

# 东方新思路灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告

2018 年 3 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年四月十九日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 4 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
| 基金简称            | 东方新思路灵活配置混合  |                  |
| 基金主代码           | 001384   |                  |
| 交易代码            | 001384   |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式   |                  |
| 基金合同生效日         | 2015 年 6 月 25 日  |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 557,523,755.29 份   |                  |
| 投资目标            | 本基金在有效控制风险的前提下，通过积极灵活的资产配置和组合精选，充分把握市场机会，追求基金资产的长期稳定增值。                        |                  |
| 投资策略            | 本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。 |                  |
| 业绩比较基准          | 3 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%  |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。                   |                  |
| 基金管理人           | 东方基金管理有限责任公司   |                  |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 东方新思路灵活配置混合 A  | 东方新思路灵活配置混合 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 001384   | 001385           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 317,543,983.20 份   | 239,979,772.09 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2018年1月1日—2018年3月31日） |                |
|-----------------|---------------------------|----------------|
|                 | 东方新思路灵活配置混合 A             | 东方新思路灵活配置混合 C  |
| 1. 本期已实现收益      | -10,028,933.04            | -7,569,743.50  |
| 2. 本期利润         | -10,914,912.42            | -8,211,967.39  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0332                   | -0.0338        |
| 4. 期末基金资产净值     | 270,334,694.39            | 202,035,692.40 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.8513                    | 0.8419         |

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方新思路灵活配置混合 A

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.11% | 1.41%     | 1.42%      | 0.02%         | -5.53% | 1.39% |

东方新思路灵活配置混合 C

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.20% | 1.41%     | 1.42%      | 0.02%         | -5.62% | 1.39% |

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

东方新思路灵活配置混合A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



东方新思路灵活配置混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名     | 职务                          | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明  |
|--------|-----------------------------|-------------|------------|--------|---|
|        |                             | 任职日期        | 离任日期       |        |   |
| 姚航(女士) | 本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员 | 2015年6月25日  | 2018年1月24日 | 14年    | 固定收益部副总经理，投资决策委员会委员，中国人民大学工商管理硕士，14年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基 |

|        |       |                 |   |   |   |
|--------|-------|-----------------|---|---|---|
|        |       |                 |   | <p>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 日起转型为东方成长收益平衡混合型基金)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、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任东方金账簿货币市场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、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。</p> |   |
| 王然(女士) | 本基金经理 | 2015 年 6 月 25 日 | - | 10 年  | <p>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</p> |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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, 现任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、东方合家保本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、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；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同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年 1 季度，市场出现了超预期的大幅波动，指数分化明显，风格出现切换迹象。

1 季度，上证综指-4.1%、深成指-2.6%，代表大盘和小盘的两个指数沪深 300 和创业板指分别-3.2%、+2.6%。指数差异化的走势显示了市场仍以存量资金博弈为主，主板与中小板此消彼长的特征明显。春节前后，在各种政策与舆论的引导下，市场风险偏好向成长股倾斜，近期市场也出现仓位转换的迹象，机构配置从消费与金融向更加均衡的仓位配置倾斜。

wind 统计数据显示，1 季度只有计算机和医药行业的收益率为正，分别为+9.1%和 1.6%，其中龙头公司的涨幅往往超过 20%。而其他行业均为下跌，其中跌幅最大的是采掘、综合和非银金融，分别-11%、-8.5%、-8.4%。板块的差异化也显示了市场资金流动的方向正在发生变化。特别是 3 月份，受益于政策的 TMT、医药板块以及军工板块领涨，涨幅超过 10%。

我们认为，1 季度市场大幅波动的直接原因是由于资本市场的国际化，资金联动效应的增强，导致在海外市场大幅波动或汇率大幅波动的情况下，传导效应更加明显。而风格出现切换迹象的逻辑还是传统价值股与成长股之间的估值剪刀差持续收窄，加之国家政策向一些新动能产业倾斜，而一些传统价值股也处在较高业绩预期能否兑现与较高估值水平能否匹配的调整阶段，需要时间验证和消化。

