

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：二〇一七年三月二十七日

§ 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 2017 年 3 月 24 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 2016 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	12,132,745.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资管理，精选受益于经济转型下产业结构调整方向的、具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票；努力把握市场趋势，积极进行适当范围内的大类资产配置调整，在严格控制风险的前提下，谋求本基金资产的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
业绩比较基准	本基金采用“中证 700 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%”作为投资业绩比较基准。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数或债券指数时，本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金为混合型基金，股票部分主要投资于具有高成长潜力的中小市值上市公司股票，属于证券投资基金中预期风险和预期收益为中高风险等级的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	tiandonghui@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	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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-8,688,986.28	46,864,614.98	12,801,271.92
本期利润	-9,886,170.87	35,190,100.02	18,722,090.88
加权平均基金份额本期利润	-0.7648	0.9349	0.2798
本期基金份额净值增长率	-21.17%	45.30%	20.78%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.9347	1.6719	0.4987
期末基金资产净值	23,473,108.82	50,960,401.61	102,177,328.64
期末基金份额净值	1.9347	2.4542	1.6891

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。

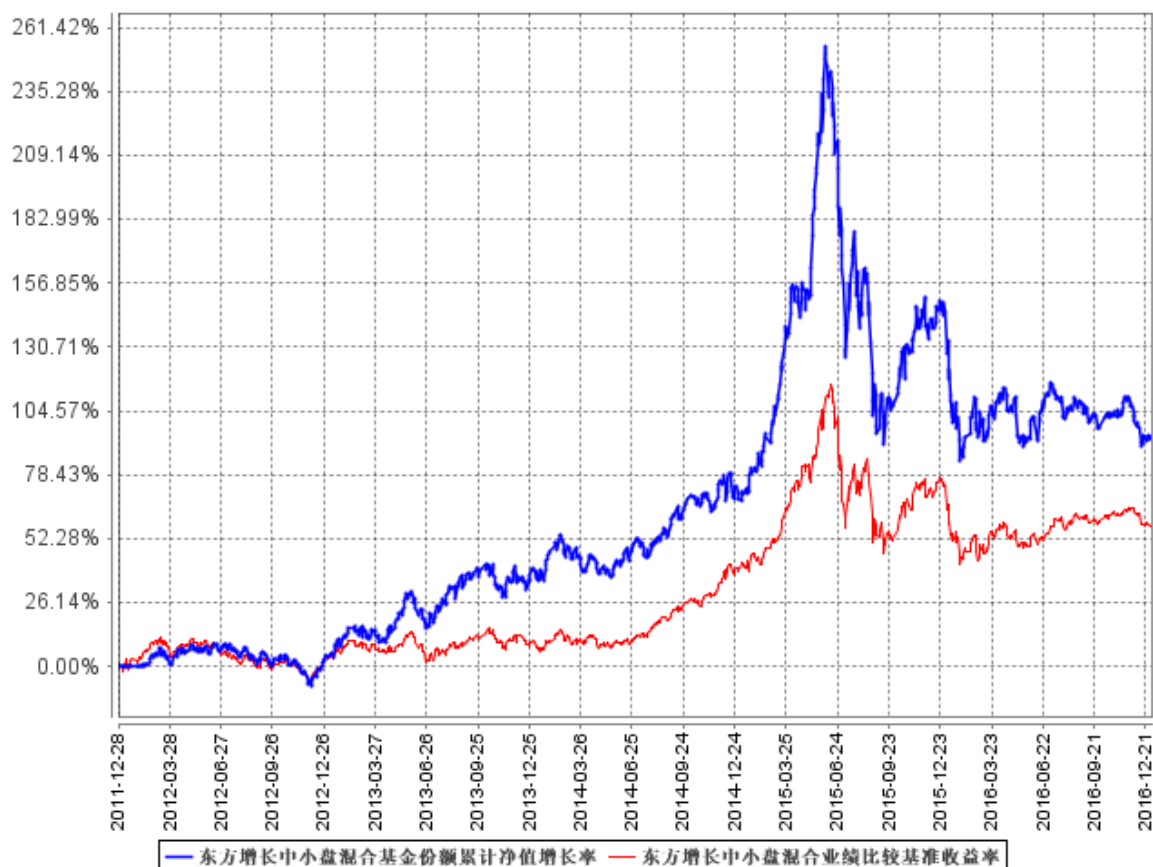
3.2 基金净值表现

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	-2.42%	0.76%	-0.97%	0.48%	-1.45%	0.28%
过去六个月	-8.27%	0.84%	1.98%	0.54%	-10.25%	0.30%
过去一年	-21.17%	1.55%	-9.31%	1.09%	-11.86%	0.46%
过去三年	38.34%	1.73%	43.00%	1.22%	-4.66%	0.51%
过去五年	93.41%	1.50%	56.10%	1.10%	37.31%	0.40%
自基金合同生效起至今	93.47%	1.50%	57.76%	1.09%	35.71%	0.41%

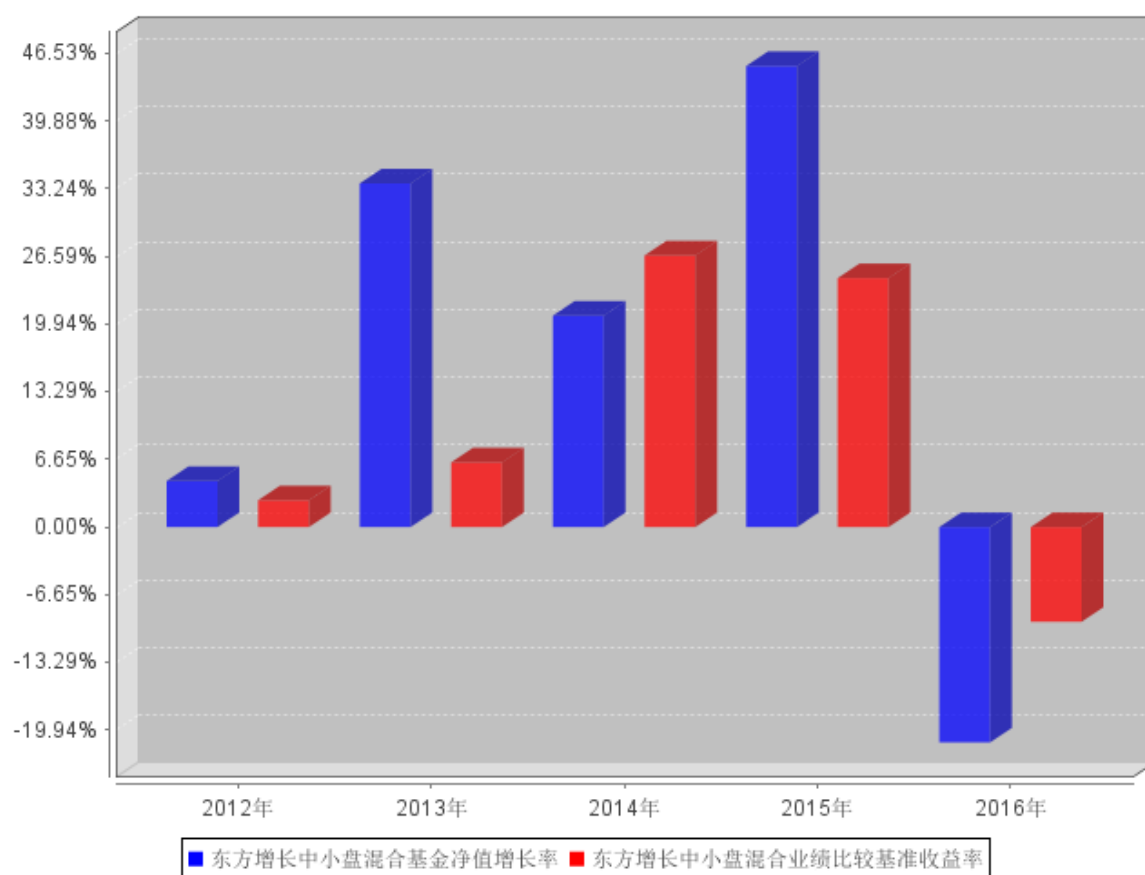
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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走势对比图



