东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金
2015年半年度报告
（摘要）

2015年6月30日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2015年8月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会、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。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 21 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。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红睿丰混合
场内简称	东证睿丰
基金主代码	169101
前端交易代码	169101
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2014 年 9 月 19 日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,610,160,711.75 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-03-06

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长的成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	上海东方证券资产管理有	招商银行股份有限公司

		限公司	
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	95555
传真		021-63326981	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金半年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	697,480,489.34
本期利润	951,071,239.23
加权平均基金份额本期利润	0.5907
本期基金份额净值增长率	54.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.4382
期末基金资产净值	2,682,650,866.33
期末基金份额净值	1.666

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日；“本期”指 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日。

2、上述基金业绩指标不包括基金份额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、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。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰

低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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
过去一个月	-4.36%	2.68%	0.30%	0.01%	-4.66%	2.67%
过去三个月	22.59%	2.19%	0.88%	0.01%	21.71%	2.18%
过去六个月	54.60%	1.87%	1.84%	0.01%	52.76%	1.86%
自基金合同生效起至今	74.08%	1.60%	3.05%	0.01%	71.03%	1.59%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2014 年 9 月 19 日-2015 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金合同生效后三年内（含三年）为封闭期，本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后），其中，三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，封闭期内 t 日收益率（$benchmark_t$）按下列公式计算：

$benchmark_t$ =100% *[t 日三年期银行定期存款利率（税后）/365]

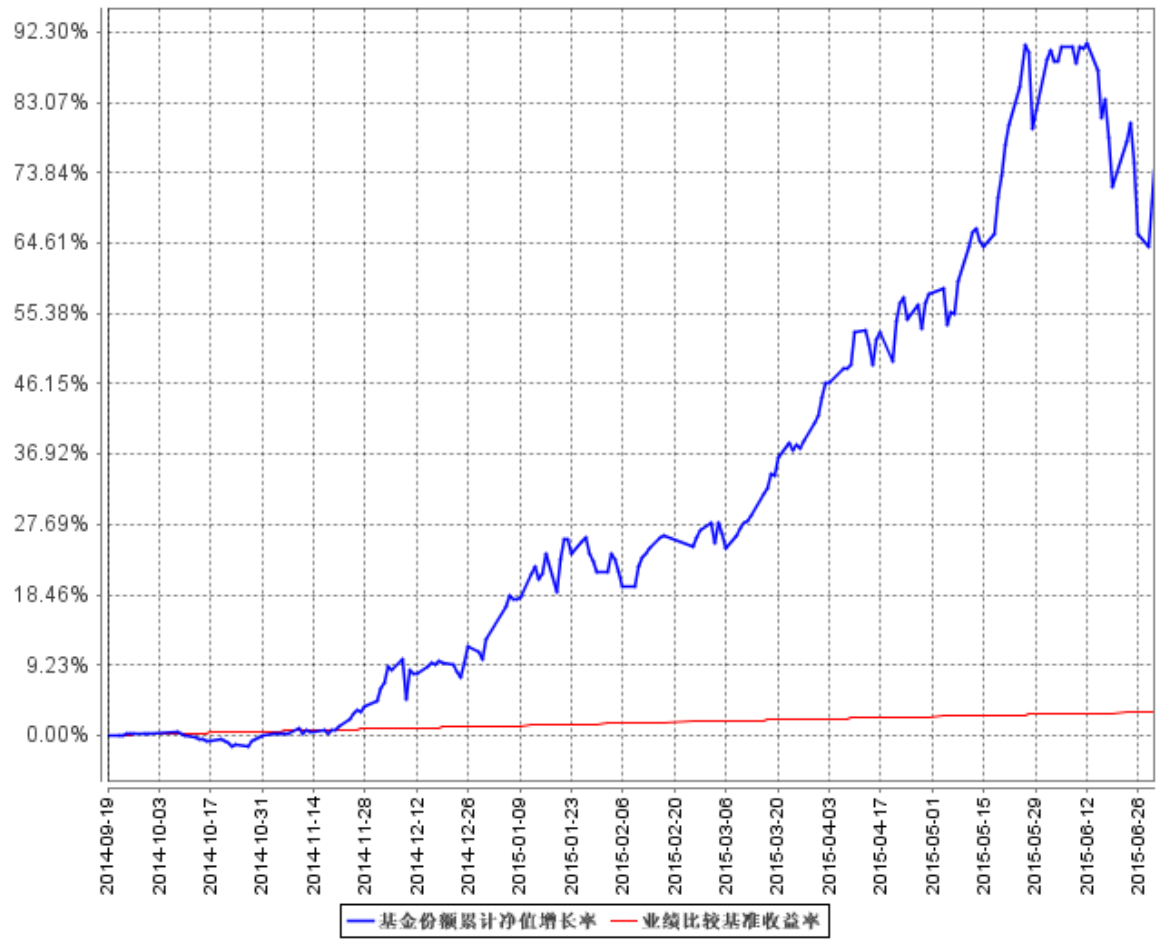
其中，t=1,2,3,．．．T，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（$benchmark_t^T$）按下列公式计算：

