东方新兴成长混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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。

本报告期自2018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	东方新兴成长混合
基金主代码	400025
前端交易代码	400025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	119,710,711.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以稳健收益为目标,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	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整。同时,重点投资于符合本基金定义的新兴成长型股票,获得基金的长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	贺倩
	联系电话	010-66295888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816

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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-8,276,730.32	35,434,288.82	-19,232,836.22
本期利润	-26,046,653.46	43,064,864.03	-32,539,017.40
加权平均基金份额本期利润	-0.2238	0.3386	-0.2170
本期基金份额净值增长率	-14.06%	28.95%	-15.11%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0721	0.1332	-0.1479
期末基金资产净值	157,362,783.19	180,398,137.56	156,434,023.50
期末基金份额净值	1.3145	1.5296	1.1862

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)。

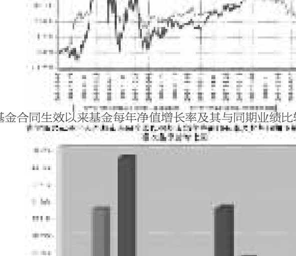
③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

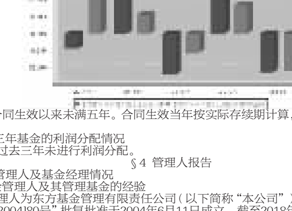
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-13.60%	1.51%	-6.41%	0.97%	-7.19%	0.54%
过去六个月	-17.45%	1.48%	-7.37%	0.89%	-10.08%	0.59%
过去一年	-14.06%	1.45%	-13.54%	0.79%	-0.52%	0.66%
过去三年	-5.93%	1.36%	-11.03%	0.71%	5.10%	0.65%
过去五年	31.45%	1.75%	22.61%	0.96%	8.84%	0.79%
自基金合同生效起至今	31.45%	1.75%	22.61%	0.96%	8.84%	0.79%

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



3.2.3 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比较



注:自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	任本基金的基金经理(助理)期限 离任日期	证券从业年限	说明
王然(女士)	本基金基金经理、权益研究部副总经理、投资决策委员会委员	2015年6月25日	-	10年	权益研究部副总经理,投资决策委员会委员,北京交通大学产业经济学硕士,10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日转型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日转型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)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日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金)基金经理、东方成长收益灵活配置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、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理,现任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、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。
曲华锋	本基金基金经理助理	2018年6月26日	-	5年	吉林大学信用经济与管理专业硕士,5年证券从业经历。2012年加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部研究员、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理助理,现任东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理助理。

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、《东方新兴成长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。

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,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

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,中国先后经历了金融去杠杆、股权质押风险暴露、中美贸易摩擦升温、民企经营状况恶化、经济增长低于预期等一系列不利因素的影响。海外市场方面,美国连续多年的加息促使经济出现见顶迹象,日欧等发达经济也出现放缓迹象并加大货币放松的预期。到2018年下半年,中国国内对于经济放缓的悲观预期愈加强烈,一系列稳经济政策出台,包括持续的降低存款准备金率、降低增值税率、提高个税起征点等刺激政策,改善企业经营的政策,但资本市场的悲观预期仍旧浓厚。

报告期内,主要宽基指数基本呈现单边下跌态势,其中上证综指全年跌幅24.6%,沪深300指数跌幅25.3%,创业板指跌幅28.6%。根据wind的数据统计,申万行业中50%的行业跌幅超过30%,其中传媒、有色金属、采掘跌幅居前,分别下跌37%、35%、34%;跌幅最小的三个行业是银行、计算机、通信,分别下跌了15%、21%、22%。从结构上看,上半年以医药为代表的消费行业表现不俗,而下半年市场出现了系统性的全面下跌,而银行在下半年表现出了明显的防御属性。

报告期内,本基金考虑到2018年面临诸多不确定性因素的状况,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。上半年以受益政策的医药和景气度较高的白酒行业作为主要配置,兼顾5G等主题机会;下半年转向防守,以中性仓位和中长期优质资产作为配置策略,控制净值的回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年1月1日起至2018年12月31日,本基金净值增长率为-14.06%,业绩比较基准收益率为-13.54%,低于业绩比较基准0.52%。

