

---

# 东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：二〇一九年三月二十八日

## § 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 2019 年 3 月 26 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。

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金转型有关事项的议案》，变更注册后的《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同金》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。

本报告期自 2018 年 6 月 21 日（基金合同生效日）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（转型后）

基金简称	东方新能源汽车主题混合
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	2018 年 6 月 21 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	28,875,988.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

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	25,914,828.24 份
基金合同存续期	2018 年 6 月 20 日

注：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 日转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金，基金最后运作日为 2018 年 6 月 20 日。

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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。

### 2.2 基金产品说明（转型前）

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。

### 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	<a href="http://www.orient-fund.com">http://www.orient-fund.com</a> 或 <a href="http://www.df5888.com">http://www.df5888.com</a>
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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
本期已实现收益		-8,431,234.49
本期利润		-7,867,393.93
加权平均基金份额本期利润		-0.2927
本期基金份额净值增长率		-22.21%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	
期末可供分配基金份额利润		0.0186
期末基金资产净值		29,412,358.08
期末基金份额净值		1.0186

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未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未未分配利润（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。

④本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日生效，无可比期间数据，本报告实际报告期为 2018 年 6 月 21 日至 2018 年 12 月 31 日。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-30,734.41	7,541,685.67	-8,688,986.28
本期利润	-1,746,617.43	7,800,839.83	-9,886,170.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0276	0.0458	-0.7648
本期基金份额净值增长率	-6.01%	-3.99%	-21.17%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 6 月 20 日	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3141	0.3932	0.9347
期末基金资产净值	33,932,903.57	190,434,417.60	23,473,108.82
期末基金份额净值	1.3094	1.3932	1.9347

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。

④本基金于 2018 年 6 月 21 日转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金，本报告实际报告期为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日。

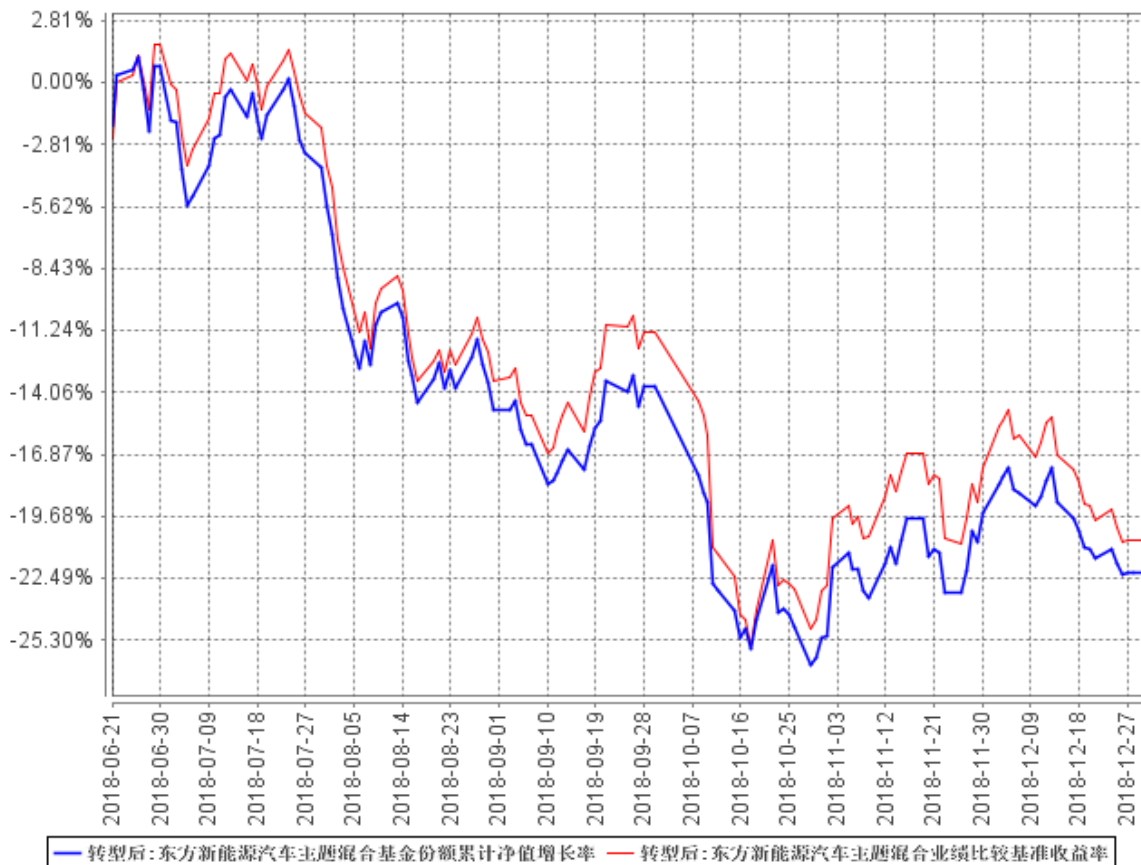
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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	-9.77%	1.52%	-10.66%	1.68%	0.89%	-0.16%
过去六个月	-22.80%	1.39%	-22.08%	1.48%	-0.72%	-0.09%
过去一年	-22.21%	1.42%	-20.75%	1.50%	-1.46%	-0.08%
过去三年	-22.21%	1.42%	-20.75%	1.50%	-1.46%	-0.08%
过去五年	-22.21%	1.42%	-20.75%	1.50%	-1.46%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-22.21%	1.42%	-20.75%	1.50%	-1.46%	-0.08%

