(上接 D197 版)

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	99,850,221.85	19.24
2	601318	中国平安	92,788,558.00	17.88
3	600519	贵州茅台	67,598,537.01	13.03
4	002456	欧菲科技	67,342,135.73	12.98
5	600887	伊利股份	64,603,420.69	12.45
6	000858	五 粮 液	57,304,625.80	11.04
7	600068	葛洲坝	56,809,921.66	10.95
8	601336	新华保险	56,080,583.92	10.81
9	601398	工商银行	53,957,647.45	10.40
10	000651	格力电器	51,752,838.70	9.97
11	000001	平安银行	48,366,962.23	9.32
12	600036	招商银行	43,027,923.44	8.29
13	600584	长电科技	38,479,873.42	7.42
14	000933	神火股份	38,261,870.71	7.37
15	000333	美的集团	36,599,980.99	7.05
16	600809	山西汾酒	36,480,854.70	7.03
17	000878	云南铜业	34,244,364.96	6.60
18	600019	宝钢股份	33,405,466.68	6.44
19	601668	中国建筑	33,349,047.00	6.43
20	000063	中兴通讯	32,877,037.01	6.34
21	002415	海康威视	32,454,703.88	6.25
22	002475	立讯精密	30,411,019.23	5.86
23	300212	易华录	29,756,680.32	5.73
24	000049	德赛电池	29,556,862.98	5.70
25	601233	桐昆股份	29,025,624.84	5.59
26	600808	马钢股份	28,686,227.00	5.53
27	000002	万 科 A	28,342,367.44	5.46
28	300433	蓝思科技	27,797,060.66	5.36
29	600056	中国医药	26,984,347.04	5.20
30	600487	亨通光电	26,762,218.04	5.16
31	601800	中国交建	26,571,646.79	5.12
32	600276	恒瑞医药	25,945,240.51	5.00
33	300059	东方财富	25,738,721.48	4.96
34	601607	上海医药	25,709,805.88	4.95
35	000797	中国武夷	25,435,436.30	4.90
36	002078	太阳纸业	25,005,155.37	4.82
37	300136	信维通信	23,871,294.24	4.60
38	000825	太钢不锈	23,656,934.32	4.56
39	000807	云铝股份	23,597,402.78	4.55
40	002410	广联达	23,553,815.17	4.54
41	600048	保利地产	22,799,654.03	4.39
42	601601	中国太保	22,769,092.96	4.39
43	600125	铁龙物流	22,618,877.83	4.36
44	600030	中信证券	22,328,425.00	4.30
45	600585	海螺水泥	21,825,698.00	4.21
46	002241	歌尔股份	21,272,001.36	4.10
47	601166	兴业银行	20,940,021.36	4.04
48	600801	华新水泥	20,308,470.06	3.91
49	300450	先导智能	19,962,103.00	3.85
50	600104	上汽集团	19,949,838.44	3.84
51	300296	利亚德	19,053,501.98	3.67
52	600816	安信信托	18,802,224.40	3.62
53	600569	安阳钢铁	17,708,196.18	3.41
54	000725	京东方 A	17,677,000.00	3.41
55	600967	内蒙一机	17,177,698.00	3.31
56	002466	天齐锂业	16,660,887.60	3.21