$benchmark_t^T$ =[$\prod_t^T$(1+$benchmark_t$)]-1

其中，T=2,3,4,．．．；$\prod_t^T$(1+$benchmark_t$)表示 t 日至 T 日的(1+$benchmark_t$)数学连乘。

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



注：1、截止日期为 2015 年 6 月 30 日，自基金合同生效日起至截止日，本基金成立尚不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2014 年 9 月 19 日起至 2015 年 3 月 18 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券

投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金十只证券投资基金。

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		
杨达治	本基金基金经理兼任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014 年 9 月 19 日	-	13 年	硕士，曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部研究员；东方基金有限责任公司研究部研究员；东方证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理；上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、研究部副总监兼投资经理、执行董事；现任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监兼东方红新动力、东方红产业升级、东方红睿丰、东方红睿元、东方红中国优势基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

林鹏	本基金基金经理兼东方证券资产管理有限公司执行董事、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理	2014 年 9 月 25 日	-	17 年	硕士，曾任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿丰、东方红睿阳、东方红睿元、东方红领先精选、东方红稳健精选、东方红睿逸基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
刚登峰	本基金基金经理兼任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理	2015 年 5 月 5 日	-	6 年	硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资经理助理，资深研究员、投资主办人；现任公募权益投资部基金经理。具有基金从业

					资格，中国国籍。

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 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

今年上半年以互联网为代表的创业板出现了大幅的上涨，而去年四季度对指数贡献巨大的蓝筹股显著的滞涨。我们认为，牛市中各板块出现此起彼伏的轮动是正常现象，在这样的盈利效应之下，得以吸引各路资金大量流入股市。从各行业的估值看，大多数的行业板块都从牛市初期的低估转变为合理估值水平甚至是显著高估，因此，以估值修复为显著特点的牛市初期显然已经结

束，未来的行情走向何方的核心因素应当是能否有持续不断的资金流入。好在当前经济增幅仍处低位，房地产市场也没有明显的起色，因此国内资金流向仍是以股市作为首选。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.666 元，份额累计净值为 1.717 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 54.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们依然谨慎看好市场的长期走势。虽然仅仅半年多的时间，中国股市就从全球股市的估值洼地一跃而起，但我们依然认为通过加大对优秀公司的投资力度是大概率的盈利之道。即使在目前已经普遍高估的上市群体中，一部分优秀的国内龙头企业仍然拥有良好的经营成长性以及合理的股票价格，值得我们花更多的时间去研究以及长期持有。未来的世界必然是互联网的天下，我们并不认为过去做得优秀的企业一定会在互联网浪潮之下掉队，相反，由于拥有优秀且进取的管理层以及大量优质人才，我们看好这些企业利用互联网提升国际竞争力，去获取更大的市场空间。值得警惕的倒是相当一批数量的伪互联网股票，虽然喊出了豪情万丈的转型口号，但这个群体中的大多数公司只是把互联网作为炒作的题材，这与 2000 年的互联网泡沫并无二致，击鼓传花的游戏正在如火如荼的进行着，对此我们应该抱有谨慎的心态。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策会议成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金对 2014 年利润进行的收益分配如下：2015 年 1 月 15 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.51 元，共计派发红利 82,118,195.48 元（均为现金红利发放形式）。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	167,655,836.99	144,433,282.95
结算备付金	82,701,306.79	27,295,265.40
存出保证金	2,031,055.33	357,761.32
交易性金融资产	2,389,168,494.46	1,674,011,787.26
其中：股票投资	2,381,106,695.66	1,556,699,482.86
基金投资	-	-
债券投资	8,061,798.80	117,312,304.40
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	47,256,000.00	1,100,758.07
应收利息	58,655.86	491,197.31
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	48,903.74	-
资产总计	2,688,920,253.17	1,847,690,052.31
负债和所有者权益	**本期末 2015 年 6 月 30 日**	**上年度末 2014 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	-	29,405,566.72
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,453,188.09	2,229,225.30
应付托管费	575,531.35	371,537.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,101,818.68	1,859,900.16
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	138,848.72	126,000.00
负债合计	6,269,386.84	33,992,229.73
所有者权益：		
实收基金	1,610,160,711.75	1,610,160,711.75
未分配利润	1,072,490,154.58	203,537,110.83
所有者权益合计	2,682,650,866.33	1,813,697,822.58
负债和所有者权益总计	2,688,920,253.17	1,847,690,052.31