1 季度，伴随市场的调整，我们在守住部分消费股仓位的情况下，将配置由偏向金融消费向更加均衡的配置进行调整，在春节前后市场处于低位时进行了加仓，波段操作了受益于国家政策支持的新动能领域，从而使净值得到了一定的反弹。我们认为后续市场仍然会存在较大不确定性，波动幅度较高，因此目标仓位中性，警惕市场波动风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 3 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为-4.11%，业绩比较基准收益率为 1.42%，低于业绩比较基准 5.53%。本基金 C 类净值增长率为-4.20%，业绩比较基准收益率为 1.42%，低于业绩比较基准 5.62%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 377,749,514.73 | 77.75        |
|    | 其中：股票             | 377,749,514.73 | 77.75        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 36,014,400.00  | 7.41         |
|    | 其中：债券             | 36,014,400.00  | 7.41         |
|    | 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          | 39,520,219.76  | 8.13         |
|    | 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      | 30,835,191.94  | 6.35         |
| 8  | 其他资产              | 1,754,359.17   | 0.36         |
| 9  | 合计                | 485,873,685.60 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 6,462,500.00   | 1.37         |
| B  | 采矿业              | 37,824,000.00  | 8.01         |
| C  | 制造业              | 263,814,388.28 | 55.85        |
| 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           | 26,402.87      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 36,659.62      | 0.01         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 50,138,663.96  | 10.61        |
| J  | 金融业              | 12,144,500.00  | 2.57         |
| 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     | 7,302,400.00   | 1.55  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 377,749,514.73 | 79.97 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000661 | 长春高新 | 117,000   | 21,478,860.00 | 4.55         |
| 2  | 600547 | 山东黄金 | 700,000   | 20,328,000.00 | 4.30         |
| 3  | 600028 | 中国石化 | 2,700,000 | 17,496,000.00 | 3.70         |
| 4  | 600038 | 中直股份 | 360,000   | 17,406,000.00 | 3.68         |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药 | 170,000   | 14,791,700.00 | 3.13         |
| 6  | 300114 | 中航电测 | 1,200,043 | 14,376,515.14 | 3.04         |
| 7  | 600760 | 中航沈飞 | 400,000   | 13,792,000.00 | 2.92         |
| 8  | 002056 | 横店东磁 | 1,422,000 | 13,736,520.00 | 2.91         |
| 9  | 002439 | 启明星辰 | 501,000   | 13,707,360.00 | 2.90         |
| 10 | 600990 | 四创电子 | 240,000   | 13,672,800.00 | 2.89         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 36,014,400.00 | 7.62         |
|    | 其中：政策性金融债 | 36,014,400.00 | 7.62         |
| 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        | 36,014,400.00 | 7.62         |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 170410 | 17 农发 10 | 360,000 | 36,014,400.00 | 7.62         |
| 2  | -      | -        | -       | -             | -            |
| 3  | -      | -        | -       | -             | -            |
| 4  | -      | -        | -       | -             | -            |
| 5  | -      | -        | -       | -             | -            |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

本基金所持有的长春高新（000661）于 2017 年 6 月 15 日公告，公司涉及一项房屋所有权纠纷，该案已由长春市中级人民法院受理。案件内容为：“永长小区”项目是本公司的子公司一长