57	600196	复星医药	16,604,875.40	3.20
58	000728	国元证券	16,591,587.50	3.20
59	000928	中钢国际	16,012,782.33	3.09
60	002371	北方华创	15,823,271.00	3.05
61	601211	国泰君安	15,731,431.48	3.03
62	000065	北方国际	15,622,794.16	3.01
63	600779	水井坊	15,491,599.48	2.99
64	300115	长盈精密	15,420,528.34	2.97
65	600362	江西铜业	15,322,931.81	2.95
66	002146	荣盛发展	15,182,131.00	2.93
67	002304	洋河股份	15,163,543.00	2.92
68	600549	厦门钨业	14,861,445.00	2.86
69	000980	众泰汽车	14,643,001.00	2.82
70	601288	农业银行	14,491,500.00	2.79
71	000959	首钢股份	14,431,635.39	2.78
72	601118	海南橡胶	14,390,851.50	2.77
73	600050	中国联通	14,317,000.00	2.76
74	000661	长春高新	14,299,473.00	2.76
75	300166	东方国信	14,280,986.22	2.75
76	002027	分众传媒	14,050,643.36	2.71
77	002008	大族激光	13,988,431.00	2.70
78	000538	云南白药	13,620,677.39	2.63
79	000717	韶钢松山	13,407,898.08	2.58
80	601333	广深铁路	13,282,000.00	2.56
81	000401	冀东水泥	13,247,629.00	2.55
82	603799	华友钴业	13,215,434.18	2.55
83	300075	数字政通	13,061,645.00	2.52
84	603626	科森科技	13,020,168.63	2.51
85	002273	水晶光电	13,005,631.00	2.51
86	300408	三环集团	12,977,551.78	2.50
87	600703	三安光电	12,880,694.00	2.48
88	600963	岳阳林纸	12,814,891.44	2.47
89	000423	东阿阿胶	12,777,504.00	2.46
90	002092	中泰化学	12,777,184.00	2.46
91	300078	思创医惠	12,591,603.47	2.43
92	600720	祁连山	12,536,265.00	2.42
93	002405	四维图新	12,443,608.50	2.40
94	600497	驰宏锌锗	12,344,676.00	2.38
95	300367	东方网力	12,183,270.80	2.35
96	600782	新钢股份	12,118,895.00	2.34
97	002234	民和股份	12,112,915.00	2.33
98	601117	中国化学	11,700,219.00	2.25
99	600266	北京城建	11,349,450.00	2.19
100	300422	博世科	11,276,376.70	2.17
101	600990	四创电子	11,200,018.50	2.16
102	600169	太原重工	11,111,120.00	2.14
103	000983	西山煤电	10,921,278.80	2.10
104	000703	恒逸石化	10,866,149.00	2.09
105	002310	东方园林	10,838,610.99	2.09
106	600835	上海机电	10,801,639.00	2.08
107	002074	国轩高科	10,742,088.58	2.07
108	600383	金地集团	10,632,045.00	2.05
109	600111	北方稀土	10,624,151.00	2.05
110	600038	中直股份	10,603,574.48	2.04
111	601857	中国石油	10,576,949.38	2.04
112	300401	花园生物	10,559,166.65	2.04
113	601998	中信银行	10,507,340.00	2.03

