低于五千万元的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 27,206,143.99 | 68.05 |
| | 其中：股票 | 27,206,143.99 | 68.05 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 7,533,941.72 | 18.84 |
| | 其中：债券 | 7,533,941.72 | 18.84 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,577,316.82 | 11.45 |
| 8 | 其他资产 | 664,125.33 | 1.66 |
| 9 | 合计 | 39,981,527.86 | 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 | 392,808.00 | 1.05 |
| C | 制造业 | 25,002,546.13 | 66.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 152,000.00 | 0.40 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 750,274.06 | 2.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 99,915.80 | 0.27 |
| J | 金融业 | 234,600.00 | 0.62 |
| K | 房地产业 | 134,700.00 | 0.36 |
| 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 | 439,300.00 | 1.17 |
| 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 | 27,206,143.99 | 72.40 |

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 | 300409 | 道氏技术 | 40,000 | 2,086,000.00 | 5.55 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 42,499 | 1,502,764.64 | 4.00 |
| 3 | 002460 | 赣锋锂业 | 19,200 | 1,485,696.00 | 3.95 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 24,582 | 1,447,879.80 | 3.85 |
| 5 | 600525 | 长园集团 | 65,900 | 1,174,338.00 | 3.13 |
| 6 | 600549 | 厦门钨业 | 32,400 | 856,008.00 | 2.28 |
| 7 | 002074 | 国轩高科 | 36,850 | 811,068.50 | 2.16 |
| 8 | 600885 | 宏发股份 | 18,000 | 760,860.00 | 2.02 |
| 9 | 002340 | 格林美 | 102,500 | 760,550.00 | 2.02 |
| 10 | 002050 | 三花智控 | 39,100 | 694,416.00 | 1.85 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,121,583.00 | 13.63 |
| | 其中：政策性金融债 | 5,121,583.00 | 13.63 |
| 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） | 2,412,358.72 | 6.42 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,533,941.72 | 20.05 |

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 | 108601 | 国开 1703 | 32,000 | 3,199,040.00 | 8.51 |
| 2 | 018002 | 国开 1302 | 18,830 | 1,922,543.00 | 5.12 |
| 3 | 110041 | 蒙电转债 | 5,400 | 548,154.00 | 1.46 |
| 4 | 128024 | 宁行转债 | 4,000 | 459,680.00 | 1.22 |
| 5 | 132009 | 17 中油 EB | 4,200 | 415,968.00 | 1.11 |

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

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 | 505,186.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 138,032.30 |
| 5 | 应收申购款 | 20,906.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 664,125.33 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 300409 | 道氏技术 | 2,086,000.00 | 5.55 | 重大事项 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 136,688,107.73 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,898,261.37 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 113,454,306.57 |
| 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 | 26,132,062.53 |

§ 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 (%) | 43.13 |

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。

7.2 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 | 2018-3-1 至 2018-3-31 | 11,271,108.18 | - | - | 11,271,108.18 | 43.13% |
| | 2 | 2018-1-1 至 2018-2-28 | 108,754,214.24 | - | 108,754,214.24 | 0.00 | 0.00% |
| 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 4 月 19 日