### 3.2.2 自基金转型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

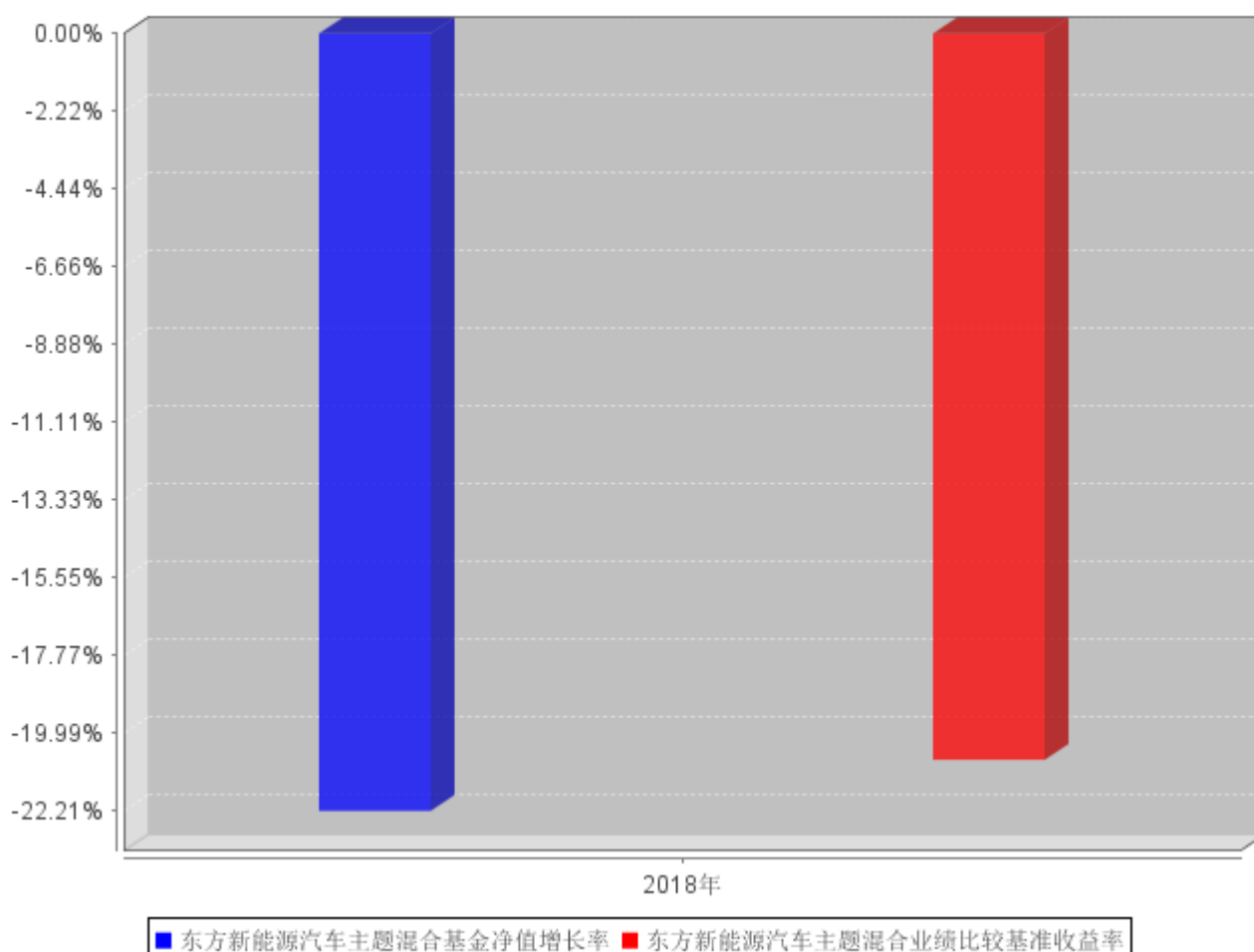
东方新能源汽车主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2018 年 6 月 21 日转型，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

### 3.2.3 自基金转型以来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

东方新能源汽车主题混合自基金合同生效以来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



注：自基金转型以来未满五年。基金转型当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

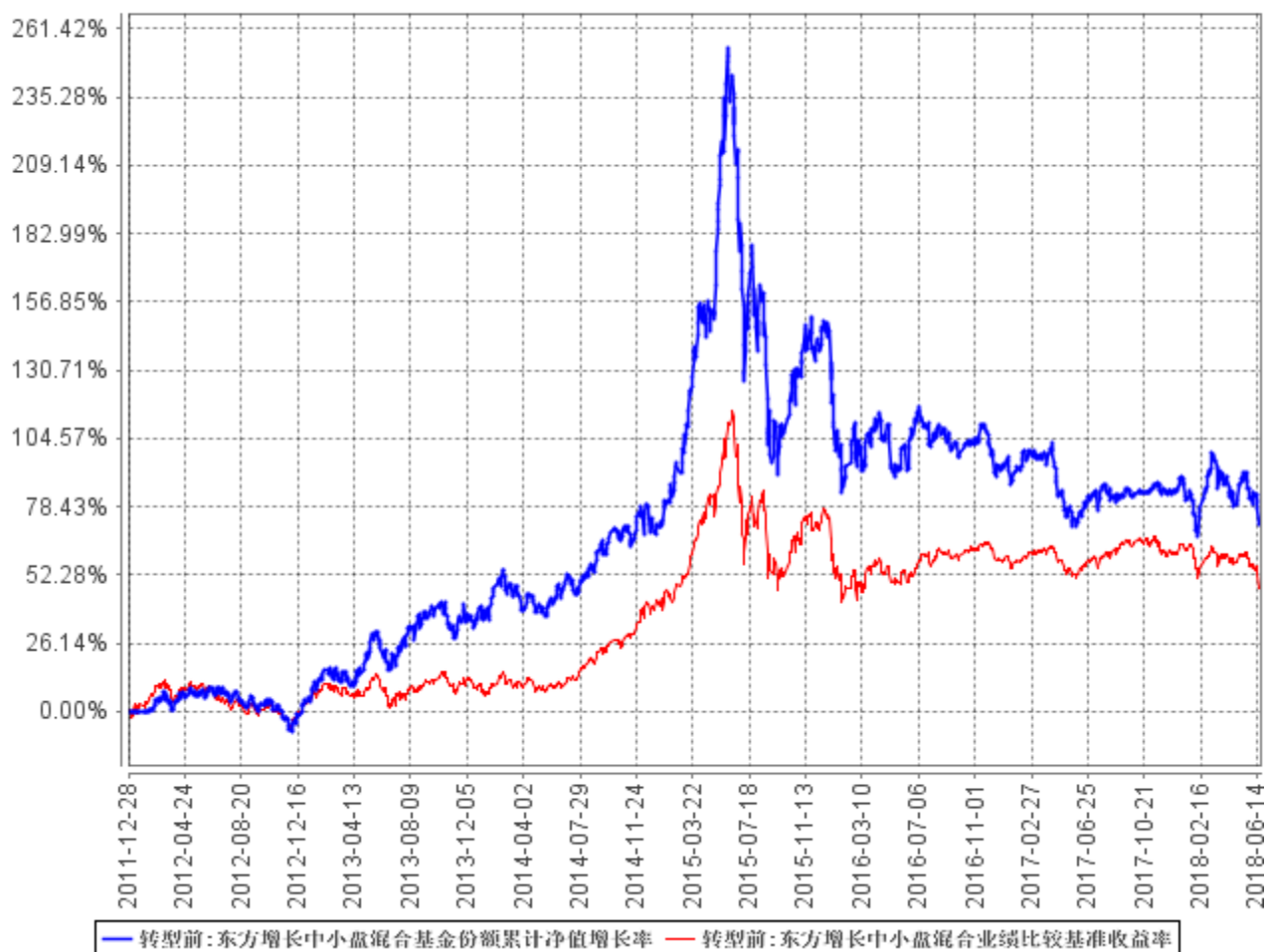
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一年	-6.01%	1.26%	-8.07%	0.79%	2.06%	0.47%
过去三年	-28.86%	1.22%	-14.79%	0.84%	-14.07%	0.38%
过去五年	24.84%	1.52%	34.37%	1.06%	-9.53%	0.46%
自基金合同生效起至今	74.59%	1.39%	48.24%	1.01%	26.35%	0.38%