注:①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。②"买入金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	112,561,524.64	21.69
2	002456	欧菲科技	88,811,009.59	17.12
3	000858	五 粮 液	85,346,728.84	16.45
4	601318	中国平安	71,035,750.43	13.69
5	600519	贵州茅台	56,770,967.84	10.94
6	600068	葛洲坝	54,357,721.62	10.48
7	600887	伊利股份	50,731,506.83	9.78
8	601336	新华保险	40,414,170.39	7.79
9	601800	中国交建	39,494,485.00	7.61
10	000333	美的集团	39,453,217.93	7.60
11	600809	山西汾酒	38,323,649.89	7.39
12	000933	神火股份	38,228,968.58	7.37
13	600584	长电科技	37,957,665.88	7.32
14	000001	平安银行	37,915,187.68	7.31
15	601398	工商银行	36,980,592.05	7.13
16	000651	格力电器	35,487,279.90	6.84
17	000063	中兴通讯	34,090,583.75	6.57
18	600019	宝钢股份	34,040,079.24	6.56
19	601668	中国建筑	32,217,389.40	6.21
20	300433	蓝思科技	31,715,557.80	6.11
21	000065	北方国际	31,663,533.01	6.10
22	600409	三友化工	30,895,123.65	5.95
23	000002	万 科 A	30,522,567.29	5.88
24	002475	立讯精密	30,345,814.32	5.85
25	600487	亨通光电	29,255,054.68	5.64
26	000049	德赛电池	28,617,480.01	5.52
27	601233	桐昆股份	28,482,854.88	5.49
28	000928	中钢国际	28,359,985.78	5.47
29	600808	马钢股份	28,328,436.00	5.46
30	000807	云铝股份	27,372,811.19	5.28
31	000878	云南铜业	27,182,281.40	5.24
32	002410	广联达	26,239,969.88	5.06
33	600056	中国医药	26,145,211.00	5.04
34	000797	中国武夷	25,884,981.40	4.99
35	300136	信维通信	25,626,513.30	4.94
36	601601	中国太保	25,278,645.02	4.87
37	601607	上海医药	25,139,883.60	4.85
38	002078	太阳纸业	24,847,604.60	4.79
39	600585	海螺水泥	24,686,342.23	4.76
40	002241	歌尔股份	24,661,397.17	4.75
41	600036	招商银行	24,276,034.72	4.68
42	300422	博世科	23,686,117.89	4.56
43	300212	易华录	23,353,840.62	4.50
44	600801	华新水泥	23,234,692.24	4.48
45	002415	海康威视	23,139,456.39	4.46
46	600048	保利地产	22,736,123.12	4.38
47	000825	太钢不锈	22,300,577.00	4.30
48	600030	中信证券	21,958,217.00	4.23
49	600104	上汽集团	20,975,872.00	4.04
50	601166	兴业银行	20,840,887.62	4.02
51	600816	安信信托	19,187,114.46	3.70
52	300296	利亚德	19,137,071.83	3.69
53	300450	先导智能	18,998,491.00	3.66
54	600569	安阳钢铁	18,701,716.69	3.60
55	600643	爱建集团	17,839,930.52	3.44
56	600967	内蒙一机	17,536,265.95	3.38
57	600125	铁龙物流	16,730,490.45	3.22
58	002236	大华股份	16,049,969.70	3.09
59	000980	众泰汽车	16,017,671.00	3.09
60	600779	水井坊	15,932,022.83	3.07
61	002092	中泰化学	15,704,353.00	3.03
62	300115	长盈精密	15,596,026.74	3.01
63	002466	天齐锂业	15,583,811.72	3.00
64	600362	江西铜业	15,383,738.88	2.96
65	000728	国元证券	15,261,923.66	2.94
66	000050	深天马 A	14,969,802.00	2.89
67	000717	韶钢松山	14,955,266.96	2.88
68	000959	首钢股份	14,906,944.80	2.87
69	002304	洋河股份	14,872,842.64	2.87
70	002008	大族激光	14,844,561.00	2.86
71	300367	东方网力	14,793,962.00	2.85
72	601211	国泰君安	14,774,251.00	2.85
73	002055	得润电子	14,738,350.34	2.84
74	000538	云南白药	14,414,403.23	2.78
75	601288	农业银行	14,076,400.00	2.71
76	000902	新洋丰	14,036,048.89	2.71
77	000018	神州长城	14,015,881.14	2.70
78	601333	广深铁路	13,974,291.00	2.69
79	000423	东阿阿胶	13,945,864.34	2.69
80	300166	东方国信	13,913,614.86	2.68
81	002570	贝因美	13,851,639.45	2.67
82	601118	海南橡胶	13,532,559.60	2.61
83	603626	科森科技	13,409,439.68	2.58
84	600720	祁连山	13,318,113.00	2.57
85	600549	厦门钨业	13,185,306.00	2.54
86	300075	数字政通	13,176,413.97	2.54
87	000683	远兴能源	13,146,553.00	2.53
88	600963	岳阳林纸	13,039,855.00	2.51
89	600050	中国联通	12,939,151.00	2.49
90	601888	中国国旅	12,424,642.00	2.39
91	000401	冀东水泥	12,365,522.00	2.38
92	300078	思创医惠	12,040,092.81	2.32
93	300408	三环集团	11,997,298.00	2.31
94	600782	新钢股份	11,960,662.00	2.31
95	002234	民和股份	11,821,455.82	2.28
96	600266	北京城建	11,551,746.00	2.23
97	000703	恒逸石化	11,547,073.64	2.23
98	603799	华友钴业	11,527,404.00	2.22
99	601117	中国化学	11,488,890.00	2.21
100	600759	洲际油气	11,413,075.82	2.20
101	300294	博雅生物	11,270,156.74	2.17
102	300232	洲明科技	11,249,055.89	2.17
103	000983	西山煤电	11,202,490.90	2.16
104	600169	太原重工	10,753,303.74	2.07
105	600990	四创电子	10,745,531.00	2.07
106	002051	中工国际	10,688,634.00	2.06
107	002074	国轩高科	10,641,060.70	2.05
108	002310	东方园林	10,611,722.00	2.05
109	601998	中信银行	10,492,129.00	2.02
110	002146	荣盛发展	10,453,473.61	2.01
111	600383	金地集团	10,387,062.16	2.00
112	601857	中国石油	10,384,913.00	2.00

