东方精选混合型开放式证券投资基金

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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	东方精选混合
基金主代码	400003
交易代码	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
报告期末基金份额总额	2,410,126,869.21份
投资目标	深入研究中国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	根据本基金的特征,选择中信标普300成长指数作为本基金股票部分的业绩比较基准,选择中信标普全债指数作为债券及货币市场工具的比较基准。 对于权重配置,作为一只混合型基金,股票最低仓位为30%,最高为95%,一般情况下为60%,因此本基金的业绩比较基准为:本基金业绩比较基准=中信标普300成长指数*60% + 中信标普全债指数*40% 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金可以变更业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,其风险收益特征介于单纯的股票型基金、单纯的债券型基金与单纯的货币市场基金之间,同时其股票组合部分的风险收益特征也介于完全成长型股票组合与完全价值型股票组合之间。
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

§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	992,586,628.74
2.本期利润	1,226,912,423.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.4567
4.期末基金资产净值	5,495,109,824.80
5.期末基金份额净值	2.2800

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。

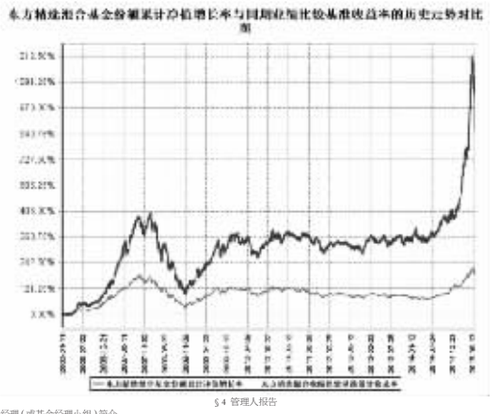
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	25.93%	2.78%	7.72%	1.63%	18.21%	1.15%

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



§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	2013年1月4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5月4日	–	7年	清华大学材料学与工程专业硕士,7年证券从业经历。曾任喜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。现任东方新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》及其各项实施细则、《东方精选混合型开放式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,各投资组合经理在投权范围内自主决策,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,在投权、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或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,从宏观经济、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,杠杆资金持续大市,明显加大了市场的波动。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,因此从长期角度来看,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,充分分享科技监筹带来的价值成长。

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	5,011,846,902.96	86.81
	其中:股票	5,011,846,902.96	86.81
2	固定收益投资	195,414,500.00	3.38
	其中:债券	195,414,500.00	3.38
	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	514,350,622.56	8.91
7	其他资产	51,529,521.56	0.89
8	合计	5,773,141,547.08	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	242,670,428.71	4.42
C	制造业	1,879,530,542.41	34.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,702,428.96	1.07
E	建筑业	362,414,719.89	6.60
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	779,659,048.23	14.19
J	金融业	2,165,100.00	0.04
K	房地产业	146,186,795.25	2.66
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	658,931,332.53	11.99
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	364,473,544.52	6.63
R	文化、体育和娱乐业	517,112,962.46	9.41
S	综合	–	–
	合计	5,011,846,902.96	91.21

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	15,299,079	658,931,332.53	11.99
2	000681	视觉中国	10,589,926	434,822,361.56	7.91
3	000915	山大华特	7,180,000	402,080,000.00	7.32
4	300015	爱尔眼科	11,298,002	364,473,544.52	6.63
5	300252	金信诺	8,518,090	337,912,630.30	6.15
6	002375	亚厦股份	11,381,709	332,459,719.89	6.05
7	600570	恒生电子	2,292,529	256,877,874.45	4.67
8	300124	汇川技术	5,294,698	254,145,504.00	4.62
9	300170	汉得信息	9,248,008	224,634,114.32	4.09
10	300084	海默科技	9,416,337	201,792,101.91	3.67

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	195,414,500.00	3.56
	其中:政策性金融债	195,414,500.00	3.56
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	195,414,500.00	3.56

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	120309	12进出09	1,000,000	100,070,000.00	1.82
2	130312	13进出12	200,000	20,224,000.00	0.37
3	130230	13国开30	200,000	20,166,000.00	0.37
4	110221	11国开21	200,000	19,998,000.00	0.36
5	130231	13国开31	200,000	19,916,000.00	0.36

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	2,383,924.04
2	应收证券清算款	28,060,331.45
3	应收股利	–
4	应收利息	6,002,667.77
5	应收申购款	15,082,598.30
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	51,529,521.56

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债。

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	658,931,332.53	11.99	筹划非公开发行股票事项
2	002375	亚厦股份	332,459,719.89	6.05	拟披露员工持股计划
3	300084	海默科技	201,792,101.91	3.67	筹划非公开发行股票事宜