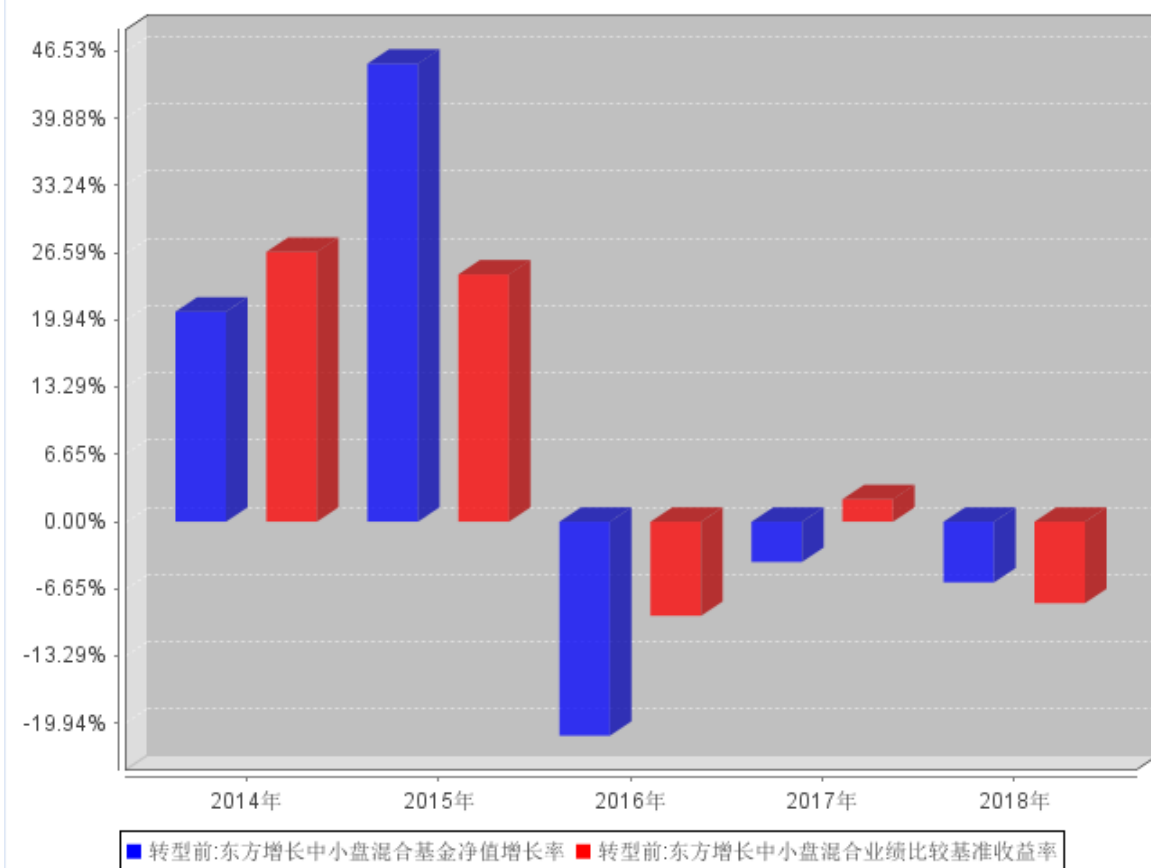
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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趋势对比图



### 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

转型前

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
2018	-	-	-	-	
2017	4.6000	1,431,625,127.56	1,502,921.52	1,433,128,049.08	
2016	-	-	-	-	
合计	4.6000	1,431,625,127.56	1,502,921.52	1,433,128,049.08	

转型后

本基金自合同生效日（2018年6月21日）至报告期截止日（2018年12月31日）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2018年12月31日，本公司注册资本3亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币19200万元，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8100万元，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2700万元，占公司注册资本的9%。截止2018年12月31日，本公司管理40只开放式证券投资基金——东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方大健康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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新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、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题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、东方盛世灵活配置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、东方稳健回报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、东方新价值混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题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、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放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、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
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、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
薛子徽 (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（自 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	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、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置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

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

2018 年市场内外环境复杂。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 年的情况相反，由于去杠杆和贸易战，这几项均面临较大挑战，尤其是地产销售和基建都比 2017 年减速，对经济的支撑作用会消退。货币政策方面，国内又面临货币向信用传导不畅的问题。