注:①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②"卖出金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

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

注:①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	31,916,000.00	6.75
	其中:政策性金融债	31,916,000.00	6.75
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	31,916,000.00	6.75

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	170408	17 农发 08	200,000	19,940,000.00	4.22
2	170204	17 国开 04	120,000	11,976,000.00	2.53
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金所持有的东方财富(300059)于 2017 年 3 月 6 日公告,公司涉及一项欠款纠纷,该案已由华南国际经济贸易仲裁委员会受理。案件内容为:本公司(东方财富)购买了由安徽蓝博旺机械集团下属三家企业作为联合发起人发行的 2012 中小企业集合私募债券(其中第一期债券"12 蓝博 01"面值 2,400 万元、第二期债券"12 蓝博 02"面值 4,500 万元),上述债券的债券票面年利率为 9.8%,按年付息,存续期为 3 年(附第 2 年末投资者回售选择权)。2015 年 1 月、2 月本公司分别对"12 蓝博 01"、"12 蓝博 02"行使回售选择权。因三家联合发起人及担保公司未能支付上述债券的本金及利息,本公司向华南国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。仲裁庭于 2015 年 8 月 21 日就本案进行庭前调解和开庭审理,但本次调解未能就相关债务清偿、违约责任承担及担保责任承担达成一致意见。2016 年 6 月 1 日,东方财富证券收到中国国际经济贸易仲裁委员会作出的书面撤案决定,撤销定向债务融资工具仲裁案件。根据华南国际经济贸易仲裁委员会 2016 年 6 月 30 日下达的华南国仲深裁[2016]D208 号裁决书。第一被申请人安徽蓝博旺机械集团合诚机械有限公司、第二被申请人安徽蓝博旺机械集团液压流体机械有限责任公司、第三被申请人安徽蓝博旺机械集团精密液压件有限责任公司(以下简称一三家被申请人‖)向东方财富证券支付 12 蓝博 01 和 12 蓝博 02 私募债本金合计人民币 69,000,000.00 元,利息合计人民币 6,762,000.00 元,12 蓝博 01 违约金人民币 1,093,608.00 元,12 蓝博 01 违约金人民币 617,625.00 元。因三家被申请人一直未按裁决书履行还款义务,东方财富证券于 2016 年 9 月 5 日向安徽省淮南市中级人民法院申请强制执行,执行案号为(2016)皖 04 执 527 号。截至报告期末,强制执行尚未完成。公司公告以上欠款纠纷不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

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

格力电器于 2017 年 10 月 19 日公告:公司董事徐自发先生于 2017 年 10 月 18 日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(编号:粤证调查通字 170202 号),该通知书内容为"因涉嫌违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,我会决定对你立案调查,请予以配合。"

