

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 送出日期:二〇一五年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事保证本报告所教资料不存在虚假记载、良性性殊述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性和个别及整带的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。 版明 经基金任何 人中国民生银行股份有限公司根据本基金信周规定,于2015年3月201豆糕了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配品及财务支付报告、投资组合股告等内容,使现货机均等不存在撤记或、设等保护法或者重大遗漏。基金管理人承诺以该定信用,勤慰尽资的规则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利。基金的过生地量并不代表其未来被制。投资有风险人设置在作出投资液液面定行细速体基金的招募设明书及其更新。

近日支打地域 現前,預貨養者主意阅读。 本报告期已204年0月9日起至12月31日止。 本年度报告論要摘自年度报告正文,投資者欲了解详細内容,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	东方精选混合			
基金主代码	400003			
前端交易代码	400003			
后端交易代码	400004			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2006年1月11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		
报告期末基金份额总额	3,774,598,002.5269			
基金合同存续期	不定期			
2.2 基金产品说明				
投资目标		深人研究中國经济高速增长的根本动力, 重点投资于高速成长的优质上市公司,努力使基金份额持有人最大限度的分享中国经济的高速增长。		
投资策略		本基金的投资管理由自上而下的大类资产配置和自下而上的精选个股(包括债券)、行业优化组成。		
业绩比较基准	比较基准,选择中信标普 对于权重配置,作: 95%,一般情况下为6006(%, 准=中信标普3006(长指) 如果今后法律法规》	根据基金的特定。选择中信标等2000米指数件为本基金度需部分的业性较高速。选择中信标等金值银额的力量及使用部分自我使用部分直接的基础。 对于权重配置,作为一只混合型基金、股票最低仓位为200%。最高95%—一物配了为60%。因此本基金的业绩比较基本办。本基金业绩比较基本中信标普2000亩长指数900%—中信标音金指数940%。如果今后还将还规及主意化。或者有更成前,更能力市场普遍接受的重线较基础。本基金则以整金量比较基础。		
风险收益特征	股票型基金、单纯的债券	&中的中等风险品种,其风险收益特征介于单纯的型基金与单纯的货币市场基金之间,同时其股票组 包介于完全成长型股票组合与完全价值型股票组合		
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	中国民生银行股份有限公司		
tot de		To be and the		

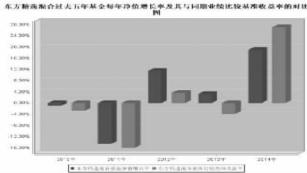
本基金管理人及本基金托管人住 § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配债况

3.1 主要会计数据和财务指标			金额单位:人民市
3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	398,402,950.02	107,964,017.32	-244,312,606.19
本期利润	825,886,532.99	164,665,470.30	576,742,618.68
加权平均基金份额本期利润	0.1907	0.0324	0.0965
本期基金份額净值增长率	18.98%	3.23%	11.52%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份額利润	0.4761	0.3775	0.3553
期末基金资产净值	4,666,610,610.58	4,835,342,537.85	5,872,119,421.15
期末基金份額净值	1.2363	1.0391	1.0066
注:①本期已实现收益指基金本期末 期已实现收益加上本期公允价值变动 ②期末可供分配利润;如果期末未分 里期末去公配利润的土壤和知公公公	收益。 分配利润的未实现部分为正数	7,则期末可供分配利润的金额>	5期末未分配利润的已实现部

展期末来分配利期的未实现部分分价款。则期末可採分配利润的金融为期末来分配利润(已实现部分和除未实现企本基金所定域指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用;认费用后实际收益水平要低于所列数字 3.2 基金价值表现 3.2 基金价值存现

份額净值增 长率(D) 份额净值增 长率标准差 业绩比较基 准收益率(3)

过去三个月	0.28%	1.40%	19.44%	0.87%	-19.16%	0.53
过去六个月	14.05%	1.18%	30.93%	0.71%	-16.88%	0.47
过去一年	18.98%	1.18%	27.02%	0.70%	-8.04%	0.48
过去三年	36.97%	1.07%	26.55%	0.78%	10.42%	0.29
过去五年	15.88%	1.12%	3.47%	0.83%	12.41%	0.29
自基金合同生效起至今	450.97%	1.55%	133.01%	1.11%	317.96%	0.44
392.00%	/VA					I.
302,00%	11/4	١.	1 60	A 10	1	
343,84%	of to	1.1	H M	WW WY	WYW	W.
294,72%	1 K	W	W	Α.	W/ .	
275.83%	14	1				
110.10%	. 7	V				
1 2	10 A A	JT .				



