东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7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2015年4月15日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方睿鑫热点挖掘混合	
基金主代码	001120	
交易代码	001120	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月15日	
报告期末基金份额总额	563,893,129.35份	
投资目标	深度挖掘我国经济发展过程中不断涌现的具备较高投资价值的证券,在严格控制基金投资风险的前提下,充分分享我国经济发展带来的投资收益。	
投资策略	本基金充分把握我国经济发展过程中不断出现的热点投资机会,在严控投资风险的基础上,结合类别资产配置、热点证券配置,提高基金的投资收益。 根据我国经济发展特点和我国证券市场中长期发展趋势,本基金将热点证券细分为:(1)政策热点证券;(2)证券市场热点证券;(3)科学技术热点证券;(4)其它热点证券。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%	
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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方睿鑫热点挖掘A类	东方睿鑫热点挖掘C类
下属分级基金的交易代码	001120	001121
报告期末下属分级基金的份额总额	59,845,084.21份	504,048,045.14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(2015年4月15日 - 2015年6月30日)	
	东方睿鑫热点挖掘A类	东方睿鑫热点挖掘C类
1.本期已实现收益	5,395,788.98	40,828,246.73
2.本期利润	8,152,061.92	83,790,817.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0971	0.1138
4.期末基金资产净值	63,287,024.90	530,686,624.38
5.期末基金份额净值	1.0575	1.0528

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

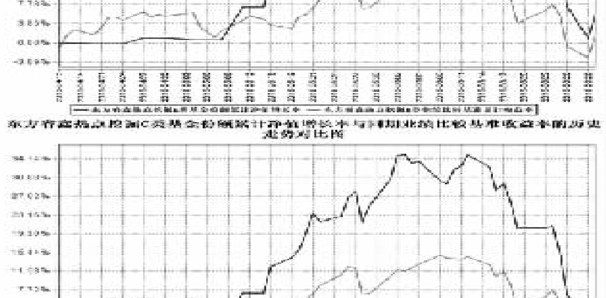
东方睿鑫热点挖掘A类

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	5.75%	2.57%	1.58%	1.94%	4.17%	0.63%

东方睿鑫热点挖掘C类

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	5.28%	2.57%	1.58%	1.94%	3.70%	0.63%

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



注:本基金基金合同于2015年4月15日生效,截至报告期末,本基金成立不满六个月,仍处于建仓期。

§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		
呼振翼(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2015年4月15日	-	19年	对外经济贸易大学经济学硕士,19年证券从业经历,曾任高斯达期货公司投资经理,金鹏期货公司投资经理,海南证券研究员,湘财证券研究员、投资理财总经理,民生证券研究员、行业组组长。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部研究员、权益投资部副总经理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理。现任权益投资部总经理、投资决策委员会委员、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方主题精选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。
薛子徵(先生)	本基金基金经理	2015年6月25日	-	8年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士,8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。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、东方核心动力股票型开放式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。

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遵规守信情况的说明

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、《东方睿鑫热点挖掘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中的公平交易程序;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。

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,未直接或通过与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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场出现了大幅波动,4-5月份在场外资金加速入场、场内资金继续加杠杆的背景之下,A股市场表现强势,创业板指、中小板指、上证综指大幅上涨,且以总理提出的"互联网+"相关标的表现强势。6月份在清理场外配资事件的驱动下,股指大幅下挫,进而引发新一轮的强行平仓,恐慌情绪浓重。整体看,2季度创业板指数上涨18.2%、振幅72.5%,上证综指上涨8.2%、振幅38.3%。

报告期内,本基金净值先扬后抑,4-5月份本基金延续1季度的投资策略,侧重对新兴战略产业的成长股以及阶段性市场热点的挖掘,净值表现突出。6月份市场出现大幅调整,本基金也做出了仓位的适当调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年4月15日(基金成立日)起至6月30日,本基金A类净值增长率为5.75%,业绩比较基准收益率为1.58%,高于业绩比较基准4.17%;本基金B类净值增长率为5.28%,业绩比较基准收益率为1.58%,高于业绩比较基准3.70%。

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2015年3季度,我们认为国家加码刺激经济政策和维护市场稳定是可以预期的,一方面,场外融资逐步规范,强平趋于尾声;另一方面,房地产销售企稳复苏、铁路环保等PPP项目逐步落地,经济结构优化和企业转型升级出现向好迹象。因此我们认为在市场急速下跌之后需要一段较长时间进行市场的调整和消化,之后将迎来真正意义的繁荣。