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序:

(1)研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2)投资决策委员会定期召开会议,讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3)基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

(4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5)投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

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

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

除上述情况外,本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,609	8,478.92	4,621,547.90	2.78%	161,641,652.98	97.22%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	77,826.50	0.05%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

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

注:基金总申购份额包含基金转换入份额,基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所,本年度应支付给立信会计师事务所(特殊普通合伙)报酬为 40,000.00 元;截至 2017 年 12 月 31 日,该审计机构已向本基金提供 10 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券股份有限公司	1	2,195,843,010.84	31.39%	2,044,992.65	31.39%	–
方正证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国海证券股份有限公司	1	610,060,949.87	8.72%	568,150.90	8.72%	–
中泰证券股份有限公司	3	402,035,991.98	5.75%	374,415.95	5.75%	–
中信证券股份有限公司	1	867,457,478.74	12.40%	807,861.96	12.40%	–
南京证券股份有限公司	3	1,412,043,545.54	20.19%	1,315,033.14	20.19%	–
东北证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
国联证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
银河证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东吴证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
申万宏源证券有限公司	1	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
安信证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
天风证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	1	1,506,841,139.20	21.54%	1,403,321.43	21.54%	–

注:(1)此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。(2)交易单元的选择标准和程序

券商选择标准:①资力雄厚,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 7 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国海证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中泰证券股份有限公司	–	–	10,000,000.00	1.48%	–	–
中信证券股份有限公司	–	–	125,000,000.00	18.53%	–	–
南京证券股份有限公司	–	–	73,000,000.00	10.82%	–	–
东北证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国联证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
银河证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东吴证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
申万宏源证券有限公司	–	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
安信证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
天风证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	–	–	466,500,000.00	69.16%	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

东方基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 30 日

(上接 D199 版)

注:①计提标准:本基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计算。

管理费的计算方法如下:

H=E×0.80%÷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款指令,基金托管人复核后于次月前五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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	410,720.37	4,426.20

注:①计提标准:本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。

托管费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷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款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方永熙 18 个月定期开放债券 A	东方永熙 18 个月定期开放债券 C	合计
东方基金管理有限责任公司	–	126.18	126.18
合计	–	126.18	126.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方永熙 18 个月定期开放债券 A	东方永熙 18 个月定期开放债券 C	合计
东方基金管理有限责任公司	–	110.44	110.44
合计	–	110.44	110.44

注:①计提标准:本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式:基金销售服务费每日计提,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销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性划出,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行股份有限公司	117,479,650.00	9,802,160.00	–	–	–	–
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行股份有限公司	–	–	–	–	–	–

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

本报告期及上年度可比期间,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,874,343.41	65,603.80	12,495,279.26	12,399.64

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002130	沃尔核材	2017 年 12 月 25 日	重大事项	5.76	2018 年 1 月 10 日	6.15	1,000	6,620.00	5,760.00	–

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 2017 年 12 月 31 日止,本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截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	4,433,595.40	1.37
	其中:股票	4,433,595.40	1.37
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	308,648,297.12	95.62
	其中:债券	308,648,297.12	95.62
	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	3,734,617.67	1.16
8	其他各项资产	5,960,118.14	1.85
9	合计	322,776,628.33	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	4,391,035.00	2.13
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	18,550.40	0.01
J	金融业	24,010.00	0.01
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	4,433,595.40	2.15

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	600967	内蒙一机	278,500	3,355,925.00	1.63
2	601766	中国中车	85,000	1,029,350.00	0.50
3	600845	宝信软件	1,000	18,540.00	0.01
4	002142	宁波银行	1,000	17,810.00	0.01
5	601998	中信银行	1,000	6,200.00	0.00
6	002130	沃尔核材	1,000	5,760.00	0.00
7	002131	利欧股份	4	10.40	0.00