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。

姓名	64-72	职务	社 - 本 並 的 本 並 於 理 (助 理) 期 限		证券从业年限	说明	
	XIAD	801.737	任职日期	离任日期	BL 27-35 SE 41-PK	100 993	
	呼振翼(先 生)	本 基 金 基投 金经理、投资 决策 货 员会委员	2013年1月4日	-	18年	如特然你贸易大学经济学硕士、18年证券从业经 项。曾在高级运用公司设货管理。——1887证6 对。 设住高级运用公司设货管理。——1887证6 对。 设货经理。海南证券研究员、测财证券研究员、现货 理拟部经理,民业证券研究员、行业组长、2000年 5月加盟东方基金管理有限责任公司、偿任研究部 研究员、东方额股票、现任投资政策委员会委员、东方精 全混合型形成工券投资基金经理,成为标 业品企业开发大证券投资基金基金经理,然为 新兴成长港企业券投资基金基金经理。东方 新兴成长港企业券投资基金基金经理。东方	
	邱义鹏(先 生)	本基金基金经理助理	2014年4月17日	-	6年	唐年大学材料科学与工程硕士,6年证券从业处历,曾任据实施金医药行业研究员助理、长城证券医药 行业研究员。2010年8月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部医药生物,建筑材料,建筑 、建筑成本、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、企业、	
	于鑫 (先 生)	本金经投委员 基经理资员 本金经投委员	2013年1月4日	2014年1月30日	13年	海中大学MRA CPA,15年证券从多些影 每年世 乾证券有限公司资产管理和投资性,200年加盟 东方基金管理者限责任公司,曾任基金管理和经 限党国总是,投资自显、投资和 投资上度,投资自显、投资和 投资上度,发行自显、投资。 成为精金证券的营业 成力基金等的干场证金等等的干场证金等设势基 基金经理,现任总等市场理,投资大营等局会委员, 东方是混合管理的发现。由于发展等的大量等局。 第一方是混合管理,现任总等市场,是有是是一个 等的发展的发展。	
	朱晓栋(先 生)	本 基 金 基 金经理	2013年1月23日	2014年1月30 日	5年	料外经清效易大学经济等证上。5年证券从业经历 2000年12月加盟东方金金增加农用任公司。 研究配金编行业。图证收益研究。企品饮料行业。建筑 建材行业研究员、库方龙海仓争扩张式证券投资 基金基金经理助理。东方精选混合每开放式证券投资 投资基金基金经理,现任东方列推合包型和发生券投资 投资基金基金经理,或有效心或益标准治包证证 设资基金基金经理,成为有效。	

注:①此处的任职日期和废任日期分别指根据公司决定确定的得任日期和审判目 注:①此处的任职日期和废任日期分别指根据公司决定确定的得任日期和审判目 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。 2. 管理人对税等期内本签定产遵理气管结论的规则 本基金管理人在本程序制内严格遵守(中华人民共和国证券法)、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理人管理办法》,是《证券与家法推阅》、《估方特施法仓母开放汇证券投资基金基金合同》,和北他有关法律法规的规定、本着破定信用、勒 尽责的原则管理和运用基金资产。在严格处制风险的基础上,步振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 - 本基金主张工法法。进程行为。本基金投资组合符合有关注规及基金合同的约定。 4.3 管理人对报告期内公平支房情况的专项说明