在企业微观层面，从 2016 年 2 季度开始的 ROE 上升的韧性还保持着惯性，究其原因，一方面，

行业集中度提升和产业结构优化带来的龙头效应推动整体净利润率抬升，这是最重要的原因，另一方面，资产周转率也有所提升。但是后续随着宏观环境的影响，ROE 下行会滞后体现出来，只有增长质量和确定性高、持续性强的品种才能抵抗市场的风险。

2018 年 1 季度，市场呈现分化较大的特点。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。

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。基于此，本季度基金操作策略上，一方面总体维持了较低的仓位水平，另一方面减持了高弹性标的，增持了竞争优势突出、盈利能力及质量优异的稳健标的。此外，我们认为风险偏好很难很快形成逆转除非有强烈的外部原因，对经济前景的悲观预期目前还没有完全反应在上市公司盈利预测上。

3 季度市场表现印证了我们的观点。权重代表上证 50 和沪深 300 表现略强，中小市值的代表中小板指和创业板指则表现较弱。分行业看，银行、非银、采掘、钢铁等蓝筹板块取得正收益，而其他行业则都出现不同程度的下跌，其中前期表现较强的消费类行业如家用电器、生物医药等跌幅最为突出。新能源汽车板块由于中报业绩普遍不佳，叠加补贴退坡预期，板块 3 季度大幅调整。本基金上进行了减仓操作。

2018 年 4 季度，市场再度下跌，沪深 300 跌幅达到了 12.45%。中小板指跌幅最大，季度跌幅 18.22%。策略方面，我们继续坚持了优质资产作为主要投资方向的策略。由于补贴退出的过程中行业竞争加剧，龙头集中度的提升将会持续，所以精选了具备如下特点的公司作为主要投资方向：1) 竞争优势突出：主业为各自领域国内乃至全球龙头，具有技术及成本领先优势，产品进入了国内乃至全球一线车企供应链；2) 盈利能力及质量在行业中较强；3) 公司治理完善。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年 1 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-6.01%，业绩比较基准收益率为-8.07%，高于业绩比较基准 2.06%。2018 年 6 月 21 日起至 2018 年 12 月 31 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-22.21%，业绩比较基准收益率为-20.75%，低于业绩比较基准 1.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年市场担心的悬而未决的问题，比如经济增长新动力在哪，转型升级之路是否顺利，制

度改革的决心和力度如何，投资者信心、企业信心如何恢复，这一系列问题的答案在民企座谈会、减税降费、资本市场改革和社会融资数据出现企稳迹象后，逐步开始被市场认识和认可。

经过 2018 年的单边下行，2019 年的市场会呈现机会多、波动大的特点。市场具体的走势需要衡量分子和分母的赛跑，一方面关注优质资产基本面的抗波动能力和长期竞争力，经过 2018 年的洗礼，真正有核心竞争力的企业会体现出自己的抗风险能力，优势企业与劣势企业之间的分化不断扩大；另一方面关注政策托底带来的分母端的逐渐变化。

操作策略上，本基金将坚持长期优质标的的核心持仓。新能源汽车产业尽管今年因为补贴退坡承受了很大压力，但行业正在发生很大的变化，产业由政策主导开始向产品主导过渡。过去几年，大力的补贴、政策的引导、各类企业的试错培育出了占全球销量一半以上的市场。未来行业会加速走向市场化，有爆款潜力的车型明显增多，这是过去几年产业链成本快速下降、技术大幅进步、车型经过前期设计到了投放期的综合结果。接下来，供应链技术迭代的步伐不会减速，智能化网联化的应用优势将逐渐凸显，自主品牌优质车型还将大大丰富，再加上合资和外资车企的推动，新能源车消费端的竞争力将进一步大幅增强。产业链中目前动力电池企业、核心材料企业、核心零部件商都已经开始具备全球竞争力，成功实现海外配套，弹性将逐步凸显。未来我们的投资方向将紧紧围绕消费升级、全球供应这一主线，投资于具备全球竞争力的产业链龙头，投资于优质资产。

#### 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，开展定期和实时监察，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，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告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察，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，进一步加强基金投资运作的监察力度，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”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、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；因特殊情况，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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **4.9 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，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拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

## § 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东方新能源汽车主题混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告（转型后）

### 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[2019]第 ZB30041 号

### 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	东方新能源汽车主题混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了东方新能源汽车主题混合型证券投资基金（以下简称东方新能源汽车基金）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日的利润表、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，公允反映了东方新能源汽车基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日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，我们独立于东方新能源汽车基金，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>东方新能源汽车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新能源汽车基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），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</p>

	<p>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,就可能对东方新能源汽车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新能源汽车基金不能持续经营。</p> <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。</p> <p>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。</p>
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   高慧丽
会计师事务所的地址	上海市南京东路 61 号 4 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

## § 6 审计报告（转型前）

### 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[2019]第 ZB30040 号

### 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	<p>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 2018 年 6 月 20 日的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日的利润表、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，公允反映了东方增长中小盘基金 2018 年 6 月 20 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日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>
其他信息	<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>
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（如适用），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</p>

	<p>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> <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。</p> <p>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。</p>
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 高慧丽
会计师事务所的地址	上海市南京东路 61 号 4 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表（转型后）

## 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：东方新能源汽车主题混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	8,358,449.35
结算备付金	287,968.92
存出保证金	115,345.33
交易性金融资产	20,999,015.86
其中：股票投资	18,536,562.36
基金投资	-
债券投资	2,462,453.50
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	68,511.50
应收股利	-
应收申购款	20,591.71
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	29,849,882.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>	
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	28,592.87
应付管理人报酬	37,612.24
应付托管费	6,268.71
应付销售服务费	-
应付交易费用	145,281.74
应交税费	5.98
应付利息	-



应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	219,763.05
负债合计	437,524.59
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	28,875,988.17
未分配利润	536,369.91
所有者权益合计	29,412,358.08
负债和所有者权益总计	29,849,882.67