而调整过后市场仍会寻找具备长期成长逻辑的标的,特别是互联网催生的新兴领域将蕴藏未来伟大的公司,因此长期角度我们仍看好以新兴科技为驱动的成长型龙头,我们将继续坚守企业生命周期理论的选股策略,以合适的价格买入并持有,充分分享科技蓝筹带来的价值成长。

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持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	560,349,013.11	82.34
	其中:股票	560,349,013.11	82.34
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	98,081,622.55	14.41
7	其他资产	22,131,274.41	3.25
8	合计	680,561,910.07	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	-	-
B	采矿业	3,464,000.00	0.58
C	制造业	189,088,816.72	31.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,440,894.33	3.95
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	73,011,127.85	12.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,346,222.25	3.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	94,749,262.30	15.95
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	61,280,450.80	10.32
R	文化、体育和娱乐业	95,968,238.86	16.16
S	综合	-	-
	合计	560,349,013.11	94.34

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	300012	华测检测	2,199,890	94,749,262.30	15.95
2	300015	爱尔眼科	1,899,580	61,280,450.80	10.32
3	000681	视觉中国	1,399,952	57,482,029.12	9.68
4	000915	山大华特	699,958	39,197,648.00	6.60
5	002405	四维图新	800,000	35,040,000.00	5.90
6	600699	均胜电子	899,952	34,477,161.12	5.80
7	300252	金信诺	799,797	31,727,946.99	5.34
8	000156	华数传媒	699,858	25,040,919.24	4.22
9	300170	汉得信息	999,805	24,285,263.45	4.09
10	002214	大立科技	999,908	20,898,077.20	3.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定,本基金不投资贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金基金合同规定,本基金不投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同规定,本基金不投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	687,607.00
2	应收证券清算款	20,076,174.80
3	应收股利	-
4	应收利息	21,781.21
5	应收申购款	1,345,711.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,131,274.41

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300012	华测检测	94,749,262.30	15.95	筹划重大事项
2	002214	大立科技	20,898,077.20	3.52	拟披露重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东方睿鑫热点挖掘A类	东方睿鑫热点挖掘C类
基金合同生效日(2015年4月15日)基金份额总额	87,531,047.42	820,137,077.86
报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	27,627,943.09	136,024,152.34
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	55,313,906.30	452,113,185.06
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	59,845,084.21	504,048,045.14

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

一、《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方睿鑫热点挖掘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

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 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)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2015年7月21日

东方主题精选混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方主题精选混合
基金主代码	400032
交易代码	400032
前端交易代码	400032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月23日
报告期末基金份额总额	562,084,395.18份
投资目标	通过深入扎实的研究,精选投资主题,把握中国经济成长和改革带来的投资机会,力争实现基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资的股票资产占基金资产的比例为40%-95%,在符合相关法律法规规定和基金合同约定的投资比例限制基础上,本基金采用主题投资策略,通过对我国经济发展过程中出现的主题类投资机会进行挖掘,投资于符合当期经济发展目标且具有可持续发展前景的优秀上市公司,在力争实现基金长期稳定增值的基础上,提高基金投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%
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	中国工商银行股份有限公司

§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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	113,928,689.88
2.本期利润	224,469,800.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.2367
4.期末基金资产净值	647,158,155.16
5.期末基金份额净值	1.1514

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

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	15.73%	2.33%	7.24%	1.57%	8.49%	0.76%

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

注:本基金基金合同于2015年3月23日生效,截至报告期末,本基金成立不满六个月,仍处于建仓期。

§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		
呼振翼(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2015年3月23日	-	19年	对外经济贸易大学经济学硕士,19年证券从业经历,曾任高斯达期货公司投资经理,金鹏期货公司投资经理,海南证券研究员,湘财证券研究员、投资理财部经理,民生证券研究员、行业组组长。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部研究员、权益投资部副总经理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理。现任权益投资部总经理、投资决策委员会委员、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方主题精选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。
邱义鹏(先生)	本基金基金经理	2015年6月30日	-	-	清华大学材料科学与工程专业硕士,7年证券从业经历。曾任嘉实基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、建筑装饰、食品饮料、农林牧渔行业研究员,东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理。现任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方主题精选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遵规守信情况的说明

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、《东方主题精选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中的公平交易程序;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。

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,未直接或通过与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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场出现了大幅波动,4-5月份在场外资金加速入场、场内资金继续加杠杆的背景之下,A股市场表现强势,创业板指、中小板指、上证综指大幅上涨,从结构上看,代表"创新"、"改革"大方向的新兴产业表现突出,成为上涨的主导方向。6月份在清理场外配资事件的驱动下,股指出现调整,市场持续下跌加剧了资金的负反馈效应,市场出现连续暴跌。整体看,2季度创业板指数上涨18.2%、振幅72.5%,上证综指上涨8.2%、振幅38.3%。