为。本基金无重大进法、逻辑行为。本基金投资组合付合有大区观及企业中90999元。
4.3 管理人材报告期内公平交易情况的专项原则
4.3 公平交易制度的转取的方法
基金管理人报报中国际金统师的《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(东方基金管理有限担任公司公平交易管理制度)。
基金管理人提取了以下发动策解的。
基金管理人提立了投资政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、各投资组合来享研究
平台、在联税投资信息,投资监议和实施投资决策方面享有公平的创会。
基金管理人执行交易系统中的公平交易相称。对于债券一级市场申询、企开发行股票申询等非集中变价交易、各投资组合经现
5. 基金管理人执行交易系统中的公平交易程序、对于债券一级市场申询、企开发行股票申询等非集中变价交易、各投资组合经现
在发易销金上检查化多发射体的交易价格制度,基金管理人执行交易系统中的公平交易相外。对于债务一级市场申询、企开发行股票申询等非集中变价交易、对于债行合定
发易规则创优先。价格优先的原则保证各投资组合某两公平的交易机会。此一分是的原则对交易结果进行分配,对于债行何交易,接受易情况进行效计分析,投资组合经理对
相关交易情况进行会理性解释并留存记录。
4.32 公平交易制度的执行信记
本报告期内,基金管理人严格遵守法律法提来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法定本理特本用投资组合、未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行和递滤。本基金运作符合法律法搜和公平交易管理制度规定。

全权官例中3-382里10至4人 管理活动中之外持个同时使组合,未直接或通过与第三方的交易安排在个网络双纽拉马(PML31773—1982), 规划公平交易管理制度规定 规划公平交易管理制度规定 现实现实现实现实现实现实现实现实现实现实现实现实现实现。 1987年1月1日,1987年1月1日,1987年1日,19

与公司管理的具体既设置混在国中区本的证据。J图本山5427ms 4.33 异常交易行为的专项问题 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。 基金管思人管理的投资组合参与的交易所公开套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 招答加入报债等制水基金的投资缩略和业绩表现的说明
4.4 招答加入基金管制水基金的投资缩略和业绩表现的说明
报告期内。本基金符仓变化不大,以军工类公司和信息服务、医药、技术升级等旅长类公司为主。
报告期内。本基金符仓变化不大,以军工类公司和信息服务、医药、技术升级等旅长类公司为主。
现法金值需求现实有。全年收益为17%、四季度市场产业表现由现分化情况,它期能逐的传统行业出现大幅上涨,而成长级也出现完施后供的预化、投资上,对高种进行了个别调整。整体变化大大,遗物表现上的重度不知产增300倍%。产营基本面上,传统行业设有存充。
4.2 报告刑为法金的业绩的进行了分别。
2014年1月1日至12月31日,本基金净值增长率为18.98%。业绩比较基准收益率为202%。低于业绩比较基准8.04%。
4.3 管理人对发现经济、证券市场及行业定势的简要限型
2014年1月1日至12月31日,本基金净值增长率为18.98%。业绩比较基准收益率为202%。低于业绩比较基准8.04%。
4.5 管理人对发现经济、证券市场及行业走势的简要限型
2014年1月1日至12月31日,企业资金、进入资金、大场、企业资金、企业资金、企业资金、企业资金、企业资金、从市场风格全、协会工作、产资率300位有证限上、从市场风格管、传统低估值行业更加实出、参考新版块是核心,存款保险准估后,利率市场化会让一些优秀的银行流现出机会。结构行情未来也会在一些传统大行业中产生。

#/ B-EC/VINC 3P/1786201日程时子等#/\$P/51027年 根据年日直还会公告 (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"),成员由总经理、督察长、投资总监、基金经理和风险管理部、交易部、登记

东方精选混合型开放式证券投资基金

2014 年度 报告摘要

·后决议; ·经理:参与估值小组的日常工作、对采纳的估值方法和估值模型等发表意见和建议,但对估值政策和估值方案不具备最终

収; 交易部。负责继议召开估值委员会会议,并将已形成决议的重估方法所适用的金融产品明细提供风险管理部; 风险管理部。负前制定估值模型,提议及参数、确定参考行业指数并采集行业指数、据其计算店伍公允价格; 经记清解率。负责估值率宽约内率的影响,依据风险管理部提供的公允价格对投资品中进行估值。计算基金资产净值及基金份 值,持按照监管部厂现实作好相关信息披露工作; 运客籍核部,对有关估值改筑。任值放延程和影,估值方法等相关事项的合法合地生进行申核和监督,发现问题及时要来整次。 除基金经理外,参与估值选程的依方之间不存在任何的重大利益冲突。 能止和任务期期、公司已与中工则债金行结离有限进行公司家了(中做收益率曲线和中储估值最终用户服务协议),并依 提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金特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 活金))。