注：①报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0186 元，基金份额总额 28,875,988.17 份。

②本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日生效，无可比期间数据，本报告实际报告期为 2018 年 6 月 21 日至 2018 年 12 月 31 日，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：东方新能源汽车主题混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-6,997,701.24
1. 利息收入	66,241.20
其中：存款利息收入	22,994.72
债券利息收入	43,246.48
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-7,652,600.94
其中：股票投资收益	-7,618,499.42
基金投资收益	-
债券投资收益	-154,755.10
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	120,653.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	563,840.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	24,817.94
<b>减：二、费用</b>	869,692.69
1. 管理人报酬	239,330.26



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。本基金于 2018 年 6 月 21 日转型为“东方新能源汽车主题混合型证券投资基金”。基金托管人及基金登记机构保持不变，基金代码沿用原基金代码“400015”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，东方新能源汽车主题混合型证券投资基金的投资范围为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（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、证券公司短期公司债券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券、可分离交易可转债等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、权证以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相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于与新能源汽车主题相关的行业及上市公司的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

## 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颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（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 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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》、[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《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣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、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、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。

4、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。

5、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。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、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、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
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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期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
	2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	239,330.26
其中：支付销售机构的客户维护费	58,130.51

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，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 5 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
	2018 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,888.41

注：①计提标准：本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

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，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托管费划款指令，基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日顺延。

#### 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

本基金本报告期末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
	2018 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	11,271,108.18
期初持有的基金份额	-
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	
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	39.03%

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，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 2018年6月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	8,358,449.35	19,244.52

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2018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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

##### 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 2018 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 2018 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**

截至本年度报告报出日，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。

## § 7 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表（转型前）

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：2018 年 6 月 20 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 20 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,756,642.45	13,170,609.23
结算备付金	79,384.57	716,704.97
存出保证金	409,319.09	189,957.49
交易性金融资产	32,595,379.50	269,146,537.61
其中：股票投资	25,717,653.30	118,601,115.81
基金投资	-	-
债券投资	6,877,726.20	150,545,421.80
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
应收利息	158,859.56	2,689,372.72
应收股利	-	-
应收申购款	-	34,310.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	51,964.50	-
资产总计	37,051,549.67	494,358,906.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 6 月 20 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	2,851,503.20	-
应付赎回款	14,689.37	300,141,661.63
应付管理人报酬	28,950.45	722,742.20
应付托管费	4,825.08	120,457.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	63,676.74	1,593,996.85
应交税费	18.11	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	154,983.15	1,345,631.20
负债合计	3,118,646.10	303,924,488.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	25,914,828.24	136,688,107.73
未分配利润	8,018,075.33	53,746,309.87
所有者权益合计	33,932,903.57	190,434,417.60
负债和所有者权益总计	37,051,549.67	494,358,906.49

注：①报告截止日 2018 年 6 月 20 日，基金份额净值 1.3094 元，基金份额总额 25,914,828.24 份。

②因本基金于 2018 年 6 月 21 日转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金，故本报告实际报告期为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日，下同。

## 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	569,535.93	13,892,894.52
1. 利息收入	405,830.34	4,896,207.13
其中：存款利息收入	34,524.74	652,132.70
债券利息收入	323,450.66	1,533,167.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	47,854.94	2,710,906.90
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,680,544.44	3,577,167.76
其中：股票投资收益	1,738,289.39	3,693,313.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-184,044.28	-251,219.60
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	126,299.33	135,073.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,715,883.02	259,154.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	199,044.17	5,160,365.47

列)		
<b>减：二、费用</b>	2,316,153.36	6,092,054.69
1. 管理人报酬	623,942.73	3,861,342.62
2. 托管费	103,990.46	643,557.17
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,521,162.24	1,449,754.90
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	30.86	-
7. 其他费用	67,027.07	137,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-1,746,617.43	7,800,839.83
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-1,746,617.43	7,800,839.83

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 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）	136,688,107.73	53,746,309.87	190,434,417.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,746,617.43	-1,746,617.43
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）	-110,773,279.49	-43,981,617.11	-154,754,896.60
其中：1. 基金申购款	3,712,877.10	1,589,563.18	5,302,440.28
2. 基金赎回款	-114,486,156.59	-45,571,180.29	-160,057,336.88
五、期末所有者权益（基金净值）	25,914,828.24	8,018,075.33	33,932,903.57
项目	上年度可比期间 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（本期利润）	-	7,800,839.83	7,800,839.83
三、本期基金份额交易产生	124,555,361.96	1,467,733,156.07	1,592,288,518.03

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

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 _____	_____ 王丹丹 _____
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颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（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 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 2018 年 6 月 20 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

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》、[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《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣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、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、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。

4、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。

5、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。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、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、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
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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间，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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日



当期发生的基金应支付的管理费	623,942.73	3,861,342.62
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	78,439.19	569,619.34

注：①计提标准：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.5\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	103,990.46	643,557.17

注：①计提标准：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

本基金本报告期及上年度可比期间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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	11,271,108.18	-
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	11,271,108.18
期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.49%	8.25%

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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 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	3,756,642.45	21,206.10	13,170,609.23	558,610.91

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2018 年 6 月 20 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票**

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
300198	纳川股份	2018年2月2日	重大事项	5.99	2018年8月2日	5.38	52,200	345,672.87	312,678.00	

**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 2018 年 6 月 20 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 2018 年 6 月 20 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**

截至本年度报告报出日，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（转型后）

### 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	18,536,562.36	62.10
	其中：股票	18,536,562.36	62.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,462,453.50	8.25
	其中：债券	2,462,453.50	8.25
	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	8,646,418.27	28.97
8	其他各项资产	204,448.54	0.68
9	合计	29,849,882.67	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	302,500.00	1.03
C	制造业	17,044,362.36	57.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	241,500.00	0.82
E	建筑业	456,000.00	1.55
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	-	-
K	房地产业	492,200.00	1.67
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	-	-