注：

报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.666 元，基金份额总额 1,610,160,711.75 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金
本报告期： 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	986,761,967.67
1.利息收入	1,321,598.95
其中：存款利息收入	827,923.44
债券利息收入	16,138.52
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	477,536.99
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	731,849,618.83
其中：股票投资收益	642,968,690.88
基金投资收益	-72,889.04
债券投资收益	28,716,771.91
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	41,939,340.00
股利收益	18,297,705.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	253,590,749.89
4. 汇兑收益 （损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-

减：二、费用	35,690,728.44
1．管理人报酬	16,842,443.11
2．托管费	2,807,073.86
3．销售服务费	-
4．交易费用	15,605,444.65
5．利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6．其他费用	435,766.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	951,071,239.23
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	951,071,239.23

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	1,610,160,711.75	203,537,110.83	1,813,697,822.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	951,071,239.23	951,071,239.23
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-82,118,195.48	-82,118,195.48
五、期末所有者权益（基金净值）	1,610,160,711.75	1,072,490,154.58	2,682,650,866.33

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈光明	任莉	詹朋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]720 号文)核准，由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2014 年 9 月 19 日生效。本基金为契约型基金，基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式（LOF），存续期限不定期。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于 2014 年 8 月 25 日至 2014 年 9 月 12 日向社会公开募集，扣除认购费后的有效认购资金 1,609,220,897.11 元，利息转份额 939,814.64 元，募集规模为 1,610,160,711.75 份。上述募集资金已由立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿丰灵活配置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，包括国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（含中小企业私募债）、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债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的相关规定）。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。本基金转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，封闭期内股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，封闭期内不受上述 5%的限制。

本基金的业绩比较基准为：本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致，所采用的会计估计不完全一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，2015 年 3 月 30 日起，对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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》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营业税征收范围,不征收营业税。

（2）基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税。持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息、红利收入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，暂减按 25%计入应纳税所得额。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,暂不征收企业所得税。

（4）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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券	10,095,691,888.26	99.24%

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券	125,001,213.20	100.00%

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东方证券	1,983,000,000.00	100.00%

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金成交金额	占当期基金 成交总额的比例
东方证券	7,223,110.96	100.00%

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.2 权证交易 注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东方证券	9,190,405.21	99.43%	2,049,061.26	97.49%

注：1、本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

2、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3、本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，此事已向中国证监会报告，并等待进一步指示与解决；截至报告期末，本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,842,443.11
其中：支付销售机构的客户维护费	8,237,553.69

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺

延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

3、本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,807,073.86

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期

顺延。

2、本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	167,655,836.99	626,015.81

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同生效日为 2014 年 9 月 19 日，无上年度可比期间数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 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
002159	三特索道	2014 年 11 月 3 日	2015 年 11 月 5 日	非公开发行流通受限	22.50	22.39	2,000,000	45,000,000.00	44,780,000.00	-

6.4.9.2 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
002292	奥飞动漫	2015 年 5 月 18 日	重大事项停牌	37.27	-	-	4,883,372	103,681,278.65	182,003,274.44	-
000889	茂业物流	2015 年 6 月 3 日	重大事项停牌	17.97	2015 年 8 月 4 日	20.70	1,278,333	26,858,780.20	22,971,644.01	-
002223	鱼跃医疗	2015 年 6 月 25 日	重大事项停牌	67.20	2015 年 7 月 13 日	60.48	107,504	4,996,853.72	7,224,268.80	-
000566	海南海药	2015 年 6 月 18 日	重大事项停牌	49.97	-	-	138,500	6,494,133.50	6,920,845.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（b）持续的以公允价值计量的金融工具

（i）各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,125,268,462.21 元，属于第二层次的余额为 263,900,032.25 元，无属于第三层次的余额。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次，本期未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

（ii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

（iii）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（c）非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

（d）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	2,381,106,695.66	88.55
	其中：股票	2,381,106,695.66	88.55
2	固定收益投资	8,061,798.80	0.30
	其中：债券	8,061,798.80	0.30
	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	250,357,143.78	9.31
7	其他各项资产	49,394,614.93	1.84
8	合计	2,688,920,253.17	100.00