法提供的中侧权选举曲联系从口围归归至73~4~4。 旧基金)。 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 根据本基金基金与同的相关规定。结合本基金实际运作情况。本基金本报告期未进行利润分配。 4.9报告期内管理人对本基金特有人数或基金资产净值预整情形的说明 报告期内,本基金不存在连续二十个工作日本金持有人数数:20.0次基金资产规模低于5000万元的情形。 5.5 托管人报告

§ 7 年度财务报表

7.1资产负债表 会计主体:东方特选混合型开放式证券投资基金 报告截止日: 2014年12月31日

		本期末	単位:人民
资产	附注号	本期末 2014年12月31日	上中度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	58,599,139.05	56,505,914.9
结算备付金		5,349,164.72	3,060,576.9
存出保证金		2,457,671.80	2,449,215.0
交易性金融资产	7.4.7.2	4,631,434,087.10	4,689,637,550.3
其中:股票投资		4,175,617,787.10	4,092,474,050.3
基金投资		-	
债券投资		455,816,300.00	597,163,500.0
资产支持证券投资		-	
贵金属投资		-	
衍生金融资产	7.4.7.3	-	
买人返售金融资产	7.4.7.4	-	30,000,000.0
应收证券清算款		36,982,278.54	
应收利息	7.4.7.5	11,642,234.53	10,094,060.8
应收股利		-	
应收申购款		727,619.67	100,428,671.0
递延所得税资产		-	
其他资产	7.4.7.6	-	
资产总计		4,747,192,195.41	4,892,175,989.1
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债	7.4.7.3	-	
实出回购金融资产款		-	
应付证券清算款		48,839,260.54	36,159,781.0
应付赎回款		21,086,078.50	8,225,515.1
应付管理人报酬		6,296,236.64	6,013,117.2
应付托管费		1,049,372.76	1,002,186.2
应付销售服务费		-	
应付交易费用	7.4.7.7	3.091.090.09	4,208,468,6
应交税费		-	, ,
应付利息		-	
应付利润		-	
递延所得税负债		_	
其他负债	7.4.7.8	219,546.30	1,224,383.0
负债合计		80,581,584.83	56,833,451,3
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,385,875,597.76	1,708,502,674.7
未分配利润	7.4.7.10	3.280.735.012.82	3.126,839,863.1
所有者权益合计	7.4.7.10	4.666.610.610.58	4.835.342.537.8
负债和所有者权益总计		4.747.192.195.41	4,892,175,989,1

7.2 村间表 会计主体:东方精选混合型开放式证券投资基金

本报告期: 2014年1月1日至2014年12月31			单位:人民i
項目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31 日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
一、收入		925,205,386.96	277,814,943.99
1.利息收入		19,746,656.48	31,265,402.39
其中:存款利息收人	7.4.7.11	1,281,111.01	3,531,591.92
债券利息收入		17,949,227.32	15,801,814.8
资产支持证券利息收人		-	
买人返售金融资产收人		516,318.15	11,931,995.6
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		476,128,686.72	189,134,814.2
其中:股票投资收益	7.4.7.12	450,060,423.69	125,511,706.49
基金投资收益		-	
债券投资收益	7.4.7.13.1	3,129,933.55	1,085,546.5
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	
衍生工具收益	7.4.7.15	-	
股利收益	7.4.7.16	22,938,329.48	62,537,561.2
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	427,483,582.97	56,701,452.9
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	1,846,460.79	713,274.4
诚:二、费用		99,318,853.97	113,149,473.6
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	71,835,799.16	77,182,607.1
2.托管费	7.4.10.2.2	11,972,633.20	12,863,767.8
3.销售服务费		-	
4.交易费用	7.4.7.19	14,518,824.39	22,662,672.5
5.利息支出		539,994.31	
其中:卖出回购金融资产支出		539,994.31	
6.其他费用	7.4.7.20	451,602.91	440,426.2
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		825,886,532.99	164,665,470.3
减:所得税费用		-	
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		825,886,532.99	164,665,470.3