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

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 2016 年 12 月 31 日，本公司注册资本 2 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 12800 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 5400 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 1800 万元，占公司注册资本的 9%。截止 2016 年 12 月 31 日，

本公司管理 40 只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方保本混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长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、东方主题精选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、东方鼎新灵活配置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、东方永润 18 个月定期开放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、东方赢家保本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、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨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、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛子微 (先生)	本基金基金经理	2015 年 4 月 30 日	—	9 年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士，9 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 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理。现任东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力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、东方新价值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、东方区域发展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。
--	--	--	--	--	---

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、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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

2016 年是中国经济持续“L”性筑底的阶段，同时“去产能”“去杠杆”仍旧继续深化，在特朗普上台和美国加息预期增强的影响下，人民币兑美元加速贬值，中美贸易关系进入更加微妙的阶段。国内房地产市场经历了风风火火的三个季度后进入政策收紧的阶段，流动趋紧拐点出现，以一带一路和 PPP 为首的基建项目大量涌现，同时国企改革也进入实质阶段。因此尽管大环境不容乐观，但出现了结构性的改善。

报告期内，上证综指先抑后仰，全年下跌 12.3%，深成指下跌 19.6%，创业板指下跌 27.7%，分化明显。根据 wind 的数据统计，申万行业中大部分行业实现了正收益，其中建筑装饰、通讯、机械设备涨幅居前，分别上涨了 32%、30%、19%；跌幅最大的三个行业是休闲服务、公用事业、房地产，分别下跌了 15%、15%、13%。

报告期内，本基金根据阶段性市场特征，在仓位、行业配置上及时、主动进行了调整，阶段性参与了周期类行业供给侧改革带来的投资机会以及消费、成长类股票的阶段性行情，适当参与行业轮动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为-21.17%，业绩比较基准收益率为-9.31%，低于业绩比较基准 11.86%。

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 2017 年，我们认为，经济总体仍处于缓慢寻底阶段，但其中仍不乏结构性亮点，一方面，PPI 连续数月处于扩张区间，增强了企业主动补库存意愿，而根据历史经验，企业补库存意愿提升后的 6 个月左右，中游制造业再投资有望启动，这将可能成为 17 年上半年一大亮点；另一方面随着 16 年前两批入库的 PPP 项目落地，将一定程度对冲地产投资下滑带来的负面影响。

针对证券市场投资，我们认为，2017 年一季度由于同期物价基数较低，结合春节效应通胀有一定上行压力，而上游的农产品、油气资源等板块作为通胀受益行业在这一阶段有望获取超额收益。另一方面 PPP 项目落地速度加快，将为相关工程、环保类企业带来订单的快速增长，也将带来工程机械销量出现一定回升，相关行业板块也将出现超额收益，对此我们也将保持持续跟踪。考虑到两会前后的政策预期和年报季报的业绩行情，我们认为一季度是全年最有可能实现超额收

益的时间窗口。下半年随着美国再次加息的预期增强以及国内流动性趋紧，我们认为下半年的操作策略将更加谨慎。

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，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，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本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管业务，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领域的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强了基金投资监察力度，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

根据中国证监会公告【2008】38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，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”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、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，本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

—

4.10 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将采取适当措施。

§ 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”）在东方保本混合型开放式证券投资基金（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

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[2017]第 ZB30034 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	
引言段	我们审计了后附的东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方增长基金”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、2016 年度的所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是东方增长基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）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。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。	
审计意见段	我们认为，东方增长基金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基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	朱锦梅	赵立卿
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市南京路 61 号新黄浦金融大厦 4 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	2,397,608.62	2,292,210.97
结算备付金	99,957.51	352,542.01
存出保证金	55,987.25	189,945.41
交易性金融资产	20,279,716.25	44,503,865.80
其中：股票投资	15,230,356.25	33,990,725.80
基金投资	-	-
债券投资	5,049,360.00	10,513,140.00
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	-	-
应收证券清算款	1,704,868.84	4,341,558.73
应收利息	97,735.88	148,280.74
应收股利	-	-
应收申购款	4,922.48	13,837.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	24,640,796.83	51,842,241.05
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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	-	-
应付赎回款	8,716.07	77,724.13
应付管理人报酬	29,827.94	51,329.17
应付托管费	4,971.32	8,554.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	959,397.93	629,327.36

