(上接B38版)

电话:021-33768132
传真:021-33768132*802
客户服务电话:400-6767-523
网址:www.zzwealth.cn
83、奕丰金融服务(深圳)有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755- 89460507
传真:0755-21674453
客户服务电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
84、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人:高锋
联系人:李勇
电话:0755-83655588
传真:0755-83655518
客户服务电话:400-804-8688
网址:www.keynesaset.com
85、武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:孔繁
电话:027-87006003*8020
传真:027-87006010
客户服务电话:400-027-9899
网址:www.buyfunds.cn
86、济安财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
联系人:李海燕
电话:010-65309516
传真:010-65330699
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
87、金惠家保险代理有限公司
住所:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址:北京市朝阳门外大街18号丰联广场A座1009
联系人:胡明哲
电话:15810201340
传真:028-62825388
客服电话:400-8557333
网址:www.jhjhome.com
88、和合期货有限公司
住所:山西省太原市迎泽区菜园东街2号
办公地址:山西省太原市迎泽区菜园东街2号
联系人:张基甲
电话:0351-7342798
传真:0351-7342538
客服电话:0351-7342798
网址:www.jjin.hhqh.com.cn
89、天津市凤凰财富基金销售有限公司
住所:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
办公地址:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
联系人:孟媛媛
电话:18920017760
传真:022-23297867
客户服务电话:400-706-6880
网址:www.fhcfj.com
(三)份额登记机构
名称:东方基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人:崔伟
联系人:刘博睿
电话:010-66295824
传真:010-66578680
网址:www.orient-fund.com或www.df5888.com
(四)律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
联系人:吕红
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:吕红 黎明
(五)会计师事务所和经办注册会计师
名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市南京东路61号4楼
办公地址:北京市海淀区四四环中路16号院7号楼10层
法定代表人:朱建弟
联系人:朱锦梅
电话:010-68288868
传真:010-88210608
经办注册会计师:朱锦梅、赵立卿

五、基金名称和基金类型

(一)本基金名称:东方策略成长混合型开放式证券投资基金
(二)本基金类型:混合型
(三)基金运作方式:契约型、开放式

六、基金的投资目标和投资方向

(一)投资目标
本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司,分享国民经济快速发展带来的成长性收益,追求管理资产的长期稳定增值。
(二)投资范围
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于权证的比例为基金净资产的0%-3%),投资于债券资产的比例为基金资产的5%-40%。其中投资于现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的5%。
(三)投资理念
本基金通过分析宏观经济发展战略,确定基金重点投资的行业,在风险控制的框架之下进行积极主动的投资管理,自上而下配置资产,自下而上精选证券。

七、基金的投资策略

1、资产配置策略
本基金为“自上而下配置资产,自下而上精选证券”的混合型基金。本基金在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。
本基金在做类别资产的主动性配置时所考虑的因素主要有:整体市场估值水平、宏观经济运行状况、利率水平、国家政策以及本基金独有的对系统性风险的个性化判断。
在整体市场估值水平方面,本基金主要关注市场整体估值水平的高低以及市场整体盈利增长速度的高低;在宏观经济方面,本基金主要关注GDP、工业增加值以及社会商品零售总额的增长速度;在利率水平方面,主要关注由于市场收益率水平变化引起的资本成本的变化;在政策方面主要关注政府货币政策、财政政策以及其他产业政策的变动。
本基金还根据基金管理人的经验与国内证券市场的现状,利用自创的市场成长风险值对市场的系统性风险进行判断。市场成长风险值是根据本基金管理人开发的数量化模型得到的,该指标度量了市场成长性风险,值越高,市场成长风险越大,相反,值越小,市场成长风险越小。本基金根据市场成长风险值来判断风险区域,最后通过市场成长风险值的大小将市场划分为高风险区域、中风险区域和低风险区域。如市场成长风险值低于1,则判断市场为低风险区,如市场成长风险值高于1.5,则判断市场进入高风险区;在高风险区域适度减仓,在低风险区域适度加仓,在中风险区域中调整资产配置结构。
2、股票资产投资策略
(1)行业配置
本基金将依据宏观经济发展方向、国家重点投资支持领域来分析各个行业受益的程度,通过三重评价,即产业政策支持力度、受益大小、进入壁垒,来判断各个行业的受益大小与持续性,由专家打分的形式确定行业的配置。
本基金将定期或不定期全面审查重点投资的行业,并且根据宏观经济变化以及执行情况适时调整。
未来几年内将主要配置于以下相关行业:现代服务业与消费升级、先进制造业、节能与新能源、环保与循环经济、教育、农业、具有自主创新能力的生物医药、电子等行业内的上市公司。
(2)股票选择
本基金的择股范围将主要集中在受益于国家经济产业政策和重点投资支持的相关行业内的上市公司,尤其是此类行业中具有代表性、竞争力强的优势企业。
本基金认为受益于国家宏观经济发展战略的行业中最有可能产生成长性公司。本基金通过在受益于国家产业政策支持的行业中寻找成长性上市公司,进而分享国民经济高速增长带来的成长性收益。本基金还利用自创的成长风险值指标来指导投资、规避成长风险。
上市公司股票的成长风险值是根据GARP(Growth at Rational Price)理念,考虑了股票的价格、每股收益增长、每股现金流量、主营业务收入增长率、主营业务利润增长、净资产收益率、市净率等因素,通过模型优化得到的指标。该指标度量了股票成长性风险,值越高,股票的成长风险越大,相反,值越小股票的成长风险越小。
成长风险值指标计算公式如下所示:

$$GRV = \frac{G_1P_E+G_2P_B}{(1+G_3+G_4+G_5+G_6+G_7+G_8+G_9)}$$

其中$G_1,G_2,G_3,G_4,G_5,G_6,G_7$为常数,$G_8,G_9,G_{10},G_{11}$分别为主营业务收入、主营业务利润、每股收益、净资产收益率的平均增长率,PE为市盈率,PB为市净率。
为了增强本基金的个股精选及时机把握能力,将对由行业筛选出的股票以成长风险值为依据进行更深层次挑选,重点锁定150只个股,并在此基础上构建东方策略成长优选股票库,为管理人制定投资方案提供有效的决策依据。
本基金通过成长风险值控制成长风险,以合理的价格投资于优秀公司和/或相对价值低估的其他公司;通过组合投资有效分散风险,谋求基金资产长期稳定的增长。
在对股票进行评价时,除上述因素外,本基金还考虑以下相关因素:
①行业代表性:上市公司的总资产在整个行业占的比重,企业的业绩的变化能够反应这个行业的业绩变化;
②区域经济实力:如企业所属地域的人均GDP;
③公司背景及管理:包括公司的历史沿革、公司治理结构、体制与效率、决策层的素质和能力、激励机制、凝聚力、部门合作与协调、团队年龄结构、知识结构等;
④行业中的竞争地位:包括行业特性、行业近年来发展动态、行业的发展前景(替代产品的发展、国家特殊的行业政策、国际市场的变化情况等),公司在行业中的地位和竞争优势(如市场占有率变化等),公司有关经济效益指标与行业平均水平或相关公司的比较;
⑤业务分析:包括主要影响因素分析(原材料供应及市场情况、销售情况、产品技术含量和科研开发、主要竞争对手、产品价格);成本及利润分析(主要产品成项目的成本、生产能力、实际产销量、利润及毛利率、增长速度等等);投资项目分析(在建计划投资项目的产品市场、收益预测及主要影响因素、未来3年内新项目的利润贡献预测等)。
(3)股票组合构建
在构建股票组合时,基金经理将考虑以下因素:
①个股的相关性矩阵
基金经理通过个股间的相关性矩阵分析,尽量使组合内个股之间的相关性最小,达到分散投资从而分散风险的目标;
②行业的集中度
基金经理将根据对相关行业的把握,适当分散投资,避免选择的股票行业集中度过高。
3、债券资产投资策略和其他资产投资策略
(1)债券投资策略
本基金债券投资管理的目标是分散股票投资的市场风险,保持投资组合稳定收益和充分流动性。
在选择国债品种中,本基金将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合;在选择金融债、企业债品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例,捕捉其套利机会。
(2)权证投资策略
本基金的权证投资策略主要包括以下几个方面:
①本基金主要采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价,作为权证投资的价值基准;
②本基金将深入研究行权价格、标的价格和权证价格之间的内在关系,以利用非完全有效市场中的无风险套利机会;根据权证对应公司基本面的研究结值,结合权证理论价值进行权证的趋势投资;
③利用权证衍生工具的特性,本基金通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的;包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略等。
(3)资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析,把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