			平田:八尺川	
項目		本期 2014年1月1日至2014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)	1,708,502,674.75	3,126,839,863.10	4,835,342,537.85	
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期净利润)	=	825,886,532.99	825,886,532.99	
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)	-322,627,076.99	-671,991,383.27	-994,618,460.26	
其中:1.基金申购款	728,910,487.85	1,540,782,585.49	2,269,693,073.34	
2.基金赎回款	-1,051,537,564.84	-2,212,773,968.76	-3,264,311,533.60	
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)	1,385,875,597.76	3,280,735,012.82	4,666,610,610.58	
项目		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	2,141,958,482.53	3,730,160,938.62	5,872,119,421.15	
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期净利润)	=	164,665,470.30	164,665,470.30	
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)	-433,455,807.78	-767,986,545.82	-1,201,442,353.60	
其中:1.基金申购款	144,721,260.86	256,187,731.20	400,908,992.06	
2.基金赎回款	-578,177,068.64	-1,024,174,277.02	-1,602,351,345.66	
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)	1,708,502,674.75	3,126,839,863.10	4,835,342,537.85	
报表附注为财务报表的组成部分本报告 71 至 74 财务报表由				

单位:人民币;

1904年74 出.1767/1767 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 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、代销机构				
渤海国际信托有限公司	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				
中国民生银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构				
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属于公司				

	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
关联方名称	成交金額	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券股份有 限公司	-	-	649,838,650.27	4.43%
债券交易				金额单位:人民市
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1	2月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年1	2月31日
大联刀石阶	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券 成交总额的比例
东北证券股份有 限公司	-	-	10,600,000.00	5.64%
债券回购交易				金额单位:人民币
	本期 2014年1月1日至2014年1	2月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年1	
关联方名称	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
そルコナを明める				

金额单位:人民币元

7.4.8.1.2 秋底之分。 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。 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 关联方名称 期末应付佣金余额 关联方名称

国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的 净额列示。 《总统表明金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。 7.48.2 天旅方招觸 7.48.2 无途方招觸

			平世:八尺川/	
	項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	当期发生的基金应支付的管理费	71,835,799.16	77,182,607.13	
	其中:支付销售机构的客户维护费	14,004,521.94	16,427,625.55	
注、①计想标准,在通常附尺下,基金管理数按衡一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下: H=Ex 年管理费率 - 当年天数,本基金年管理费率为1.5% H为每日应计划的基金管理费				

E为前一日基金资产净值 ②计提为元片支付方式、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及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,若透法定节假日,保息日,支付日期顺症。 7-48-22 基金任管费

		单位:人民
項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,972,633.20	12,863,767.84
注:①计提标准:在通常情况下; H=E×年托管费率:当年天数, H为每日应计提的基金托管费 E为前一日基个资产净值	基金托管费按前一日基金资产净值的年费率 本基金年托管费率为0.25%	计提。计算方法如下:

E 为前一日基金於予勞值 ②计提为走力支付方式、基金任管费每日计提、按月支付,由基金管理人向基金托管人支送基金托管费则付指令、经基金托管人 复核后于次月省日起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。 7.4.8.3 与实施方进行银行间间电准市场价值外价回购设备 本报告别及上年度可比例间。基本参与特全实施方进行银行间间电市场价值券(含回购)交易。 7.4.8.4 各实施方投资本基金的情况

302,424.23 302,424.23 0.01%

				单位:人民币5		
关联方 名称		本期 至2014年12月31日	上年度可比 2013年1月1日至20			
40 00	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入		
中国民生银行 股份有限公司						
74.8.6 本基金在采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(2014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