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	164,774.75	114,903.93
负债合计	1,167,688.01	881,839.44
所有者权益：		
实收基金	12,132,745.77	20,764,754.13
未分配利润	11,340,363.05	30,195,647.48
所有者权益合计	23,473,108.82	50,960,401.61
负债和所有者权益总计	24,640,796.83	51,842,241.05

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9347 元，基金份额总额 12,132,745.77 份。

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-8,740,385.07	37,837,675.43
1. 利息收入	214,178.56	1,234,259.60
其中：存款利息收入	22,556.36	61,176.32
债券利息收入	191,622.20	1,173,083.28
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）	-7,787,439.72	48,056,514.33
其中：股票投资收益	-7,840,747.27	47,494,467.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-28,786.34	377,904.08
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	82,093.89	184,142.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,197,184.59	-11,674,514.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	30,060.68	221,416.46

减：二、费用	1,145,785.80	2,647,575.41
1. 管理人报酬	395,546.84	1,340,607.62
2. 托管费	65,924.42	223,434.54
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	546,714.54	946,799.79
5. 利息支出	-	533.46
其中：卖出回购金融资产支出	-	533.46
6. 其他费用	137,600.00	136,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-9,886,170.87	35,190,100.02
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-9,886,170.87	35,190,100.02

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	20,764,754.13	30,195,647.48	50,960,401.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-9,886,170.87	-9,886,170.87
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）	-8,632,008.36	-8,969,113.56	-17,601,121.92
其中：1. 基金申购款	5,003,279.62	5,098,826.19	10,102,105.81
2. 基金赎回款	-13,635,287.98	-14,067,939.75	-27,703,227.73
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	12,132,745.77	11,340,363.05	23,473,108.82

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	60,491,582.57	41,685,746.07	102,177,328.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	35,190,100.02	35,190,100.02
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）	-39,726,828.44	-46,680,198.61	-86,407,027.05
其中：1. 基金申购款	56,444,267.88	82,301,730.20	138,745,998.08
2. 基金赎回款	-96,171,096.32	-128,981,928.81	-225,153,025.13
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	20,764,754.13	30,195,647.48	50,960,401.61

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	_____ 肖向辉
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 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、《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[2015]101 号及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。
6. 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，暂免予缴纳印花税、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
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
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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	395,546.84	1,340,607.62
其中：支付销售机构的客户维护费	151,008.46	223,240.64

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：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	65,924.42	223,434.54

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：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，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

本报告期及上年度可比期间，本基金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

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	2,397,608.62	17,879.62	2,292,210.97	54,235.24

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（2016 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

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
000711	京蓝科技	2016 年 10 月 20 日	重大事项	30.87	2017 年 03 月 13 日	29.29	37,000	971,219.47	1,142,190.00	-
002578	闽发铝业	2016 年 10 月 12 日	重大事项	11.93	-	-	60,000	685,787.00	715,800.00	-
603111	康尼机电	2016 年 12 月 26 日	重大事项	14.70	-	-	40,000	582,000.00	588,000.00	-

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 2016 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 2016 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

截止本年度报告报出日，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	15,230,356.25	61.81
	其中：股票	15,230,356.25	61.81
2	固定收益投资	5,049,360.00	20.49
	其中：债券	5,049,360.00	20.49
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	2,497,566.13	10.14
7	其他各项资产	1,863,514.45	7.56
8	合计	24,640,796.83	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	13,512,366.25	57.57

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	575,800.00	2.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,142,190.00	4.87
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	15,230,356.25	64.88

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	000711	京蓝科技	37,000	1,142,190.00	4.87
2	300401	花园生物	30,000	1,139,100.00	4.85
3	601689	拓普集团	38,000	1,117,960.00	4.76
4	002202	金风科技	60,000	1,026,600.00	4.37
5	600104	上汽集团	40,000	938,000.00	4.00
6	000400	许继电气	50,000	907,500.00	3.87
7	300444	双杰电气	30,000	720,000.00	3.07
8	002578	闽发铝业	60,000	715,800.00	3.05
9	300129	泰胜风能	79,955	699,606.25	2.98

