

# 东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告

2018 年 6 月 30 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：二〇一八年七月十九日

## § 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 7 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 6 月 21 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

本基金由东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金变更注册而来，此事项由中国证监会核准并经基金份额持有人大会审议通过，变更注册后的《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金合同金》自 2018 年 6 月 21 日起生效，原《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》自该日起失效。具体可参阅本基金管理人于 2018 年 4 月 19 日、2018 年 4 月 20 日、2018 年 4 月 21 日、2018 年 5 月 23 日以及 2018 年 6 月 15 日在《上海证券报》及公司网站上披露的相关公告。

## § 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东方新能源汽车主题混合
基金主代码	400015
交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 21 日
报告期末基金份额总额	25,482,363.54 份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析,在大类资产配置基础上精选个股,严格控制投资风险,追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×80%+银行活期存款

	利率×20%
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。
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

转型前:

基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	888888
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	25,914,828.24 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	中证 700 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
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 (转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 6 月 21 日 — 2018 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-457,563.32
2. 本期利润	237,833.28

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0093
4. 期末基金资产净值	33,622,047.83
5. 期末基金份额净值	1.3194

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。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日—2018年6月20日）
1. 本期已实现收益	-724,261.81
2. 本期利润	-3,349,248.81
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1284
4. 期末基金资产净值	33,932,903.57
5. 期末基金份额净值	1.3094

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（转型后）

#### 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	0.76%	1.89%	1.70%	1.92%	-0.94%	-0.03%

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

东方新能源汽车主题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



注：本基金于 2018 年 6 月 21 日转型，截至报告期末，转型后基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

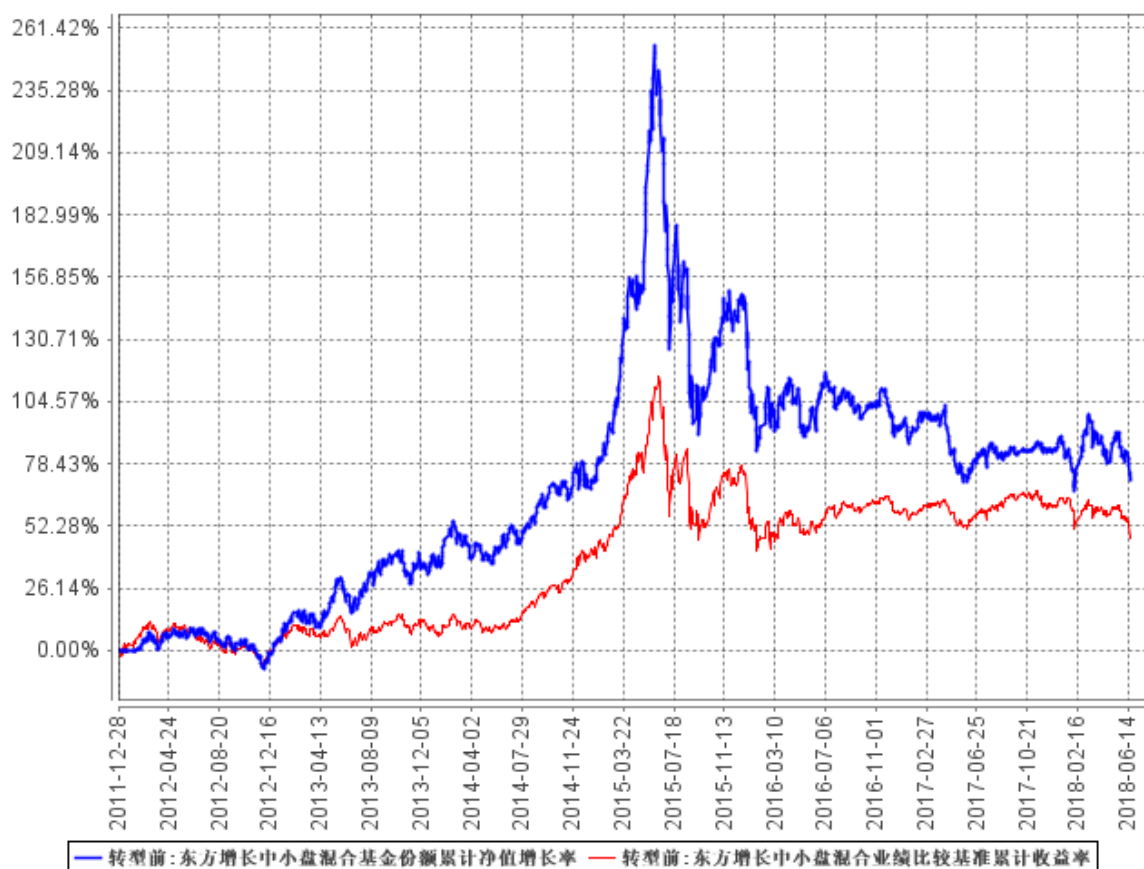
## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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	-8.94%	1.12%	-7.49%	0.75%	-1.45%	0.37%

### 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（转型前）

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		
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。
--	--	--	--	--	--

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
李瑞（先生）	本基金基金经理	2018 年 6 月 21 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，东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于 2018 年 6 月 21 日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型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、《东方新能源汽车主题混合型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

2016年开始的国内经济繁荣，包含了国内外多重因素的原因，尤其2017年，地产销售、基建、出口、消费均表现出了较好的增长。2018年，边际放缓是大概率事件，尤其是基建和出口对经济的支撑作用会消退。