		以告期末未注 末持有的暂6				期末流迪9	沙限 的业务。			
		1-14 11 11 11 11 11	212711 (10)						金额单位:	人民市
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 成本总額	期末估值总额	备注
300170	汉得 信息	2014年12月 10日	筹划重大 事項	13.22	2015年1 月28日	14.54	22,286,339	191,942,062.94	294,625,401.58	-
300252	金信 诺	2014年11月 11日	筹划重大 事項	43.40	2015年1 月28日	46.99	4,587,236	83,788,930.03	199,086,042.40	-
002354	科冕 木业	2014年10月 31日	筹划重大 资产重组	57.50	2015年3 月24日	63.25	559,725	27,050,292.95	32,184,187.50	-
300269	联建 光电	2014年12月 30日	拟披露重 大事项	36.13	2015年1 月7日	33.21	798,423	26,804,905.48	28,847,022.99	-
000590	紫光 古汉	2014年12月 22日	筹划重大 事項	15.91	2015年1 月28日	17.50	30,000	518,400.00	477,300.00	-
300073	当升	2014年12月	筹划重大	17.60	-	-	20,000	457,874.00	352,000.00	_

20073 | 村枝 | 11740 | - - | 20,000 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 | 457,574 |

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
序号	項目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,175,617,787.10	87.96
	其中:股票	4,175,617,787.10	87.96
2	固定收益投资	455,816,300.00	9.60
	其中:债券	455,816,300.00	9.60
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	63,948,303.77	1.35
7	其他各项资产	51,809,804.54	1.09
8	合计	4,747,192,195.41	100.00

			金额单位:人民币
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	-	-
В	采矿业	221,315,884.15	4.74
С	制造业	2,359,367,960.63	50.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	162,195,965.80	3.48
E	建筑业	273,769,218.88	5.87
F	批发和零售业	1,790,400.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	823,540,519.44	17.65
J	金融业	-	-
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	165,075,531.70	3.54
N	水利、环境和公共设施管理业	635,500.00	0.01
0	居民服务、修理和其他服务业	=	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	165,289,806.50	3.54
R	文化、体育和娱乐业	2,637,000.00	0.06
S	综合	=	-
	合计	4,175,617,787.10	89.48

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	600570	恒生电子	6,292,529	344,578,888.04	7.38	
2	000681	视觉中国	15,899,378	333,568,950.44	7.15	
3	300024	机器人	7,987,677	314,634,597.03	6.74	
4	300170	汉得信息	22,286,339	294,625,401.58	6.31	
5	600372	中航电子	8,889,869	246,160,472.61	5.27	
6	002375	亚厦股份	11,987,828	227,289,218.88	4.87	
7	000915	山大华特	7,884,230	205,620,718.40	4.41	
8	300252	金信诺	4,587,236	199,086,042.40	4.27	
9	300124	汇川技术	5,894,698	172,066,234.62	3.69	
10	002421	达实智能	5,598,007	168,835,891.12	3.62	
	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年度报告正文。 8.4 招告期内股票积资组合的重大变动					

8.4 报告期内股票投资组合的里天变动
8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

O.T.1 35	VI 50/C3E1900411175	がか46至以 1子直2/85(H)20	ACTH 2005 SEC. (2) SEU	金额单位:人民币
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000681	视觉中国	380,863,651.17	7.88
2	300012	华測检測	210,648,979.69	4.36
3	002421	达实智能	210,483,216.97	4.35
4	300024	机器人	183,278,161.09	3.79
5	002375	亚厦股份	168,162,074.63	3.48
6	600109	国金证券	164,532,648.50	3.40
7	300015	爱尔眼科	152,113,099.32	3.15
8	601989	中国重工	146,666,666.32	3.03
9	300084	海默科技	128,400,507.24	2.66
10	600372	中航电子	118,949,371.81	2.46
11	600184	光电股份	118,082,468.84	2.44
12	002214	大立科技	115,374,011.91	2.39
13	300207	欣旺达	103,907,278.07	2.15
14	300170	汉得信息	94,131,491.13	1.95
15	600570	恒生电子	85,434,135.06	1.77
16	600315	上海家化	84,422,692.49	1.75
17	002376	新北洋	81,950,048.80	1.69
18	600872	中炬高新	79,726,037.13	1.65
19	603288	海天味业	67,518,807.80	1.40