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2019年,欧美经济面临较大不确定性因素,但全球流动性释放的预期较强,同时中美贸易关系有望得到阶段性进展,缓解了市场的不安情绪。同时,国内的宽货币、宽信用的政策导向有望使经济在下半年企稳。科创板等金融供给侧改革有望进一步规范市场秩序、改善企业投融资环境,吸引外资持续流入,对市场构成了政策面的利好。诸多因素有望改善市场的悲观预期,提升风险偏好,同时经济状况和企业盈利有待进一步确认,我们认为2019年整体状况将好于2018年。从结构上看,符合国家中长期战略的领域,如生物技术、新一代信息技术、人工智能、5G、新能源等战略新兴产业经过近年来的培育,为经济结构转型升级积蓄力量,我们认为这里面蕴含的机会值得我们深入挖掘。

4.6 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)。

4.7 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,本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—东方基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,东方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对东方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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[2019]第ZB30045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	东方新兴成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
审计意见	我们审计了东方新兴成长混合型证券投资基金(以下简称东方新兴成长基金)财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018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。 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,公允反映了东方新兴成长基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。	
形成审计意见的基础	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,我们独立于东方新兴成长基金,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。	
其他信息	东方新兴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。 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。 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。 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。	
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时,基金管理人负责评估东方新兴成长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。	
注册会计师对财务报表审计的责任	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,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,就可能导致对东方新兴成长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兴成长基金不能持续经营。 (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	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

7.1 资产负债表

会计主体:东方新兴成长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	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	36,917,318.03	10,246,301.05
结算备付金	797,373.88	764,559.74
存出保证金	152,770.24	238,365.78
交易性金融资产	134,618,464.47	169,533,218.86
其中:股票投资	119,396,526.07	158,555,218.86
基金投资	-	-
债券投资	15,221,938.40	10,978,000.00
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	4,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款	87,393.94	-
应收利息	244,980.79	286,867.52
应收股利	-	-
应收申购款	13,272.76	38,924.61
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	176,831,574.11	191,108,237.56
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	18,190,457.33	8,726,658.55
应付赎回款	333,496.98	503,922.80
应付管理人报酬	207,240.03	232,467.38
应付托管费	34,539.99	38,744.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	253,677.05	657,969.02
应交税费	50.70	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	449,328.84	550,337.70
负债合计	19,468,790.92	10,710,100.00
所有者权益:		
实收基金	119,710,711.96	117,941,899.09
未分配利润	37,652,071.23	62,456,238.47
所有者权益合计	157,362,783.19	180,398,137.56
负债和所有者权益总计	176,831,574.11	191,108,237.56

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.3145元,基金份额总额119,710,711.96份。

7.2 利润表

会计主体:东方新兴成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-19,911,401.42	48,701,946.69
1.利息收入	591,181.44	729,819.97
其中:存款利息收入	142,489.10	201,757.09
债券利息收入	291,088.76	304,542.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	157,603.58	223,520.42
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,828,671.89	40,303,675.08
其中:股票投资收益	-4,747,184.25	38,301,904.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,831.97	-20,466.00
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	1,893,680.39	2,022,236.55
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-17,769,923.14	7,630,575.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	96,012.17	37,876.43
减:二、费用	6,135,252.04	5,637,082.66
1. 管理人报酬	2,635,659.83	2,557,121.32
2. 托管费	439,276.61	426,186.96
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,756,435.49	2,246,306.92
5. 利息支出	-	2,321.45
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	12.79	-
7. 其他费用	303,867.32	405,146.01
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-26,046,653.46	43,064,864.03
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-26,046,653.46	43,064,864.03

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方新兴成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	117,941,899.09	62,456,238.47	180,398,137.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,046,653.46	-26,046,653.46
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)	1,768,812.87	1,242,486.22	3,011,299.09
其中:1.基金申购款	37,648,114.77	21,170,809.76	58,818,924.53
2.基金赎回款	-35,879,301.90	-19,928,323.54	-55,807,625.44
五、期末所有者权益(基金净值)	119,710,711.96	37,652,071.23	157,362,783.19
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)	131,874,340.33	24,559,683.17	156,434,023.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,064,864.03	43,064,864.03
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)	-13,932,441.24	-5,168,308.73	-19,100,749.97
其中:1.基金申购款	18,272,147.44	7,926,973.34	26,199,120.78
2.基金赎回款	-32,204,588.68	-13,095,282.07	-45,299,870.75
五、期末所有者权益(基金净值)	117,941,899.09	62,456,238.47	180,398,137.56