0	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	18,536,562.36	63.02

### 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	600104	上汽集团	60,000	1,600,200.00	5.44
2	600066	宇通客车	114,000	1,350,900.00	4.59
3	300124	汇川技术	65,099	1,311,093.86	4.46
4	600885	宏发股份	56,000	1,263,360.00	4.30
5	002594	比亚迪	24,000	1,224,000.00	4.16
6	300073	当升科技	43,000	1,190,670.00	4.05
7	300014	亿纬锂能	66,600	1,046,952.00	3.56
8	600563	法拉电子	23,000	969,220.00	3.30
9	300568	星源材质	43,000	954,170.00	3.24
10	300450	先导智能	30,000	868,200.00	2.95

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	7,376,054.00	25.08
2	002594	比亚迪	7,254,722.58	24.67
3	002460	赣锋锂业	6,157,206.72	20.93
4	603799	华友钴业	5,962,794.00	20.27
5	300618	寒锐钴业	5,489,101.50	18.66
6	300750	宁德时代	4,150,624.00	14.11
7	600104	上汽集团	3,968,754.20	13.49
8	300073	当升科技	3,929,317.00	13.36
9	002179	中航光电	3,839,268.62	13.05
10	300568	星源材质	3,205,093.00	10.90

11	300037	新宙邦	3,202,085.11	10.89
12	300450	先导智能	3,067,223.00	10.43
13	600066	宇通客车	2,830,872.00	9.62
14	603659	璞泰来	2,608,035.00	8.87
15	600525	长园集团	2,581,959.00	8.78
16	300124	汇川技术	2,559,367.00	8.70
17	600900	长江电力	2,441,639.06	8.30
18	002074	国轩高科	2,433,299.00	8.27
19	002050	三花智控	2,430,248.89	8.26
20	600884	杉杉股份	2,302,141.00	7.83
21	300207	欣旺达	2,237,012.00	7.61
22	002341	新纶科技	2,128,631.92	7.24
23	002709	天赐材料	2,007,540.00	6.83
24	000002	万科A	2,004,289.00	6.81
25	600030	中信证券	1,814,709.00	6.17
26	002340	格林美	1,748,681.00	5.95
27	600885	宏发股份	1,728,535.00	5.88
28	300014	亿纬锂能	1,605,691.09	5.46
29	600674	川投能源	1,512,643.00	5.14
30	601877	正泰电器	1,469,042.12	4.99
31	601006	大秦铁路	1,384,400.00	4.71
32	300457	赢合科技	1,323,965.00	4.50
33	002812	恩捷股份	1,300,690.00	4.42
34	600886	国投电力	1,227,483.00	4.17
35	600699	均胜电子	1,202,622.00	4.09
36	600563	法拉电子	1,174,159.02	3.99
37	601398	工商银行	1,083,766.00	3.68
38	600438	通威股份	1,078,362.49	3.67
39	603305	旭升股份	994,280.00	3.38
40	002008	大族激光	991,604.56	3.37
41	601799	星宇股份	963,492.00	3.28
42	300203	聚光科技	961,874.00	3.27
43	002415	海康威视	958,239.28	3.26
44	000625	长安汽车	949,010.00	3.23
45	603993	洛阳钼业	915,000.00	3.11
46	600114	东睦股份	883,972.40	3.01

47	000807	云铝股份	849,500.00	2.89
48	600340	华夏幸福	844,803.00	2.87
49	600711	盛屯矿业	818,264.99	2.78
50	002851	麦格米特	807,237.47	2.74
51	002366	台海核电	802,705.00	2.73
52	601166	兴业银行	776,045.00	2.64
53	300070	碧水源	768,133.00	2.61
54	601233	桐昆股份	760,696.00	2.59
55	300724	捷佳伟创	754,000.00	2.56
56	002027	分众传媒	752,085.40	2.56
57	601186	中国铁建	707,815.00	2.41
58	300409	道氏技术	702,929.00	2.39
59	601009	南京银行	688,311.50	2.34
60	601668	中国建筑	687,200.00	2.34
61	002518	科士达	662,417.80	2.25
62	300496	中科创达	641,861.00	2.18
63	002741	光华科技	627,215.76	2.13
64	601111	中国国航	614,400.00	2.09

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	8,222,156.15	27.95
2	603799	华友钴业	6,936,341.36	23.58
3	002594	比亚迪	6,639,191.29	22.57
4	002460	赣锋锂业	5,907,666.38	20.09
5	300618	寒锐钴业	5,366,211.00	18.24
6	002179	中航光电	4,833,535.95	16.43
7	300750	宁德时代	4,269,940.32	14.52
8	002050	三花智控	3,482,973.16	11.84
9	300073	当升科技	3,428,627.00	11.66
10	600104	上汽集团	3,148,505.79	10.70
11	002074	国轩高科	3,071,133.60	10.44

12	600884	杉杉股份	3,003,990.00	10.21
13	300037	新宙邦	2,980,680.73	10.13
14	600525	长园集团	2,865,121.00	9.74
15	600900	长江电力	2,481,504.00	8.44
16	300568	星源材质	2,442,570.00	8.30
17	300124	汇川技术	2,436,930.40	8.29
18	300450	先导智能	2,434,893.43	8.28
19	603659	璞泰来	2,243,680.28	7.63
20	300207	欣旺达	2,089,818.08	7.11
21	600066	宇通客车	2,078,949.00	7.07
22	000002	万科A	1,934,275.00	6.58
23	600699	均胜电子	1,908,414.00	6.49
24	002709	天赐材料	1,827,118.23	6.21
25	600030	中信证券	1,748,355.00	5.94
26	601877	正泰电器	1,684,531.30	5.73
27	002340	格林美	1,608,680.00	5.47
28	600674	川投能源	1,553,641.00	5.28
29	002341	新纶科技	1,489,566.65	5.06
30	601006	大秦铁路	1,433,333.98	4.87
31	600885	宏发股份	1,314,069.88	4.47
32	601799	星宇股份	1,238,807.20	4.21
33	002812	恩捷股份	1,219,428.00	4.15
34	600114	东睦股份	1,139,374.00	3.87
35	601398	工商银行	1,071,800.00	3.64
36	300014	亿纬锂能	1,035,804.00	3.52
37	600886	国投电力	1,023,400.00	3.48
38	300203	聚光科技	1,013,197.00	3.44
39	600438	通威股份	1,006,532.00	3.42
40	002126	银轮股份	985,736.00	3.35
41	600563	法拉电子	947,141.00	3.22
42	603026	石大胜华	941,660.00	3.20
43	002415	海康威视	931,327.00	3.17
44	000625	长安汽车	877,239.34	2.98
45	000807	云铝股份	864,400.00	2.94
46	300457	赢合科技	831,176.00	2.83
47	600711	盛屯矿业	821,821.00	2.79
48	300724	捷佳伟创	819,306.00	2.79
49	603993	洛阳钼业	778,160.00	2.65