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	600570	恒生电子	463,183,065.56	9.58
2	300024	机器人	271,957,340.79	5.62
3	600066	宇通客车	196,264,999.58	4.06
4	601888	中国国旅	186,293,090.30	3.85
5	600109	国金证券	165,024,635.65	3.41
6	601989	中国重工	145,861,357.89	3.02
7	600804	鹏博士	140,861,113.63	2.91
8	601318	中国平安	138,316,165.74	2.86
9	300207	欣旺达	124,180,285.14	2.57
10	600638	新黄浦	123,800,955.13	2.56
11	600276	恒瑞医药	122,615,368.37	2.54
12	002007	华兰生物	117,536,642.12	2.43
13	600739	辽宁成大	111,984,275.70	2.32
14	600588	用友软件	109,010,445.72	2.25
15	000625	长安汽车	106,897,184.50	2.21
16	600649	城投控股	102,023,830.22	2.11
17	600284	浦东建设	99,993,958.78	2.07
18	000536	华映科技	95,305,391.41	1.97
19	000581	威孚高科	94,424,730.15	1.95
20	000651	格力电器	93,452,133.82	1.93
注:①实:	出主要指二級市場	る上主动的卖出、换股、要约	收购、发行人回购及行权等减少的股票。	

8.4.3 关入胶示的成本总额及美田胶示的収入总额	单位:人
买人股票成本(成交)总额	4,389,059,45
卖出股票收入(成交)总额	5,154,165,83
换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。	: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
② "买人股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交	E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 期月	卡按债券品种分类的债券投资组合		金额单位:人民币
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	435,736,300.00	9.34
	其中:政策性金融债	435,736,300.00	9.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,080,000.00	0.43
6	中期票据	=	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	455,816,300.00	9.77

按公允价值占基金资	符产净值比例大小	排序的前五名债券	投资明细	金额单位:人民币:
债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
140437	14次发37	1,000,000	99,990,000.0	0 2.14
120309	12进出09	1,000,000	98,990,000.0	0 2.12
140204	14国开04	515,000	51,510,300.0	0 1.10
140430	14农发30	500,000	50,085,000.0	0 1.07
140429	14次发29		.,,	0.86
	债券代码 140437 120309 140204 140430 140429	债券代码 债券名称 140437 14次发37 120309 12进出99 1400204 14图开04 140430 14次发30	债券代码 债券名称 数量(张) 140437 14次发37 1,000,000 120309 12进出99 1,000,000 140204 14億折04 515,000 140430 146次30 500,000 140429 14次发29 440,000	140437 14夜发37 1,000,000 99,990,000,00 120309 12連曲09 1,000,000 98,990,000,00 140204 14箇所64 515,000 51,510,300,00 140430 14夜来30 500,000 50,685,000,00 140422 14夜来29 400,000 40,085,000,00

5 140429 14次发29 400,000 140,7 1 14次发29 400,000 140,7 1 14次次分价值占基金等产格住的人力排序的前十名资产支持证券投资判据 本基金本报告期未来持有资产支持证券 14次,14年的前五名贵金属投资明细报准未益基金合同规定,未基金不投资请金属 29 期末按公价值占基金资产净值比例大力排序的前五名货金属投资明细 未基金本报告期未未持有权证。 10次指则未未基金投资的股份制资交易情况说明根据本基金基金合同规定,基金不投资股份制资、8 11报告期未未基金投资的国际预定,3 45条金不投资股份制资。 8 11报告期未未基金投资的国际预定,3 45条金不投资国际制资。 141报告期未未基金投资的国际附交易情况即用 145条金金基金合同规定,4 基金不投资国际制资。 1412年14月11日,1411年14月,1411年14月11日,1411年14月,1411年1

8.12 区郊红工区内约12.12 公司 2.12 公司

1)研究的方案规定的、此步即项(11年70年1919年) "確依据。 2)投资收据委员会企即召开会议,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 "知识"(1861年) 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 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