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	600967	内蒙一机	21,223,139.72	10.48
2	600435	北方导航	6,072,101.00	3.00
3	601991	大唐发电	6,067,559.00	3.00
4	600820	隧道股份	4,095,062.00	2.02
5	000519	中兵红箭	4,085,382.00	2.02
6	601611	中国核建	3,685,500.00	1.82
7	002797	第一创业	3,036,925.00	1.50
8	601800	中国交建	2,000,365.00	0.99
9	601766	中国中车	1,030,691.00	0.51
10	600406	国电南瑞	897,840.00	0.44
11	002460	赣锋锂业	85,290.00	0.04
12	603179	新泉股份	49,920.00	0.02
13	603959	百利科技	31,900.00	0.02
14	603421	鼎信通讯	30,965.00	0.02
15	002273	水晶光电	30,113.00	0.01
16	603738	泰晶科技	29,134.00	0.01
17	300288	朗玛信息	28,350.00	0.01
18	603027	千禾味业	21,840.00	0.01
19	300388	国祯环保	21,130.00	0.01
20	002728	特一药业	20,560.00	0.01

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	600967	内蒙一机	17,957,466.54	8.87
2	601991	大唐发电	6,292,913.00	3.11
3	600435	北方导航	5,786,821.62	2.86
4	000519	中兵红箭	4,298,659.12	2.12
5	600820	隧道股份	3,895,964.14	1.92
6	601611	中国核建	3,482,430.00	1.72
7	002797	第一创业	3,115,140.00	1.54
8	601800	中国交建	2,139,334.00	1.06
9	600406	国电南瑞	849,107.00	0.42
10	002460	赣锋锂业	68,097.00	0.03
11	603179	新泉股份	35,946.00	0.02
12	603959	百利科技	28,880.00	0.01
13	603421	鼎信通讯	25,090.00	0.01
14	300288	朗玛信息	24,844.00	0.01
15	300388	国祯环保	24,030.00	0.01
16	002273	水晶光电	23,670.00	0.01
17	603738	泰晶科技	22,750.00	0.01
18	603027	千禾味业	17,990.00	0.01
19	002728	特一药业	17,650.00	0.01
20	600183	生益科技	16,610.00	0.01

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	52,823,162.72
卖出股票收入(成交)总额	48,310,264.42

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	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	242,636,066.00	117.65
5	企业短期融资券	51,908,800.00	25.17
6	中期票据	13,941,000.00	6.76
7	可转债(可交换债)	162,431.12	0.08
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	308,648,297.12	149.66

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	011758094	17 汾湖投资 SCP001	160,000	15,985,600.00	7.75
2	011758093	17 昆自来水 SCP001	160,000	15,971,200.00	7.74
3	124456	13 闽投债	160,000	15,968,000.00	7.74
4	112605	17 光线 01	160,000	15,848,000.00	7.68
5	1280133	12 乌兰察布债	150,000	15,673,500.00	7.60

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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

本基金所持有利欧股份(002131.SZ)于 2017 年 9 月 12 日对外公告了被采取行政监管措施的事宜。利欧集团股份有限公司董事会于 2017 年 9 月 12 日发布公告,公告称,近日浙江省证监局对公司出具了《关于对利欧集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2017]51 号),因子公司上海智趣广告有限公司、上海漫酷广告有限公司未严格按照企业会计准则的规定核算营业收入和成本,同时公司未及时对二级子公司上海聚胜万合广告有限公司的关联方借款履行关联交易决策程序和信息披露义务,浙江省证监局对公司采取责令改正措施。

本基金决策依据及投资程序:

(1)研究:本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台,由研究部负责,采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析,深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势;通过对信用利差的分析判断,可转债的投资价值分析等,深入研究各类债券合理的投资价值。在全面深入研究的基础上,提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