八、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:标普中国A股300指数税收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。
标普中国A股300指数采用国际上广泛使用的全球行业分类标准(GICS),选择中国A股市场中市值规模大、流动性强和基本因素良好的300家上市公司作为样本股,并根据自由流通市值加权计算。该指数编制方法清晰透明,具有独立性,符合国际标准,具有较强的公正性与权威性,能够反映A股市场总体发展趋势并具有良好的投资价值。
中证综合债指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,能够体现中国债券市场整体走势,反应本基金对债券配置的业绩。
若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,由基金管理人报中国证监会备案并及时公告。
法律法规另有规定的,从其规定。

九、基金的风险收益特征

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。

十、基金的投资组合报告

本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。
基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本报告中的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。
本投资组合报告所载数据截至2018年3月31日(财务数据未经审计)。
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	347,414,776.15	75.55
	其中:股票	347,414,776.15	75.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,879,000.00	6.50
	其中:债券	29,879,000.00	6.50
	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	40,000,140.00	8.70
	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	41,345,288.04	8.99
8	其他资产	1,228,102.37	0.27
9	合计	459,867,306.56	100.00

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(%)
A	农、林、牧、渔业	5,687,000.00	1.31
B	采矿业	35,076,000.00	8.05
C	制造业	231,156,105.08	53.08
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	46,675,908.58	10.72
J	金融业	10,953,700.00	2.52
K	房地产业	6,513,000.00	1.50
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	4,118,000.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	7,172,000.00	1.65
S	综合	-	-
	合计	347,414,776.15	79.77

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	120,000	22,029,600.00	5.06
2	600547	山东黄金	650,000	18,876,000.00	4.33
3	600028	中国石化	2,500,000	16,200,000.00	3.72
4	600276	恒瑞医药	160,000	13,921,600.00	3.20
5	002056	横店东磁	1,315,000	12,702,900.00	2.92
6	002153	石基信息	460,000	12,341,800.00	2.83
7	002439	启明星辰	440,000	12,038,400.00	2.76
8	600760	中航沈飞	340,000	11,723,200.00	2.69
9	002460	赣锋锂业	150,000	11,607,000.00	2.67
10	600038	中直股份	240,000	11,604,000.00	2.66

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(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,879,000.00	6.86
	其中:政策性金融债	29,879,000.00	6.86
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	29,879,000.00	6.86

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	170408	17农发08	200,000	20,000,000.00	4.59
2	160208	16国开08	100,000	9,879,000.00	2.27
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
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。
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。
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。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期内未投资股指期货。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期内未投资国债期货。
11、投资组合报告附注
(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)一一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㎡,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),以上借权金额总计4,259.5万元。2005年5月27日,中国工商银行文登支行将上述借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借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借权转让给原告,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《民事起诉状》,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,山东神蛙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泰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、北京万益世纪投资管理中心(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交易部依据基金的投资组合的指令,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。
(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。
(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	409,192.53
2	应收证券清算款	28,167.70
3	应收股利	-
4	应收利息	726,448.36
5	应收申购款	64,293.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,228,102.37

(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)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十一、基金的业绩

基金管理人依照格尽职守,诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
(一)基金净值表现
历史各时间段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	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
2008.06.03-2008.12.31	-14.61%	2.05%	-35.06%	2.12%	20.45%	-0.07%
2009.01.01-2009.12.31	67.65%	1.21%	61.47%	1.43%	6.18%	-0.22%
2010.01.01-2010.12.31	-1.66%	1.14%	-6.77%	1.10%	5.11%	0.04%
2011.01.01-2011.12.31	-10.95%	1.02%	-17.47%	0.91%	6.52%	0.11%
2012.01.01-2012.12.31	10.07%	0.93%	6.71%	0.88%	3.36%	0.05%
2013.01.01-2013.12.31	-1.96%	1.03%	-2.90%	0.96%	0.94%	0.07%
2014.01.01-2014.12.31	46.39%	0.88%	36.26%	0.84%	10.13%	0.04%
2015.01.01-2015.12.31	50.23%	2.97%	7.62%	1.70%	42.61%	1.27%
2016.01.01-2016.12.31	-17.07%	2.10%	-6.20%	0.94%	-10.87%	1.16%
2017.01.01-2017.12.31	15.26%	0.88%	17.17%	0.45%	-1.91%	0.43%
2018.01.01-2018.03.31	-4.47%	1.40%	-1.66%	0.82%	-2.81%	0.58%