(5)投资決策委员会根据市场实化可求效组百日《邓阳田市场》《地球》以1857年18年。1857年18年。 本基金投资金信洁主要基于以下原因。基本面上看、公司半菜电缆(基站无线内部连接),半钢电缆和膨进电缆(微波通信式基 时停),机效电缆,基站的微线系统)。菜性电缆及连接器(机柜内的连接)等通信线缆产品进入华外、爱尤信等全球前头大设备广 公司来来之-3年在全球和找租6G建设带力产产品需求爆发通应性高;幂点方面,公司军标系列电缆和稳相电缆,用于空军等机 741机,预警机,直升电等,和高军舰舰的通信系统 符合设置未来了04年加快军单信息比赛超的趋势。根关处司不停空等的被 全净力,周时也有利于公司改善其后继结构;与同行业公司比较、公司竞争依势也比较突出。本基金在这一投资过程中严格遵守了 1954年

股票名称 流通受限部分的公允价值 流通受限情况说明 § 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

				持有.	人结构		
持有人户数(户)	户均持有的基金份	机构投资者				个人投资者	
	额	持有份額	额	占总份额比 例	持有份額		占总份额比 例
143,958	26,220.13	1,02	1,605,063.60	27.07%		2,752,992,938.92	72.93%
9.3 期末基金管	理人的从业人员持有	有本基金的情况		•			
	项目	#	5有份额总数	(份)		占基金总份额	七例
基金管理人所有从业人员持有本基金		470,400.58			100.58	0.019	
9.4 期末基金管	理人的从业人员持有	7本开放式基金份	额总量区间	的情况		,	
	项目			持有基金	份額总	总量的数量区间(万份)	
本公司高級管理/ 本开放式基金	人员、基金投资和研究	第门负责人持有					10-5
本基金基金经理技	持有本开放式基金						
		§ 10	开放式基金	份额变动			
							单位

基金合同生效日(2006年1月11日)基金份额总额	345,758,456.53
本报告期期初基金份額总额	4,653,324,921.63
本报告期基金总申购份额	1,985,251,129.95
减:本报告期基金总赎回份额	2,863,978,049.06
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	3,774,598,002.52
注:基金总申购份额包含基金转换人份额,基金总赎回份额包含基金转换出代	

注担任公司副总受查;控予基金管理人2014年第一公局的权利发发队(以,可以从下企业工业以上、可加水、10万万元上、 董事。 本基金管理人已通过证监金指证报刊及本基金管理人网站对上该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4 全管理人管理的其他基金的据取识明书,基金管理、部分更更明节,上途高级管理人员,董事变更情况。 本报告期内,基金托管人的专门基金托管都们未发生重大人事变动。 113 被发基金管理人、基金的"基金柱管业务的诉讼。" 社告期内、公司发生一起涉及基金管理人的诉讼案件,系原公司员工与公司之间的民事诉讼案件,公司为被告,截至报告日,该案件已 北京市西城区人民法院调察定律。 报告期内、公司存在一起未决诉讼案件,系原公司员工与公司之间的民事诉讼案件,公司为被告。截至报告日,注诉讼仍在审理

占当期佣金总量的比例

學說的报告(1920年), 用金華。 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、委托代理制限、佣金率、双方 签约,根定备选的券商后,接公司签约程序与备选券商签约。金沙町,安河町正次是 签约,根定备选的券商后,接公司签约程序与备选券商签约。金沙町,安河町正次是 的权利义务等。 (3)本报告期内本基金新增租用2个交易单元,分别为渤海证券股份有限公司、方正证券股份有限公司深圳证券交易所交易单元

	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比 例	成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例
银河证券股份有限公司	-	-	362,800,000.00	27.85%	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	60,000,000.00	4.61%	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	400,000,000.00	30.70%	-	-
广州证券有限责任公司	10,985,637.80	100.00%	270,000,000.00	20.72%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	170,000,000.00	13.05%	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	40,000,000.00	3.07%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

金额单位:人民币元