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

东方新兴成长混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2014年7月15日中国证监会《关于核准东方新兴成长混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]705号)和《关于东方新兴成长混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(证券基金机构监管部部函[2014]998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《东方新兴成长混合型证券投资基金基金合同》自2014年8月11日至2014年8月29日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集274,627,922.13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[2014]第230087号"验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方新兴成长混合型证券投资基金基金合同》于2014年9月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为274,667,404.06份基金单位,其中认购资金利息折合39,481.93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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方新兴成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本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、股指期货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)。其中,债券主要包括国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券、银行存款等固定收益类品种。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。

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》、[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、直销机构
中国农业银行股份有限公司	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股票交易。

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

本报告期及上年度可比期间,本基金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1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 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	2,635,659.83	2,557,121.32
其中:支付销售机构的客户维护费	1,304,623.24	1,283,428.18

注:①计提标准:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计算,具体计算方法如下:

H=E×1.50%÷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:基金管理费每日计算,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付指令,经基金托管人复核后于次月前五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、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1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 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	439,276.61	426,186.96

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×0.25%÷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:基金托管费每日计算,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付指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金合同生效日(2014年9月3日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,000,000.00	8,000,000.00
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	8,000,000.00	8,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.80%	6.78%

注:基金管理人投资本基金时,本基金按照基金合同、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 2018年1月1日至2018年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	36,917,318.03	117,954.53	10,246,301.05	187,389.57

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(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

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 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
601860	紫金银行	2018年12月24日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

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。

§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	119,396,526.07	67.52
	其中:股票	119,396,526.07	67.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,221,938.40	8.61
	其中:债券	15,221,938.40	8.61
	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	4,000,000.00	2.26
	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	37,714,691.91	21.33
8	其他各项资产	498,417.73	0.28
9	合计	176,831,574.11	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	99,996,308.29	63.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,727.90	0.04
F	批发和零售业	2,712,244.08	1.72
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	3,239,600.00	2.06
J	金融业	3,135,645.80	1.99
K	房地产业	5,436,000.00	3.45
L	租赁和商务服务业	4,816,000.00	3.06
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	119,396,526.07	75.87

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	600887	伊利股份	295,000	6,749,600.00	4.29
2	002032	苏泊尔	119,948	6,297,270.00	4.00
3	603288	海天味业	88,500	6,088,800.00	3.87
4	000538	云南白药	80,000	5,916,800.00	3.76
5	600519	贵州茅台	8,200	4,838,082.00	3.07
6	601888	中国国旅	80,000	4,816,000.00	3.06
7	600612	老凤祥	100,000	4,500,000.00	2.86
8	600276	恒瑞医药	80,000	4,220,000.00	2.68
9	603899	晨光文具	135,000	4,083,750.00	2.60
10	002507	涪陵榨菜	171,000	3,693,600.00	2.35