(二)本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

十二、费用概览

(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金财产按划支付的银行费用;
4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
7、基金的证券交易费用;
8、在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。
9、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
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×年管理费率÷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
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,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
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×年托管费率÷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
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,支付日期顺延。
3、上述(一)中3到9项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
(四)不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。
(六)基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关规定以及《东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新,主要内容如下:
(一)在“重要提示”中,增加了《流动性风险管理规定》的相关内容并更新了“招募说明书有关财务数据和财务净值的截止日期”及“其他内容的截止日期”。
(二)在“第一部分 绪言”中,根据《流动性风险管理规定》对相关内容进行了更新。
(三)在“第二部分 释义”中,根据《流动性风险管理规定》对相关内容进行了更新。
(四)在“第三部分 基金管理人”中,对基金管理人的相关内容进行了更新。
(五)在“第五部分 相关服务机构”部分,更新了相关服务机构的信息。
(六)在“第七部分 基金份额的申购和赎回”中,根据《流动性风险管理规定》对相关内容进行了更新。
(七)在“第八部分 基金的投资”中,更新了“基金的投资组合报告”的内容,截止日期为2018年3月31日,该部分内容均按有关规定编制,并经本基金托管人复核,但未经审计。同时,根据《流动性风险管理规定》对相关内容进行了更新。
(八)在“第九部分 基金的业绩”中,该部分内容均按照有关规定编制,并经本基金托管人复核,但相关财务数据未经审计。
(九)在“第十一部分 基金资产估值”中,根据《流动性风险管理规定》对相关内容进行了更新。
(十)在“第十五部分 基金的信息披露”中,根据《流动性风险管理规定》对相关内容进行了更新。
(十一)在“第十六部分 风险揭示”中,增加了资金前端额度控制的相关风险提示。
(十二)在“第十九部分 基金托管协议的内容摘要”中,对相关内容进行了更新。
(十三)在“第二十一部分 其他应披露事项”中,更新了从上一次《招募说明书(更新)》截止日2017年12月3日到本次《招募说明书(更新)》截止日2018年6月3日之间的信息披露事项。
上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录东方基金管理有限责任公司网站www.orient-fund.com。

东方基金管理有限责任公司
2018年7月

证券代码:601801 证券简称:皖新传媒 公告编号:2018-028

安徽新华传媒股份有限公司2017年年度权益分派实施公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要内容提示:
●每股分配比例
A股每股现金红利0.170元
● 相关日期

股份类别	股权登记日	最后交易日	除权(息)日	现金红利发放日
A股	2018/7/24	-	2018/7/25	2018/7/25

● 差异化分红送转:否
一、通过分配方案的股东大会届次和日期
本次利润分配方案经公司2018年5月29日的2017年年度股东大会审议通过。本次股东大会决议公告已于2018年5月30日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》以及上海证券交易所网站www.sse.com.cn上。
二、分配方案
1.发放年度:2017年年度
2.分派对象:
截至股权登记日下午上海证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司(以下简称“中国结算上海分公司”)登记在册的本公司全体股东。
3.分配方案:
本次利润分配以方案实施前的公司总股本1,989,204,737股为基数,每股派发现金红利0.170元(含税),共计派发现金红利338,164,805.29元。本年度不进行资本公积转增、不派发股票股利.
三、相关日期

股份类别	股权登记日	最后交易日	除权(息)日	现金红利发放日
A股	2018/7/24	-	2018/7/25	2018/7/25

四、分配实施办法
1.实施办法
(1)无限售条件流通股的红利委托中国结算上海分公司通过其资金清算系统向股权登记日上海证券交易所收市后登记在册并在上海证券交易所各会员办理了指定交易的股东派发。已办理指定交易的投资者可于红利发放日在其指定的证券营业部领取现金红利,未办理指定交易的股东红利暂由中国结算上海分公司保管,待办理指定交易后再进行派发。
(2)派送红股或转增股本的,由中国结算上海分公司根据股权登记日上海证券交易所收市后登记在册股东持股数,按比例直接计入股东账户。
2.自行发放对象
股东安徽新华发行(集团)控股有限公司和新华文轩出版传媒股份有限公司所持股份的现金红利由公司直接发放。
3.扣税说明
(1)对于持有公司股份的个体股东及证券投资基金,根据《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〔2012〕85号)》和《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)》有关规定,持股期限在1个月以内