政府在推进去杠杆的过程中，对增速下降容忍度显著提高，取而代之的是不再过度依赖社会



融资规模大规模扩张的高质量增长。

2018 年 2 季度，市场几乎是单边下行。沪深 300 下跌 9.94%，上证综指下跌 10.14%，深证成指下跌 13.70%，中小板指下跌 12.98%，创业板指下跌 15.46%，万得全 A 下跌 11.79%。

2 季度股市下跌更多来自风险偏好的急剧下降和对经济前景的悲观预期，只有增长质量高、持续性强的品种才能抵抗市场的风险。基于此，本季度基金操作策略上一方面总体维持了较低的水平，另一方面操作思路减持了高弹性标的，增持了竞争优势突出、盈利能力及质量优异的稳健标的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 20 日，转型前基金（东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金）净值增长率为-8.94%，业绩比较基准增长率为-7.49%，低于业绩比较基准 1.45%；2018 年 6 月 21 日至 2018 年 6 月 30 日，转型后基金（东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）净值增长率为 0.76%，业绩比较基准增长率为 1.70%，低于业绩比较基准 0.94%。

#### 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，本基金进行了变更注册。

变更注册前的东方增长中小盘混合型开放式证券投资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已变更注册为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金。

变更注册后的东方新能源汽车主题混合型证券投资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

转型后：

#### 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	30,522,154.68	84.27
	其中：股票	30,522,154.68	84.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,735,965.00	4.79

	其中：债券	1,735,965.00	4.79
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,442,523.08	9.50
8	其他资产	519,988.57	1.44
9	合计	36,220,631.33	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	451,500.00	1.34
C	制造业	28,329,394.68	84.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	471,520.00	1.40
J	金融业	687,440.00	2.04
K	房地产业	295,200.00	0.88
L	租赁和商务服务业	287,100.00	0.85
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	30,522,154.68	90.78

## 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	603799	华友钴业	20,000	1,949,400.00	5.80
2	300124	汇川技术	47,499	1,558,917.18	4.64

3	600884	杉杉股份	64,800	1,432,080.00	4.26
4	002050	三花智控	73,100	1,377,935.00	4.10
5	600066	宇通客车	71,600	1,374,004.00	4.09
6	600885	宏发股份	39,600	1,184,832.00	3.52
7	002179	中航光电	28,000	1,092,000.00	3.25
8	600563	法拉电子	21,200	1,049,188.00	3.12
9	600104	上汽集团	28,000	979,720.00	2.91
10	603659	璞泰来	15,000	958,350.00	2.85

#### 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	1,735,965.00	5.16
	其中：政策性金融债	1,735,965.00	5.16
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	1,735,965.00	5.16

#### 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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	11,500	1,154,370.00	3.43
2	018002	国开 1302	5,730	581,595.00	1.73
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 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

1. 本基金所持有的浙江华友钴业股份有限公司 2017 年 4 月 15 日公告显示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，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；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；公司董事会将依法收回王云先生本次交易差价金额所得。

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。

2. 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）。宁波杉杉股份有限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。

宁波杉杉股份有限公司对 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，宁波证监局决定对宁波杉杉股份有限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。

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）

杉杉控股有限提供给杉杉股份的关联方名单不完整、不准确。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。

杉杉控股有限公司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，决定对杉杉股份公司采取责令改正的监管措施，公司应在收到本决定之日起 30 日内向宁波证监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。

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。

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	409,319.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,081.34
5	应收申购款	34,302.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	49,286.00
8	其他	-
9	合计	519,988.57

### 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。

转型前：

### 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	25,717,653.30	69.41
	其中：股票	25,717,653.30	69.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,877,726.20	18.56
	其中：债券	6,877,726.20	18.56
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,836,027.02	10.35
8	其他资产	620,143.15	1.67
9	合计	37,051,549.67	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	-	-
C	制造业	25,147,453.30	74.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	570,200.00	1.68
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	-	-
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	25,717,653.30	75.79

### 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	300124	汇川技术	57,499	1,908,966.80	5.63
2	603799	华友钴业	16,000	1,477,440.00	4.35
3	002466	天齐锂业	28,000	1,389,920.00	4.10
4	600066	宇通客车	65,600	1,378,256.00	4.06
5	002050	三花智控	73,100	1,300,449.00	3.83
6	600885	宏发股份	39,600	1,199,484.00	3.53
7	600884	杉杉股份	54,800	1,159,568.00	3.42
8	002179	中航光电	28,000	1,094,520.00	3.23
9	600104	上汽集团	23,000	826,390.00	2.44
10	600563	法拉电子	16,400	766,044.00	2.26

### 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	5,439,625.20	16.03
	其中：政策性金融债	5,439,625.20	16.03
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）	1,438,101.00	4.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,877,726.20	20.27



**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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开 1302	53,730	5,439,625.20	16.03
2	113009	广汽转债	4,000	414,280.00	1.22
3	113014	林洋转债	3,800	341,886.00	1.01
4	110041	蒙电转债	3,000	286,050.00	0.84
5	132013	17 宝武 EB	2,500	253,250.00	0.75

**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。

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	409,319.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	158,859.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	51,964.50
8	其他	-
9	合计	620,143.15

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113009	广汽转债	414,280.00	1.22
2	113014	林洋转债	341,886.00	1.01

### 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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2018年6月21日）基金份额总额	25,914,828.24
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	297,421.52
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	729,886.22
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	25,482,363.54

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	26,132,062.53
报告期期间基金总申购份额	814,615.73
减：报告期期间基金总赎回份额	1,031,850.02
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	25,914,828.24

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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

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。

## § 9 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 一、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方新能源汽车主题混合型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

### 10.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 10.3 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](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理有限责任公司  
2018 年 7 月 19 日