春高新房地产开发有限责任公司（原长春市高新建设开发公司）（以下简称“高新开发”）与长春市滨河物业开发有限公司（以下简称“滨河物业”）于 1999 年开始联合开发建设的房地产项目，当时合作确定由滨河物业出项目审批手续及少量现金，高新开发出资金。后由于滨河物业后续资金投入不足等自身原因，2006 年 10 月 9 日，双方经平等协商，签订了《永长小区项目清算及处理意见协议书》，明确约定永长小区剩余房屋由高新开发销售，销售收入归高新开发所有，滨河物业退出永长项目，该协议书经长春市中级人民法院终审判决、吉林省高级人民法院再审裁定确认为合法有效。截至 2008 年末，公司应收永长项目往来款 2,648.00 万元。《物权法》实施后，滨河物业债权人（非永长项目所涉）——长春东煤多种经营供销公司影城路经销部（以下简称“东煤公司”）以项目登记在滨河物业名下为由，从 2007 年 4 月开始，连续启动对永长小区房屋的查封、诉讼程序，目前已被长春市三家基层法院查封房屋 20 套，建筑面积 8,153 m<sup>2</sup>，公司已成立专门机构积极应对，我们正基于“永长小区系高新开发出资建设而原始取得房屋所有权、析产协议合法有效”和省、市、区三级法院的有效判决等事实和法律依据，出庭应诉抗辩，依法维护自身合法权益。2017 年 6 月 15 日，长春市中级人民法院经审理作出（2017）吉 01 民初 88 号民事一审判决书，驳回东煤公司的诉讼请求。东煤公司已于 2017 年 7 月 6 日向吉林省高级人民法院提出上诉。

公司公告以上纠纷不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的中航沈飞（600760）于 2017 年 7 月 29 日公告，公司涉及一项贷款纠纷，该案已由山东省威海市中级人民法院受理。案件内容为：“根据《民事起诉状》，中国工商银行文登支行分别于 1998 年 3 月 31 日、12 月 4 日、12 月 21 日及 2000 年 7 月 31 日与文登黑豹签订《借款合同》，并分别向文登黑豹发放借款 3,670 万元（1998 年 3 月 31 日）、28 万元（1998 年 12 月 4 日）、54 万元（1998 年 12 月 21 日）、507.5 万元（2000 年 7 月 31 日），以上债权金额总计 4,259.5 万元。2005 年 5 月 27 日，中国工商银行文登支行将上述债权转让给中国华融资产管理公司济南办事处，并于 2005 年 6 月 6 日在《大众日报》公告通知借款人。2007 年 8 月 13 日，中国华融资产管理公司济南办事处将上述债权转让给上海南龙投资有限公司，并于 2007 年 8 月 24 日在《经济导报》公告通知借款人。2016 年 12 月 6 日，上海南龙投资有限公司将上述债权转让给原告，并于 2016 年 12 月 15 日在《山东法制报》公告通知借款人。原告认为其依法对文登黑豹享有债权，文登黑豹未按期支付债务的行为构成违约，向山东省威海市中级人民法院提起民事诉讼。（二）诉讼请求及理由 1、诉讼请求（1）请求判令文登黑豹向原告偿还债务本金 4,259.5 万元并支付利息 1,664 万元。（2）请求判令本公司及其余被告对文登黑豹上述债务及利息不能清偿的部分承担补充赔偿责任。（3）本案受理费、保全费等涉诉费用由本案被告共同承担。2、理由根据《民事起