基金成立后,为了充分把握快速上涨行情,我们采取了快速建仓的策略,在结构上以新兴战略产业的成长股龙头为主,较好地把握了4-5月份市场的上涨,净值表现突出。6月份市场出现大幅调整,本基金也做出了仓位的适当调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年4月1日至2015年6月30日,本基金净值增长率为15.73%,业绩比较基准收益率为7.24%,高于业绩比较基准8.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从二季度的回顾中可以看出,杠杆资金持续入市,明显加大了市场的波动范围。在市场出现连续下跌后,我们看到政府连续推出强有力的维护市场稳定的政策措施,随着这些政策逐渐发挥作用,我们认为市场将逐步企稳。

在市场调整过程中,低估值蓝筹股表现出了较好的相对收益,但从中长期视角出发,我们依然认为支持本轮牛市的核心逻辑没有变化,因此,未来市场仍将回归到"创新、改革"的主线上,因此长期角度我们仍看好以新兴科技为驱动的成长型龙头,我们将继续坚守企业生命周期理论的选股策略,以合适的价格买入并持有,充分分享科技蓝筹带来的价值成长。

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持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	609,784,488.39	86.15
	其中:股票	609,784,488.39	86.15
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	73,977,598.82	10.45
7	其他资产	24,089,564.37	3.40
8	合计	707,851,651.58	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	274,005,707.82	42.34
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	61,584,182.04	9.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	28,870,115.75	4.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	99,055,487.04	15.31
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	67,733,741.20	10.47
R	文化、体育和娱乐业	78,535,254.54	12.14
S	综合	-	-
	合计	609,784,488.39	94.22

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	300012	华测检测	2,299,872	99,055,487.04	15.31
2	300015	爱尔眼科	2,099,620	67,733,741.20	10.47
3	000681	视觉中国	1,389,900	57,069,294.00	8.82
4	000915	山大华特	999,982	55,998,992.00	8.65
5	300203	聚光科技	1,299,961	48,982,530.48	7.57
6	300252	金信诺	1,199,977	47,603,087.59	7.36
7	002405	四维图新	700,000	30,660,000.00	4.74
8	002292	奥飞动漫	799,866	30,274,928.10	4.68
9	300124	汇川技术	599,924	28,796,352.00	4.45
10	600094	大名城	1,254,623	25,406,115.75	3.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

根据本基金基金合同规定,本基金不投资贵金属。

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

根据本基金基金合同规定,本基金不投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同规定,本基金不投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	260,201.46
2	应收证券清算款	23,061,639.98
3	应收股利	-
4	应收利息	24,519.90
5	应收申购款	743,203.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,089,564.37

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300012	华测检测	99,055,487.04	15.31	筹划非公开发行股票事项
2	300203	聚光科技	48,982,530.48	7.57	筹划重大事项
3	002292	奥飞动漫	30,274,928.10	4.68	筹划非公开发行股票事项
4	600094	大名城	25,406,115.75	3.93	筹划重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,099,609,139.25
报告期期间基金总申购份额	357,473,196.09
减:报告期期间基金总赎回份额	894,997,940.16
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	562,084,395.18

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

一、《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方主题精选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

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 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)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2015年7月21日

(上接B49版)

拟修改为:本基金的估值日为相关的证券、期货交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

2)三、估值对象

原有表述为:基金所拥有的股票、债券、权证等金融衍生品和银行存款本息等资产和负债。

拟修改为:基金所拥有的股票、债券、权证、股指期货等金融衍生品和银行存款本息等资产和负债。

3)四、估值程序

原有表述为:基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后,将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人,基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后,以双方认可的方式发送给基金管理人;月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

拟修改为:1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

4)五、估值方法

原有表述为:本基金按以下方式进行估值:

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

拟修改为:本基金按以下方式进行估值:

1、证券交易所发行的有价证券的估值

(2)交易所发行实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3)交易所发行未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

5、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

7、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

5)七、暂停估值的情形

原有表述为:与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

拟修改为:与本基金投资有关的证券、期货交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

6)八、特殊情形的处理

原有表述为:2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

拟修改为:2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

11、拟修改第十四部分"基金费用与税收"

1)一、基金费用的种类

a)原有表述为:4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;6、基金的证券交易费用;

拟修改为:4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;6、基金的证券、期货交易费用;

b)拟增加内容为:8、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用;

2)二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式中的"基金管理人的管理费"

原有表述为:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数……

上述一、基金费用的种类中第3-7项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

拟修改为:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.2%÷当年天数……

上述一、基金费用的种类中第3-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

12、拟修改第十七部分"基金的信息披露"