50	601166	兴业银行	775,100.00	2.64
51	300070	碧水源	752,337.00	2.56
52	002027	分众传媒	751,800.00	2.56
53	601233	桐昆股份	744,885.20	2.53
54	002851	麦格米特	743,818.50	2.53
55	601186	中国铁建	734,178.00	2.50
56	300409	道氏技术	698,462.40	2.37
57	002008	大族激光	691,944.00	2.35
58	000651	格力电器	663,000.00	2.25
59	601009	南京银行	661,400.00	2.25
60	002407	多氟多	661,033.00	2.25
61	002518	科士达	660,238.60	2.24
62	600036	招商银行	650,501.00	2.21
63	600967	内蒙一机	634,705.00	2.16
64	002741	光华科技	631,800.24	2.15
65	601111	中国国航	623,910.00	2.12
66	300496	中科创达	622,305.00	2.12
67	000895	双汇发展	620,480.00	2.11
68	603305	旭升股份	616,904.00	2.10
69	600340	华夏幸福	602,781.00	2.05

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	150,785,480.85
卖出股票收入（成交）总额	150,813,216.75

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	1,728,346.50	5.88
	其中：政策性金融债	1,728,346.50	5.88
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）	734,107.00	2.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,462,453.50	8.37

### 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018005	国开 1701	11,500	1,155,060.00	3.93
2	123009	星源转债	6,000	597,360.00	2.03
3	018002	国开 1302	5,730	573,286.50	1.95
4	128027	崇达转债	1,300	136,747.00	0.46
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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有的星源材质（300568）于 2018 年 11 月 9 日收到深交所创业板公司管理部出具的《关于对深圳市星源材质科技股份有限公司、原独立董事吴锋的监管函》（创业板监管函[2018]第 130 号）。该监管函主要内容为：

1、公司自查发现，时任独立董事吴锋自 2017 年 12 月起担任客户天津力神电池股份有限公司的独立董事。自 2017 年 12 月起，公司及子公司与天津力神及其子公司之间发生的交易构成关联交易。2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日，公司及子公司向天津力神及其子公司销售锂离子电池隔膜产品的交易金额（不含增值税）为 2917.40 万元，但公司迟至 2018 年 10 月 12 日才召开第四届董事会第十一次会议审议了《关于确认和预计公司与天津力神日常关联交易情况的议案》并进行了信息披露。吴锋在担任天津力神独立董事后未及时告知公司的行为，违反了《创业板股票上市规则（2014 年修订）》以及《创业板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》的相关规定。

公司整改情况：公司在收到监管函后，立即将监管函转达至公司原独立董事吴锋，并组织公司现任董事、监事、高级管理人员及证券部相关人员就监管函涉及事项进行反省和总结。公司将吸取教训，加强对相关法律、法规和规则的学习，进一步加强信息披露工作管理，规范公司治理，杜绝此类问题再次发生，并于 2018 年 11 月 23 日向深圳证券交易所报送了《天风证券股份有限公司关于深圳市星源材质科技股份有限公司关联交易情况的专项现场检查报告》。

2、公司于 2018 年 3 月 23 日发布《关于控股股东、实际控制人进行股票质押式回购交易的公告》，称公司于 3 月 23 日接到控股股东、实际控制人陈秀峰的通知，其于 2018 年 3 月 6 日办理了 1770 万股公司股票质押，质押数量占公司总股本的 9.22%。该事项未及时通知并配合上市公司对上述质押业务予以披露，违反了《深圳证券交易所创业板股票上市规则》的相关规定。

公司整改情况：公司在收到监管函后，立即将监管函转达至控股股东、实际控制人陈秀峰，并组织公司现任董事、监事、高级管理人员及证券部相关人员就监管函涉及事项进行反省和总结。公司将吸取教训，加强对相关法律、法规和规则的学习，进一步加强信息披露工作管理，规范公司治理，杜绝此类问题再次发生。自收到监管函并进行充分学习、整改后，公司密切关注公司控股股东、实际控制人的股权质押、解除质押相关事宜，并对后续股权质押、解除质押相关事宜进行及时、充分的披露。

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。

本基金投资星源材质主要基于以下原因：公司是国内早期进入隔膜领域的企业之一，也是第一家向国外出口干法隔膜的企业。公司在干法领域有着长达十几年之久的研发生产经验，技术积累深厚。渠道方面，公司干法产品在国际市场受到三星、LG 化学、日产等一线锂电厂商的青睐，产品订单数量可观。公司干法产品从生产环节到销售环节均占据着绝对优势，干法龙头地位稳固。

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	115,345.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,511.50
5	应收申购款	20,591.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	204,448.54

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123009	星源转债	597,360.00	2.03

2	128027	崇达转债	136,747.00	0.46
---	--------	------	------------	------

### 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。

## § 8 投资组合报告（转型前）

### 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	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

### 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	-	-
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

### 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	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

### 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	002466	天齐锂业	23,143,937.42	12.15
2	002460	赣锋锂业	18,665,080.28	9.80
3	603799	华友钴业	18,288,523.80	9.60
4	002594	比亚迪	12,635,852.88	6.64
5	600066	宇通客车	12,251,911.31	6.43
6	300124	汇川技术	11,529,306.08	6.05
7	002074	国轩高科	8,908,665.10	4.68
8	002179	中航光电	8,824,397.24	4.63
9	601668	中国建筑	8,108,153.00	4.26
10	002600	领益智造	7,640,887.00	4.01
11	002050	三花智控	7,538,175.70	3.96