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	600519	贵州茅台	27,764,206.00	15.39
2	600276	恒瑞医药	25,824,455.63	14.32
3	600887	伊利股份	20,722,188.36	11.49
4	601398	工商银行	20,363,628.00	11.29
5	002035	华帝股份	17,716,269.06	9.82
6	600809	山西汾酒	16,732,703.42	9.28
7	601888	中国国旅	15,927,591.65	8.83
8	000661	长春高新	15,889,752.49	8.81
9	300122	智飞生物	14,821,325.67	8.22
10	002572	索菲亚	13,770,073.10	7.63
11	601318	中国平安	12,792,682.00	7.09
12	000858	五粮液	12,637,929.26	7.01
13	300253	卫宁健康	11,795,485.78	6.54
14	000333	美的集团	11,584,428.00	6.42
15	000651	格力电器	11,524,683.49	6.39
16	000513	丽珠集团	11,486,039.66	6.37
17	000568	泸州老窖	11,378,475.79	6.31
18	002044	美年健康	11,153,625.06	6.18
19	300609	汇纳科技	10,718,363.00	5.94
20	300009	安科生物	10,641,224.20	5.90
21	300015	爱尔眼科	10,579,247.52	5.86
22	002422	科伦药业	10,530,531.28	5.84
23	603899	晨光文具	10,373,640.46	5.75
24	000423	东阿阿胶	9,970,892.40	5.53
25	002507	涪陵榨菜	9,959,473.53	5.52
26	000418	小天鹅A	9,913,927.99	5.50
27	300347	泰格医药	9,881,803.00	5.48
28	600436	片仔癀	9,864,719.40	5.47
29	600036	招商银行	9,186,901.64	5.09
30	600559	老白干酒	9,065,957.79	5.03
31	603233	大参林	8,865,430.00	4.91
32	002007	华兰生物	8,844,550.83	4.90
33	600196	复星医药	8,827,375.00	4.89
34	000963	华东医药	8,743,247.44	4.85
35	300601	康泰生物	8,733,612.00	4.84
36	600702	舍得酒业	8,095,000.00	4.49
37	600521	华海药业	8,003,876.92	4.44
38	600600	青岛啤酒	7,972,826.45	4.42
39	603288	海天味业	7,779,692.94	4.31
40	002508	老板电器	7,686,621.82	4.26
41	300078	思创医惠	7,568,605.20	4.20
42	000002	万科A	7,294,415.00	4.04
43	002304	洋河股份	7,289,384.12	4.04
44	601566	九牧王	7,271,432.18	4.03
45	000799	酒鬼酒	7,128,305.00	3.95
46	002032	苏泊尔	6,981,504.45	3.87
47	600690	青岛海尔	6,824,454.48	3.78
48	002153	石基信息	6,764,027.73	3.75
49	601933	永辉超市	6,376,394.05	3.53
50	000538	云南白药	6,148,735.00	3.41
51	002027	分众传媒	6,117,452.00	3.39
52	600566	济川药业	5,917,673.00	3.28
53	002223	鱼跃医疗	5,884,989.89	3.26
54	300616	尚品宅配	5,829,813.30	3.23
55	002262	恩华药业	5,625,523.20	3.12
56	002372	伟星新材	5,609,061.41	3.11
57	603127	昭衍新药	5,449,930.66	3.02
58	603866	桃李面包	5,420,156.55	3.00
59	002727	一心堂	5,409,537.18	3.00
60	603939	益丰药房	5,408,179.00	3.00
61	601607	上海医药	5,392,473.00	2.99
62	600201	生物股份	5,297,374.67	2.94
63	600754	锦江股份	5,269,840.95	2.92
64	601166	兴业银行	5,190,943.00	2.88
65	603868	飞科电器	5,185,785.00	2.87
66	600779	水井坊	5,141,318.50	2.85
67	600056	中国医药	5,101,846.04	2.83
68	300633	开立医疗	5,080,741.78	2.82
69	603579	荣泰健康	5,014,261.60	2.78
70	002677	浙江美大	4,983,743.20	2.76
71	600398	海澜之家	4,961,057.00	2.75
72	601818	光大银行	4,849,721.00	2.69
73	600867	通化东宝	4,664,241.00	2.59
74	002376	新北洋	4,651,331.00	2.58
75	600029	南方航空	4,561,526.00	2.53
76	600060	海信电器	4,412,198.85	2.45
77	603589	口子窖	4,355,179.30	2.41
78	600597	光明乳业	4,328,259.00	2.40
79	300463	迈克生物	4,267,745.00	2.37
80	603883	老百姓	4,174,673.00	2.31
81	600332	白云山	3,987,187.00	2.21
82	002705	新宝股份	3,974,403.76	2.20
83	000001	平安银行	3,971,761.94	2.20
84	000895	双汇发展	3,885,545.00	2.15
85	600612	老凤祥	3,848,990.00	2.13
86	001979	招商蛇口	3,781,975.00	2.10