1)五、公开披露的基金信息

a)原有表述为:公开披露的基金信息包括:(五)临时报告

11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;

拟修改为:公开披露的基金信息包括:(五)临时报告

11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;

b)原有表述为:26、中国证监会规定的其他事项。

拟修改为:27、法律法规、中国证监会规定及基金合同约定的其他事项。

c)拟增加内容:26、基金推出新业务或服务;

2)原有表述为:(九)基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案……

拟修改为:(七)基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案……

3)拟增加内容:

(八)基金投资股指期货的信息披露

在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

(九)基金投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

(十)中小企业私募债券的信息披露

在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,基金管理人应当在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

本基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

4)六、信息披露事务管理

原有表述为:基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

拟修改为:基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

5)八、暂停或延迟信息披露的情形

原有表述为:1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

拟修改为:1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

13、拟修改第十八部分"基金合同的变更、终止与基金财产的清算"

1)一、基金合同的变更

原有表述为:2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行,并应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

拟修改为:2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案,自通过之日起生效,并自决议生效后2个工作日内在指定媒介上公告。

2)三、基金财产的清算

原有表述为:4、基金财产清算程序:

(7)对基金财产进行分配;

拟修改为:4、基金财产清算程序:

(7)对基金剩余财产进行分配。

3)四、清算费用

原有表述为:清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

拟修改为:清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

4)六、基金财产清算的公告

原有表述为:清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于出现基金合同终止情形并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

拟修改为:清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

14、拟修改第十九部分"违约责任"

原有表述为:五、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资者损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

拟修改为:五、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资者损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

15)拟修改第二十一部分"基金合同的效力"

原有表述为:1、本基金合同由《泰信保本混合型证券投资基金基金合同》修订而成。基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字后报中国证监会备案。

拟修改为:1、本基金合同由《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成。基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字后报中国证监会备案。

二、招募说明书修改方案

原有表述为:

赎回费率:

T<7天1.5%;

7天≤T<30天0.75%;

30天≤T<365天　0.5%

365天≤T<730天　0.25%

T≥730天　0%

拟修改为:

赎回费率:

T<7天1.5%;

7天≤T<30天0.75%;

30天≤T<180天　0.5%

180天≤T<365天　0.1%

365天≤T<730天　0.05%

T≥730天　0%

归入基金资产比例不变。

三、基金合同修改的可行性

(一)投资方面

本次《基金合同》修改方案扩大了基金投资范围,增加股指期货投资工具,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,有选择地投资于股指期货,以降低投资组合的整体风险,对修改后基金的运行无实质影响;方案对基金投资比例也进行了调整,股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,这将大大减少基金投资所受的限制,使基金管理人能更有效的进行资产配置,有利于为基金份额持有人创造更大的收益,对原份额持有人无实质性不利影响;此外还下调了管理费费率并且整体调低了赎回费费率结构,降低持有人的投资成本。

(二)技术运作方面

泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同修改在技术运作层面具有较强的可行性,基金的注册登记机构仍然为本公司,本公司在注册登记业务上具有较为丰富的业务经验,可以保障基金份额持有人大会的顺利召开。

(三)法律方面

根据《泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同》的约定,本次基金合同修改事项需召开基金份额持有人大会,属于可以以基金份额持有人大会一般决议审议通过的事项,一般决议须经参加大会的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效。

同时,本次基金份额持有人大会对基金合同的修改方案完全符合国家法律、法规的相关规定。本次修改基金合同不存在法律方面的障碍。

附件三

泰信行业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人基本资料		
持有人姓名/名称		
泰信基金账户号		
持有人身份证件/营业执照类型及号码		
如持有人委托他人代为投票,请填写		
代理人姓名/名称		
代理人身份证件/营业执照类型及号码		
关于修改泰信行业精选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案		
同意	反对	弃权
签字或盖章		
个人持有人或代理人签字: 2015年月日	机构持有人或代理人盖章: 2015年月日	

说明:1、请就表决内容表示"同意"、"反对"或"弃权",并在相应栏内打"√"

2、本表决票可从相关报纸上剪裁、复印或按此格式打印;

3、持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。未选、多选、表决意见空白、表决意见模糊不清或相互矛盾(且其他各项符合会议通知规定)的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为"弃权"。表决意见签字/盖章部分不完整、不清晰的,将视为无效表决。

附件四

授权委托书

兹授权代表本人(或本机构)参加投票截止日为2015年8月26日15:00的以通讯方式召开的泰信行业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使对所有议案的表决权。若泰信行业精选混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):

委托人证件号码:

委托人泰信基金账户号:

受托人签字/盖章:

受托人证件号码:

委托日期:2015年月日

(本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制,在填写完整并签字盖章后均为有效)