12	600525	长园集团	7,328,981.00	3.85
13	002340	格林美	7,323,041.00	3.85
14	603993	洛阳钼业	6,802,118.00	3.57
15	300073	当升科技	6,718,754.00	3.53
16	600699	均胜电子	6,686,022.00	3.51
17	600885	宏发股份	6,417,973.00	3.37
18	300450	先导智能	6,280,249.13	3.30
19	300618	寒锐钴业	6,063,393.64	3.18
20	002407	多氟多	5,961,543.76	3.13
21	002176	江特电机	5,597,915.20	2.94
22	600104	上汽集团	5,560,055.38	2.92
23	600884	杉杉股份	4,585,634.95	2.41
24	000792	盐湖股份	4,496,001.00	2.36
25	000970	中科三环	4,061,453.24	2.13
26	600549	厦门钨业	4,032,357.32	2.12
27	601601	中国太保	4,012,946.58	2.11
28	300409	道氏技术	4,006,417.00	2.10
29	002405	四维图新	3,807,136.50	2.00

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	002466	天齐锂业	23,452,002.22	12.32
2	603799	华友钴业	22,216,965.16	11.67
3	002460	赣锋锂业	21,741,503.57	11.42
4	002594	比亚迪	15,823,490.99	8.31
5	600066	宇通客车	13,779,244.73	7.24
6	300124	汇川技术	12,757,346.63	6.70
7	002179	中航光电	10,402,393.06	5.46
8	002340	格林美	8,958,176.20	4.70
9	002074	国轩高科	8,917,808.36	4.68
10	603993	洛阳钼业	8,758,998.38	4.60
11	601668	中国建筑	8,326,648.92	4.37



12	002600	领益智造	7,714,292.00	4.05
13	600885	宏发股份	7,541,784.60	3.96
14	600525	长园集团	7,371,621.39	3.87
15	002050	三花智控	7,207,590.06	3.78
16	002176	江特电机	7,118,956.48	3.74
17	300450	先导智能	6,910,075.19	3.63
18	300618	寒锐钴业	6,893,824.00	3.62
19	002407	多氟多	6,799,172.61	3.57
20	300073	当升科技	6,453,058.20	3.39
21	601288	农业银行	6,272,566.42	3.29
22	600104	上汽集团	6,209,710.88	3.26
23	600884	杉杉股份	5,784,194.04	3.04
24	600699	均胜电子	5,747,690.13	3.02
25	002709	天赐材料	5,437,215.22	2.86
26	300409	道氏技术	5,373,175.00	2.82
27	600549	厦门钨业	5,346,649.00	2.81
28	000970	中科三环	4,891,425.00	2.57
29	000792	盐湖股份	4,880,303.00	2.56
30	000630	铜陵有色	4,873,290.00	2.56
31	300014	亿纬锂能	4,350,533.30	2.28
32	600028	中国石化	4,224,150.00	2.22
33	002497	雅化集团	4,165,087.27	2.19
34	601601	中国太保	4,139,918.89	2.17
35	300207	欣旺达	4,103,658.00	2.15
36	002056	横店东磁	3,931,169.70	2.06
37	002405	四维图新	3,904,516.01	2.05
38	600741	华域汽车	3,823,017.58	2.01
39	002341	新纶科技	3,808,460.17	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	442,619,633.20
卖出股票收入（成交）总额	535,130,298.96

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	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

### 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	公允价值	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

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	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

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

#### 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（转型后）

### 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
4,954	5,828.82	11,271,108.18	39.03%	17,604,879.99	60.97%

### 9.2 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	3,159.78	0.0100%

### 9.3 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

## § 9 基金份额持有人信息（转型前）

### 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
3,885	6,670.48	11,271,108.18	43.49%	14,643,720.06	56.51%

### 9.2 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	3,159.78	0.01%

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(转型后)**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	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	7,349,958.59
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,388,798.66
本报告期期末基金份额总额	28,875,988.17

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。

**§ 10 开放式基金份额变动(转型前)**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	335,865,199.76
本报告期期初基金份额总额	136,688,107.73
本报告期期间基金总申购份额	3,712,877.10
减:本报告期期间基金总赎回份额	114,486,156.59
本报告期期末基金份额总额	25,914,828.24

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

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金转型有关事项的议案》，变更注册后的《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》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。

### 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

报告期内，公司存在一起劳动争议，截至报告期末已审理终结。

本报告期，无涉及基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金从 2018 年 6 月 21 日起正式转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金。转型后基金的投资目标、投资策略和业绩比较基准等按照《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》相关约定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

### 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 55,000.00 元；截至 2018 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供不满一年的审计服务。

### 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（转型后）

### 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	301,442,440.00	100.00%	277,141.54	100.00%	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-

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资力雄厚，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，本基金交易单元未发生变更。

### 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比 例		券回购 成交总额 的比例		成交总额的 比例
太平洋证券 股份有限公 司	24,414,541.91	100.00%	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有 限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

#### 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	2976,641,093.00	100.00%	897,857.76	100.00%	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有 限公司	1	-	-	-	-	-

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资力雄厚，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 1 个交易单元，为渤海证券股份有限公司上海证券交易所交易单元。

### 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	42,086,947.50	100.00%	139,000,000.00	100.00%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	-	-	-	-	-	-

## § 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（转型后）

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	20180621-20181231	11,271,108.18	-	-	11,271,108.18	39.03%
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>							

### 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（转型前）

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	20180101-20180228	108,754,214.24	-	108,754,214.24	-	-
	2	20180301-20180620	11,271,108.18	-	-	11,271,108.18	43.49%
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

2019 年 3 月 28 日