87	600872	中炬高新	3,767,974.20	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	600519	贵州茅台	31,557,455.37	17.49
2	600276	恒瑞医药	27,195,133.74	15.08
3	600887	伊利股份	23,750,311.32	13.17
4	000568	泸州老窖	22,117,259.51	12.26
5	000651	格力电器	20,168,550.00	11.18
6	601398	工商银行	19,826,583.55	10.99
7	601888	中国国旅	17,747,953.06	9.84
8	002035	华帝股份	17,029,708.80	9.44
9	000858	五粮液	16,718,827.70	9.27
10	000661	长春高新	16,555,802.06	9.18
11	600809	山西汾酒	16,383,355.85	9.08
12	600196	复星医药	16,088,017.28	8.92
13	002572	索菲亚	13,222,727.99	7.33
14	600702	舍得酒业	12,726,755.31	7.05
15	603866	桃李面包	12,415,103.10	6.88
16	300122	智飞生物	12,317,126.00	6.83
17	000423	东阿阿胶	11,480,451.94	6.36
18	002422	科伦药业	11,221,802.23	6.22
19	002044	美年健康	10,773,282.62	5.97
20	600690	青岛海尔	10,770,104.13	5.97
21	300009	安科生物	10,715,148.20	5.94
22	300609	汇纳科技	10,626,621.56	5.89
23	600872	中炬高新	10,298,494.00	5.71
24	000333	美的集团	10,190,727.30	5.65
25	300015	爱尔眼科	10,070,405.54	5.58
26	002507	涪陵榨菜	10,002,865.08	5.54
27	000418	小天鹅A	10,000,290.61	5.54
28	000513	丽珠集团	9,562,041.66	5.30
29	002304	洋河股份	9,283,897.40	5.15
30	300347	泰格医药	9,192,095.85	5.10
31	600036	招商银行	8,884,268.91	4.92
32	601318	中国平安	8,841,838.36	4.90
33	600779	水井坊	8,762,062.00	4.86
34	600559	老白干酒	8,723,422.74	4.84
35	603233	大参林	8,712,471.00	4.83
36	300601	康泰生物	8,532,866.69	4.73
37	300078	思创医惠	8,216,121.29	4.55
38	300253	卫宁健康	7,962,592.02	4.41
39	000895	双汇发展	7,113,132.43	3.94
40	603288	海天味业	7,045,055.00	3.91
41	000799	酒鬼酒	7,003,566.00	3.88
42	601566	九牧王	6,876,704.94	3.81
43	000963	华东医药	6,768,216.50	3.75
44	600436	片仔癀	6,627,839.36	3.67
45	002153	石基信息	6,614,536.66	3.67
46	002007	华兰生物	6,519,517.00	3.61
47	600521	华海药业	6,420,960.20	3.56
48	600566	济川药业	6,314,638.56	3.50
49	000100	TCL 集团	6,238,064.00	3.46
50	002027	分众传媒	6,176,640.34	3.42
51	600600	青岛啤酒	6,000,688.00	3.33
52	300616	尚品宅配	5,918,984.00	3.28
53	601933	永辉超市	5,869,038.68	3.25
54	603127	昭衍新药	5,676,509.09	3.15
55	603579	荣泰健康	5,673,492.24	3.14
56	603515	欧普照明	5,555,726.00	3.08
57	603939	益丰药房	5,527,880.12	3.06
58	603899	晨光文具	5,523,014.62	3.06
59	002727	一心堂	5,297,015.95	2.94
60	601607	上海医药	5,277,453.80	2.93
61	002372	伟星新材	5,238,978.92	2.90
62	600201	生物股份	5,234,487.48	2.90
63	601166	兴业银行	5,157,634.50	2.86
64	002262	恩华药业	5,103,903.07	2.83
65	603883	老百姓	5,000,445.08	2.77
66	603801	志邦家居	4,991,502.86	2.77
67	600754	锦江股份	4,969,361.48	2.75
68	002773	康弘药业	4,951,818.84	2.74
69	002677	浙江美大	4,809,613.78	2.67
70	000002	万科A	4,721,304.78	2.62
71	601818	光大银行	4,627,000.00	2.56
72	002508	老板电器	4,586,886.00	2.54
73	600056	中国医药	4,500,249.00	2.49
74	300463	迈克生物	4,443,329.42	2.46
75	600060	海信电器	4,364,256.25	2.42
76	600298	安琪酵母	4,344,933.33	2.41
77	002376	新北洋	4,298,473.66	2.38
78	600398	海澜之家	4,190,179.00	2.32
79	603355	莱克电气	4,059,947.76	2.25
80	000001	平安银行	3,956,448.00	2.19
81	600597	光明乳业	3,867,769.00	2.14
82	600332	白云山	3,819,624.00	2.12
83	600029	南方航空	3,816,956.00	2.12
84	002705	新宝股份	3,744,371.06	2.08
85	603589	口子窖	3,687,557.29	2.04
86	001979	招商蛇口	3,629,522.00	2.01