10	600967	北方创业	50,000	678,500.00	2.89
----	--------	------	--------	------------	------

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

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	600622	嘉宝集团	2,455,739.18	4.82
2	000401	冀东水泥	2,346,429.51	4.60
3	002601	龙蟒佰利	2,071,201.00	4.06
4	000625	长安汽车	2,070,709.00	4.06
5	000983	西山煤电	1,927,746.00	3.78
6	600104	上汽集团	1,871,143.00	3.67
7	601633	长城汽车	1,846,947.00	3.62
8	300153	科泰电源	1,643,487.00	3.23
9	300197	铁汉生态	1,633,311.50	3.21
10	002421	达实智能	1,604,515.77	3.15
11	600171	上海贝岭	1,435,393.00	2.82
12	600155	宝硕股份	1,429,429.30	2.81
13	002458	益生股份	1,385,336.00	2.72
14	002145	中核钛白	1,363,764.00	2.68
15	002236	大华股份	1,359,359.00	2.67
16	300383	光环新网	1,355,335.08	2.66
17	000150	宜华健康	1,348,034.90	2.65
18	300129	泰胜风能	1,343,813.27	2.64
19	000959	首钢股份	1,319,990.00	2.59
20	002074	国轩高科	1,309,444.14	2.57
21	002286	保龄宝	1,296,759.98	2.54
22	601998	中信银行	1,296,000.00	2.54
23	002761	多喜爱	1,271,140.00	2.49
24	603558	健盛集团	1,268,512.00	2.49
25	600348	阳泉煤业	1,228,900.00	2.41
26	002368	太极股份	1,219,756.00	2.39

27	600138	中青旅	1,200,211.00	2.36
28	300274	阳光电源	1,192,242.00	2.34
29	600376	首开股份	1,180,246.00	2.32
30	601689	拓普集团	1,177,347.00	2.31
31	300032	金龙机电	1,177,200.00	2.31
32	600322	天房发展	1,177,012.54	2.31
33	002310	东方园林	1,176,394.00	2.31
34	000890	法尔胜	1,159,739.00	2.28
35	002746	仙坛股份	1,155,634.50	2.27
36	002299	圣农发展	1,146,519.00	2.25
37	300067	安诺其	1,092,400.00	2.14
38	600485	信威集团	1,087,328.00	2.13
39	300021	大禹节水	1,078,513.00	2.12
40	600688	上海石化	1,077,267.00	2.11
41	601001	大同煤业	1,059,540.00	2.08
42	000711	京蓝科技	1,049,967.00	2.06
43	002548	金新农	1,049,742.50	2.06
44	002618	丹邦科技	1,044,376.17	2.05
45	002188	巴士在线	1,044,220.00	2.05
46	300401	花园生物	1,039,583.14	2.04
47	002202	金风科技	1,021,375.00	2.00
48	300207	欣旺达	1,019,797.00	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	000401	冀东水泥	2,385,869.00	4.68
2	000018	神州长城	2,323,617.00	4.56
3	600622	嘉宝集团	2,279,576.31	4.47
4	002601	龙蟠佰利	2,267,502.65	4.45
5	000983	西山煤电	2,198,568.00	4.31
6	300429	强力新材	2,194,465.36	4.31