7.2 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	1,566,536,862.71	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	235,260.00	0.01
E	建筑业	2,704,845.00	0.10
F	批发和零售业	22,971,644.01	0.86
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	121,995,380.76	4.55
J	金融业	356,035,674.70	13.27

K	房地产业	265,847,028.48	9.91
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	44,780,000.00	1.67
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	2,381,106,695.66	88.76

7.3 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	002415	海康威视	6,210,587	278,234,297.60	10.37
2	000002	万　科Ａ	18,309,024	265,847,028.48	9.91
3	600066	宇通客车	10,818,750	222,325,312.50	8.29
4	600276	恒瑞医药	4,343,564	193,462,340.56	7.21
5	002292	奥飞动漫	4,883,372	182,003,274.44	6.78
6	600271	航天信息	2,312,019	149,610,749.49	5.58
7	000858	五 粮 液	4,546,337	144,118,882.90	5.37
8	600196	复星医药	4,639,264	134,260,300.16	5.00
9	601318	中国平安	1,537,558	125,987,502.52	4.70
10	300017	网宿科技	2,628,078	121,995,380.76	4.55

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半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000002	万　科Ａ	308,063,694.18	16.99
2	601318	中国平安	304,809,968.43	16.81
3	601988	中国银行	228,985,822.39	12.63
4	600019	宝钢股份	217,186,405.70	11.97
5	300017	网宿科技	212,489,353.24	11.72
6	601169	北京银行	205,781,229.09	11.35
7	601336	新华保险	192,605,910.73	10.62
8	000001	平安银行	179,053,500.02	9.87
9	600690	青岛海尔	159,853,372.57	8.81
10	000848	承德露露	154,748,256.25	8.53
11	000858	五 粮 液	145,567,382.03	8.03
12	000651	格力电器	139,291,052.58	7.68
13	600309	万华化学	138,076,157.54	7.61
14	600276	恒瑞医药	123,217,468.67	6.79
15	002292	奥飞动漫	120,637,725.65	6.65
16	601398	工商银行	115,930,183.08	6.39
17	600066	宇通客车	100,598,827.17	5.55
18	600352	浙江龙盛	79,104,186.00	4.36
19	002415	海康威视	73,418,502.45	4.05
20	600030	中信证券	71,403,917.38	3.94
21	601818	光大银行	68,240,358.83	3.76
22	600535	天士力	62,896,999.58	3.47
23	600196	复星医药	61,000,598.33	3.36
24	002594	比亚迪	58,226,386.77	3.21
25	300186	大华农	57,313,668.63	3.16
26	000100	TCL 集团	52,384,958.86	2.89
27	002475	立讯精密	51,979,564.36	2.87
28	300228	富瑞特装	50,647,270.21	2.79
29	601021	春秋航空	48,704,537.09	2.69
30	603898	好莱客	48,675,241.85	2.68
31	002153	石基信息	48,065,110.13	2.65
32	600267	海正药业	47,846,970.00	2.64
33	603899	晨光文具	44,629,322.00	2.46
34	002550	千红制药	42,665,275.98	2.35

35	002572	索菲亚	41,534,932.12	2.29
36	600804	鹏博士	41,296,406.38	2.28
37	600519	贵州茅台	40,756,216.64	2.25
38	600703	三安光电	40,596,754.51	2.24
39	600887	伊利股份	38,872,709.77	2.14
40	002304	洋河股份	38,856,921.90	2.14

注："本期累计买入金额" 按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600690	青岛海尔	359,135,116.34	19.80
2	601318	中国平安	350,035,526.40	19.30
3	600019	宝钢股份	303,858,877.09	16.75
4	601988	中国银行	224,821,304.61	12.40
5	000651	格力电器	208,966,592.07	11.52
6	000848	承德露露	157,245,410.25	8.67
7	600271	航天信息	135,545,906.46	7.47
8	002415	海康威视	126,306,372.07	6.96
9	601336	新华保险	118,501,188.42	6.53
10	601169	北京银行	115,477,866.62	6.37
11	601398	工商银行	113,257,804.74	6.24
12	002475	立讯精密	105,675,901.82	5.83
13	300017	网宿科技	103,633,071.22	5.71
14	000001	平安银行	101,738,164.16	5.61
15	600352	浙江龙盛	96,158,536.73	5.30
16	603288	海天味业	92,843,380.29	5.12
17	002202	金风科技	87,186,003.63	4.81
18	600016	民生银行	85,505,824.93	4.71
19	600030	中信证券	81,350,523.18	4.49
20	002311	海大集团	81,170,305.10	4.48
21	601058	赛轮金宇	76,779,936.81	4.23
22	601818	光大银行	70,120,708.20	3.87
23	601021	春秋航空	69,343,155.46	3.82
24	300228	富瑞特装	69,002,785.43	3.80