(2)资产配置决策:投资决策委员会依据上述研究报告,对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议,根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断,对基金资产的投资,制定月度资产配置和久期设置计划,并报投资决策委员会审批,审批通过,方可按计划执行。

(3)组合构建:大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后,基金经理参考研究员的投资建议,结合自身的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机,其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

(4)交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行证券投资组合计划,进行具体品种的交易。

(5)风险监控:本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控,定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况,责令投资不规范的基金经理进行检讨,并及时调整。

(6)风险绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估,并提供相关报告,使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略,并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整和优化投资组合。

(7)组合调整:基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化,以及组合风险与绩效的评估结果,结合基金申购和赎回的现金流量情况,对投资组合进行动态调整,使之不断得到优化。

本基金投资利欧股份主要基于以下原因:

利欧集团股份有限公司原有业务为传统制造业,主要从事泵、园林机械、清洗和植保机械的研发、制造和销售,在整个泵业领域覆盖了较为完整的产业链。2014 年度,公司通过对漫酷广告、上海氩氪和琥珀传播的成功收购,进军数字营销业务领域。2015 年度,公司又成功完成对万圣伟业、微创时代的收购,公司数字营销服务已覆盖营销策略和创意、媒体投放和执行、效果监测和优化、社会化营销、精准营销、流量整合等完整的服务链条,成功建立了从基础的互联网流量整合到全方位精准数字营销服务于一体的整合营销平台。2017 年前三季度,公司毛利率为 15.9%。其中,第三季度营业收入 31.65 亿元,归母净利润 1.26 亿元,毛利率为 13.5%。目前,公司成为行业内为数不多的能够提供一站式整合数字营销服务的数字营销集团,已成功跻身国内数字营销行业的领先梯队,凭借优质的媒介与客户资源、专 业化技术团队以及多渠道的投放设计,公司利润率水平有望持续回升。

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	22,695.70
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,937,422.44
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,960,118.14

8.11.4 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	65,770.80	0.03
2	113011	光大转债	1,043.70	0.00

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002130	沃尔核材	5,760.00	0.00	重大事项

§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

份额级别	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
东方永熙 18 个月定期开放债券 A	2,446	81,753.42	49,718.45	0.02%	199,919,138.79	99.98%
东方永熙 18 个月定期开放债券 C	68	37,159.15	0.00	0.00%	2,526,822.02	100.00%
合计	2,514	80,547.21	49,718.45	0.02%	202,445,960.81	99.98%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	东方永熙 18 个月定期开放债券 A	0.00	0.0000%
	东方永熙 18 个月定期开放债券 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	东方永熙 18 个月定期开放债券 A	0
	东方永熙 18 个月定期开放债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方永熙 18 个月定期开放债券 A	0
	东方永熙 18 个月定期开放债券 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东方永熙 18 个月定期开放债券 A	东方永熙 18 个月定期开放债券 C
基金合同生效日(2016 年 12 月 27 日)基金份额总额	199,968,857.24	2,526,822.02
本报告期期初基金份额总额	199,968,857.24	2,526,822.02
本报告期基金总申购份额	–	–
减:本报告期基金总赎回份额	–	–
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	199,968,857.24	2,526,822.02

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

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部 / 养老金管理中心副总经理,负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要,余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部 / 养老金管理中心副总经理职务。

本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任立信会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务,本年度应支付给立信会计师事务所(特殊普通合伙)报酬为 50,000.00 元;截至 2017 年 12 月 31 日,该审计机构向本基金提供审计服务一年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券有限公司	2	101,133,427.14	100.00%	94,185.81	100.00%	–
太平洋证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	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,本基金新增租用 10 个交易单元,分别为申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、长江证券股份有限公司上海及深圳证券交易所交易单元各 1 个。

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
申万宏源证券有限公司	189,952,304.61	100.00%	2,236,200,000.00	100.00%	–	–
太平洋证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–

§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

2018 年 3 月 30 日