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	896,668,014.77
卖出股票收入(成交)总额	913,309,804.72

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	9,999,000.00	6.35
	其中:政策性金融债	9,999,000.00	6.35
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)	5,222,938.40	3.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,221,938.40	9.67

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	160208	16国开08	100,000	9,999,000.00	6.35
2	113012	骆驼转债	28,440	2,676,488.40	1.70
3	110045	海澜转债	15,000	1,472,850.00	0.94
4	113512	景旺转债	10,000	1,073,600.00	0.68
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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

-

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

本基金所持有的苏泊尔(002032)于2018年1月24日公告,公司存在违规行为,违规类型是"未及时披露公司重大事项",内容是"2017年3月29日,你公司披露《关于公司与SEBS.A.签署2017年日常关联交易协议的议案》,预计公司与实际控制人SEB集团及其关联方发生的关联交易总额为368,808.00万元。2018年1月19日,你公司披露《关于2017年度日常关联交易超过预计的公告》,称经公司财务部门初步核查,公司与实际控制人SEB集团及其关联方2017年度日常关联交易的实际发生金额为374,434.85万元,较年初的预计金额增加5,626.85万元,增加金额占上市公司最近一期经审计净资产绝对值的1.24%。"深圳证券交易所对公司的处分措施为"对浙江苏泊尔股份有限公司予以监管关注"。

同时,公司于2018年4月11日公告,公司存在违规行为,违规类型是"未及时披露定期报告",内容是"因你公司网络和系统的原因,你公司未能在原预约的2018年3月30日披露2017年年度报告,你公司股票于2018年3月30日开市起停牌。3月31日,你公司披露了2017年年度报告等相关文件。4月2日,你公司股票复牌。"深圳证券交易所对公司的处分措施为"对浙江苏泊尔股份有限公司予以监管关注"。

公司接受的以上处罚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。

本基金投资苏泊尔主要基于以下原因:公司是小家电龙头公司,拥有较强的产品力、品牌力和渠道力,且在过去10年拥有良好的财务指标和市场信誉,是具备长期投资价值的品牌家电公司。

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 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	152,770.24
2	应收证券清算款	87,393.94
3	应收股利	-
4	应收利息	244,980.79
5	应收申购款	13,272.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	498,417.73

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	113012	骆驼转债	2,676,488.40	1.70

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
5,987	19,995.11	8,000,000.00	6.68%	111,710,711.96	93.32%

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	498,637.54	0.42%

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	10~50
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(2014年9月3日)基金份额总额	274,667,404.06
本报告期期初基金份额总额	117,941,899.09
本报告期期间基金总申购份额	37,648,114.77
减:本报告期期间基金总赎回份额	35,879,301.90
本报告期期末基金份额总额	119,710,711.96

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

本报告期内,本基金托管行总行聘任刘琳同志、李智同志为托管业务部高级专家。

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

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

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2018年12月31日,该审计机构已向本基金提供5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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
光大证券股份有限公司	2	804,220,672.21	44.51%	748,974.39	44.51%	-
长江证券股份有限公司	2	517,056,340.77	28.62%	481,535.66	28.62%	-
太平洋证券股份有限公司	2	485,504,554.78	26.87%	452,149.91	26.87%	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-

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)本报告期内本基金租用的券商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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
光大证券股份有限公司	-	-	482,500,000.00	36.35%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	7,665,765.80	100.00%	845,000,000.00	63.65%	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-

§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

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

2019年3月28日