25	600309	万华化学	66,376,506.29	3.66
26	600196	复星医药	65,199,462.34	3.59
27	600535	天士力	63,751,794.68	3.52
28	603898	好莱客	63,493,257.74	3.50
29	002550	千红制药	63,273,276.43	3.49
30	002594	比亚迪	61,883,235.37	3.41
31	603899	晨光文具	58,856,528.20	3.25
32	000002	万　科A	55,550,051.60	3.06
33	002153	石基信息	53,397,545.16	2.94
34	000550	江铃汽车	52,927,487.66	2.92
35	601328	交通银行	51,607,484.99	2.85
36	600183	生益科技	50,171,327.64	2.77
37	000100	TCL 集团	49,870,658.00	2.75
38	002572	索菲亚	49,700,371.94	2.74
39	600267	海正药业	42,075,683.17	2.32
40	600804	鹏博士	41,948,955.92	2.31
41	600703	三安光电	40,971,382.93	2.26
42	600519	贵州茅台	40,566,387.56	2.24
43	002304	洋河股份	37,831,552.10	2.09
44	600077	宋都股份	37,129,058.55	2.05

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	5,041,588,818.55
卖出股票收入（成交）总额	5,132,716,370.48

注：“买入股票成本（成交）总额” 和“卖出股票收入（成交）总额”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。

7.5 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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,061,798.80	0.30
8	其他	-	-
9	合计	8,061,798.80	0.30

7.6 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	110031	航信转债	55,480	8,061,798.80	0.30

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明

公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					41,939,340.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末无股指期货持仓。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。 基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本期，本基金持有的中国平安旗下子公司平安证券于 2014 年 12 月 8 日收到中国证监会行政处罚决定书（2014 年 103 号），因平安证券出具的保荐书存在虚假记载及未审慎核查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性，中国证监会依据《证券法》对其处以行政处罚措施。

本基金管理人一直遵循价值投资的理念进行投资决策，对上述股票继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余九名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	2,031,055.33
2	应收证券清算款	47,256,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	58,655.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	48,903.74
8	其他	-
9	合计	49,394,614.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 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	002292	奥飞动漫	182,003,274.44	6.78	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
10,645	151,259.81	13,946,544.72	0.87%	1,596,214,167.03	99.13%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国通用技术（集团）控股有限责任公司	10,685,830.00	18.19%
2	常德华	4,929,708.00	8.39%
3	肖忠波	1,478,305.00	2.52%
4	招商财富－光大银行－多元投资 3 号资产管理计划	1,009,013.00	1.72%
5	东野尚丽	1,000,145.00	1.70%
6	郑光辉	1,000,116.00	1.70%
7	泰康人寿保险股份有限公司－万能－个险万能（乙）	1,000,000.00	1.70%
8	林鹏	995,067.00	1.69%
9	修清玉	700,081.00	1.19%
10	陈金霞	600,000.00	1.02%

注：上述持有人为本基金本报告期末场内份额持有人。

8.3 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	1,604,749.38	0.0997%

8.4 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2014 年 9 月 19 日 ）基金份额总额	1,610,160,711.75
本报告期期初基金份额总额	1,610,160,711.75
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	1,610,160,711.75

注：总申购份额含红利再投份额（本基金暂未开通基金转换业务）。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本基金管理人于 2015 年 5 月 5 日发布公告，自 2015 年 5 月 5 日起增聘刚登峰先生担任本基金的基金经理。

本基金管理人于 2015 年 5 月 22 日发布公告，自 2015 年 5 月 21 日起免去钱慧同志公开募集基金业务合规负责人（督察长）的职务，并任命陈光明同志代行公开募集基金业务合规负责人（督察长）职责。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
东方证券	2	10,095,691,888.26	99.24%	9,190,405.21	99.43%	-
广发证券	1	77,029,237.88	0.76%	52,757.42	0.57%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）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：（1）选择标准：券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金本报告期内租用交易单元的变更情况：新增广发证券深圳交易单元。

4、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，此事已向中国证监会报告，并等待进一步指示与解决；本公司已在深证交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

10.7.2 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		基金交易		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	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	125,001,213.20	100.00%	1,983,000,000.00	100.00%	7,223,110.96	100.00%	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

上海东方证券资产管理有限公司
2015 年 8 月 27 日