7	300153	科泰电源	2,089,628.00	4.10
8	000625	长安汽车	2,082,064.95	4.09
9	300012	华测检测	2,040,809.00	4.00
10	601633	长城汽车	1,951,056.00	3.83
11	000540	中天城投	1,773,562.00	3.48
12	600861	北京城乡	1,746,171.00	3.43
13	002145	中核钛白	1,673,100.00	3.28
14	300197	铁汉生态	1,642,382.61	3.22
15	002421	达实智能	1,622,146.39	3.18
16	002746	仙坛股份	1,597,791.30	3.14
17	600688	上海石化	1,503,200.00	2.95
18	600155	宝硕股份	1,492,786.00	2.93
19	603003	龙宇燃油	1,484,849.00	2.91
20	600171	上海贝岭	1,457,906.00	2.86
21	600735	新华锦	1,446,004.27	2.84
22	002286	保龄宝	1,414,955.00	2.78
23	002618	丹邦科技	1,358,999.10	2.67
24	002236	大华股份	1,354,947.00	2.66
25	300043	星辉娱乐	1,338,051.72	2.63
26	300021	大禹节水	1,315,741.00	2.58
27	000807	云铝股份	1,295,158.00	2.54
28	002761	多喜爱	1,289,663.00	2.53
29	000959	首钢股份	1,266,674.00	2.49
30	600348	阳泉煤业	1,265,439.00	2.48
31	002458	益生股份	1,264,329.00	2.48
32	601998	中信银行	1,260,000.00	2.47
33	600376	首开股份	1,242,721.00	2.44
34	300383	光环新网	1,233,330.00	2.42
35	601233	桐昆股份	1,218,558.08	2.39
36	600992	贵绳股份	1,200,200.00	2.36
37	300095	华伍股份	1,194,082.00	2.34
38	603558	健盛集团	1,173,682.50	2.30
39	000703	恒逸石化	1,162,938.00	2.28
40	002565	顺灏股份	1,162,791.00	2.28
41	300089	文化长城	1,153,359.00	2.26
42	002310	东方园林	1,152,687.46	2.26
43	600561	江西长运	1,147,718.00	2.25
44	000150	宜华健康	1,146,137.00	2.25

45	300274	阳光电源	1,134,711.00	2.23
46	600322	天房发展	1,126,280.00	2.21
47	300067	安诺其	1,081,528.47	2.12
48	600138	中青旅	1,046,851.00	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	174,821,922.67
卖出股票收入（成交）总额	184,585,283.98

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	3,789,360.00	16.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,260,000.00	5.37
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	5,049,360.00	21.51

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	019533	16 国债 05	30,000	3,000,000.00	12.78
2	122406	15 新湖债	12,500	1,260,000.00	5.37
3	019535	16 国债 07	8,000	789,360.00	3.36
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	55,987.25
2	应收证券清算款	1,704,868.84
3	应收股利	—
4	应收利息	97,735.88
5	应收申购款	4,922.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,863,514.45

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

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	000711	京蓝科技	1,142,190.00	4.87	重大事项
2	002578	闽发铝业	715,800.00	3.05	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

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
4,307	2,816.98	0.00	0.00%	12,132,745.77	100.00%

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	3,159.78	0.03%

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
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（2011年12月28日）基金份额总额	335,865,199.76
本报告期期初基金份额总额	20,764,754.13
本报告期基金总申购份额	5,003,279.62
减:本报告期基金总赎回份额	13,635,287.98
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	12,132,745.77

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

经本基金管理人第四届董事会第十六次临时会议决议，于 2016 年 3 月 16 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，陈振宇先生不再担任公司副总经理。

经本基金管理人第四届董事会第二十一临时会议及第五届董事会第一次会议决议，于 2016 年 8 月 19 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，孙晔伟先生不再担任公司总经理，崔伟先生代任公司总经理职务。

经本基金管理人第五届董事会第三次临时会议决议，于 2016 年 10 月 29 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，刘鸿鹏先生担任公司总经理职务，崔伟先生不再代任总经理职务。

本基金管理人已通过证监会指定报刊及本基金管理人网站对上述高级管理人员变更情况履行了信息披露义务，并在本基金及本基金管理人管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述高级管理人员变更情况。

本报告期内，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，北京市第二中级人民法院对一起原公司员工与公司之间的民事诉讼案件做出终审判决，判决公司支付原告部分劳动报酬并驳回原告的其他诉讼请求，该案已审理终结。

公司没有其他诉讼和仲裁情况。

本报告期，无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉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 50000 元；截至 2016 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 6 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	
国信证券股份有限公司	1	220,811,556.05	61.45%	201,225.91	60.93%	-
五矿证券有限公司	1	138,520,995.37	38.55%	129,004.66	39.07%	-

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资金雄厚，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		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
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	19,361,929.96	100.00%	-	-	-	-

东方基金管理有限公司
2017 年 3 月 27 日