状》，与原告主张的诉讼请求相关的理由如下：（1）文登黑豹于 1996 年 10 月 25 日成立，原名山东文登文龙汽车（集团）有限公司，股东为山东文登汽车改装厂和山东文登此车改装厂工会。公司于 2013 年 6 月 13 日以 60 万元购买了文登黑豹的全部股权，成为文登黑豹唯一股东。（2）2015 年 8 月 28 日以前，文登黑豹为公司的全资子公司，注册资本为 2,000 万元。2015 年 8 月 28 日，本案第二、三被告对文登黑豹增资入股成为文登黑豹的股东；增资后，文登黑豹的注册资本由 2,000 万元增至 10,000 万元，其中，第二被告认缴新增注册资本 5,000 万元，第三被告认缴新增注册资本 3,000 万元，至今第二第三被告认缴的增资款未实缴到位。（3）第二被告为有限合伙企业，第五被告为第二被告的普通合伙人；第六、七、八被告为文登黑豹的董事、高级管理人员。根据《合同法》、《公司法》、《合伙企业法》、《证券法》、最高人民法院《关于适用若干问题的规定（三）》等相关法律之规定，文登黑豹应履行偿还借款本息的义务；第二、三被告因未履行出资义务，应当对文登黑豹所不能清偿的上述债务承担补充赔偿责任；公司作为文登黑豹的发起人应对第二、三被告所应承担的上述赔偿责任承担连带责任；第五被告作为第二被告（有限合伙企业）的普通合伙人，应当对第二被告所应承担的上述赔偿责任承担连带责任；第六、七、八被告作为文登黑豹的董事、高级管理人员，对文登黑豹未尽到其依法应附有的忠实义务和勤勉义务，亦应对文登黑豹所不能清偿的上述债务承担补充赔偿责任。上述诉讼请求与理由均为原告的主张，原告主张的事实与理由尚未经有权机关判决。2017 年 7 月 29 日，山东神娃企业管理咨询有限公司（以下简称“原告”）向山东省威海市中级人民法院递交民事起诉状，以企业借贷纠纷为由将本公司参股公司山东文登黑豹汽车有限公司（以下简称“文登黑豹”）列为第一被告、本公司列为第四被告、北京万盈世纪投资管理中心（有限合伙）列为第二被告、诚融投资管理（北京）有限公司列为第三被告、龙江（北京）投资基金有限公司列为第五被告、本公司经理王志刚列为第六被告、文登黑豹监事王立文列为第七被告、文登黑豹总经理荣浩列为第八被告进行起诉。2017 年 7 月 14 日，原告向山东省威海市中级人民法院提交《增加诉讼请求申请书》，在原诉讼请求基础上主张偿还涉案债权的利息部分。公司于近日收到山东省威海市中级人民法院送达的《增加诉讼请求申请书》。

同时，公司由于违反了未及时披露重大事项而被中国证监会予以处分。具体内容：经查，2016 年 12 月 30 日中航黑豹股份有限公司（以下简称“你公司”）控股子公司安徽开乐专用车辆股份有限公司与中航工业凯通（阜阳）车辆科技有限公司达成的金额 1,735.31 万元的两项专有技术独占使用许可交易属关联交易，但你公司未按规定履行审议程序，亦未及时履行信息披露义务。同时，结合公司 2017 年 4 月 1 日发布的《关于会计差错更正的公告》，显示 3 月 3 日发布的《2016 年年度报告》存在财务信息差错。公司上述行为，违反了《上市公司信息披露管理办法》（证监会

令第 40 号) 第二条相关规定, 相关责任人违反了第三条相关规定。根据《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第 40 号) 第五十九条的规定, 我局决定对你公司采取出具警示函的监管措施; 根据该办法第五十八条、第五十九条的规定, 我局决定对在上述事项中负有重要责任的董事长李晓义、总经理王志刚、财务负责人朱清海、董事会秘书严楠采取出具警示函的监管措施。你公司及相关责任人应引以为戒, 按照有关法律法规的规定, 切实做好公司内部控制及信息披露工作。

公司公告以上内容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。

本基金投资长春高新主要基于以下原因: 公司旗下的金赛药业是国内规模最大的基因工程制药企业和亚洲最大的重组人生长激素生产企业, 在生长激素领域具备渠道优势、产品优势, 业绩稳健增长, 具备长期投资价值。

本基金投资中航沈飞主要基于以下原因: 公司为我国歼击机主要生产厂商之一, 防务航空产品主要包括歼-11 系列、歼-15、歼-16 及 FC31。未来随着空中打击新体系的确立, 歼-16 或将与四代隐身战机组成多批次空中打击梯队, 该机型需求量将出现大幅上升。公司将受益于各型歼击机的持续列装, 航空装备业绩或将保持快速稳定增长。我们认为, 公司具备一定的投资价值。

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

### 5.11.2

本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的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 749,164.68   |
| 2  | 应收证券清算款 | 28,167.70    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 900,465.89   |
| 5  | 应收申购款   | 76,560.90    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,754,359.17 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 东方新思路灵活配置混合 A  | 东方新思路灵活配置混合 C  |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 354,093,516.92 | 255,867,039.37 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,399,601.44   | 10,122,403.28  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 38,949,135.16  | 26,009,670.56  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 317,543,983.20 | 239,979,772.09 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 一、《东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方新思路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

### 9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2018 年 4 月 19 日