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,951,837,300.83
报告期期间基金总申购份额	1,143,112,412.03
减:报告期期间基金总赎回份额	1,684,822,843.65
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	2,410,126,869.21

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	302,424.23
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	302,424.23
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.01

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、《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方精选混合型开放式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、基金份额净值及其他临时公告

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

东方利群混合型发起式证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	东方利群混合
基金主代码	400022
交易代码	400022
前端交易代码	400022
后端交易代码	400022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月17日
报告期末基金份额总额	2,380,117,288.64份
投资目标	努力挖掘市场趋势,在适当范围内灵活的进行资产配置调整,在严格控制风险的前提下,谋求本基金资产的保值增值,分享经济发展的成果,提供全面超越通货膨胀的收益回报。
投资策略	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
业绩比较基准	同期三年期人民币定期存款基准利率(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	中国农业银行股份有限公司

§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	154,684,893.99
2.本期利润	142,285,312.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0481
4.期末基金资产净值	2,850,680,014.28
5.期末基金份额净值	1.1977

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。

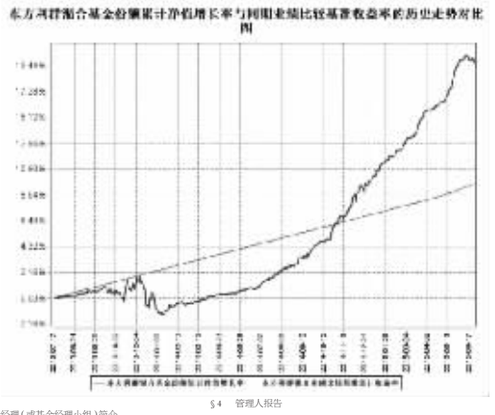
3.2 基金净值表现

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	4.08%	0.10%	1.48%	0.02%	2.60%	0.08%

注:本基金业绩比较基准原为同期五年期人民币定期存款基准利率(税后),中国人民银行自2014年11月22日起不再公布五年期定期存款基准利率,本基金自2015年5月1日起将基准调整为"同期三年期人民币定期存款基准利率(税后)+3%"。本报告期4月1日至4月30日仍采用原央行公布五年期定期存款基准利率4.75%,自5月1日至6月30日采用"同期三年期人民币定期存款基准利率(税后)+3%"的基准。

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



§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		
朱晓栋(先生)	本基金基金经理	2013年7月17日	–	6年	对外经济贸易大学经济学硕士,6年证券从业经历。2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员,东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理,东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型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、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型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、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
徐昀君(先生)	本基金基金经理	2015年3月12日	–	7年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,7年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。现任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金。

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》及其各项实施细则、《东方利群混合型发起式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或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,场外资金加速进场、杠杆比例不断提高,市场不断走牛,但随着证监会在6月中旬开始严格控制场外配资,市场呈现冲高回落的态势。

报告期内,鉴于本基金以绝对收益为主,本基金基本维持了原有权益仓位;从权益部分的持仓来看,本基金维持了精选个股,追求绝对收益的投资思路。

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4.08%,业绩比较基准收益率为1.48%,高于业绩比较基准2.6%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

通胀水平持续低位震荡,地产销售回暖对投资的拉动并不明显,中国宏观经济依然处于弱势格局,全年经济稳增长压力依然较大,货币与财政政策存在继续加码空间。

市场层面而言,居民大类资产配置向权益转移的驱动力仍在,牛市的基础没有改变;但市场流动性最宽松的时期可能已经过去,市场短期而言需要消化部分个股估值过高的压力。结构分化、去伪存真将是未来投资的主线,我们更看好业绩保持持续快速增长的行业龙头。

本基金将积极立足于基本面,结合自上而下的行业配置与自下而上的精选个股的策略,优化投资组合结构,逢低买入优质品种,争取为投资者创造持续稳定的投资回报。

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	70,355,851.92	2.45
	其中:股票	70,355,851.92	2.45
2	固定收益投资	683,354,458.00	23.76
	其中:债券	683,354,458.00	23.76
	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	1,185,152,572.58	41.21
	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	919,135,482.01	31.96
7	其他资产	17,817,493.22	0.62
8	合计	2,875,815,857.73	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	484,279.65	0.02
B	采矿业	1,635,059.25	0.06
C	制造业	52,953,931.96	1.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,237,796.96	0.25
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	212,826.60	0.01
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,536,620.68	0.05
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	673,691.40	0.02
M	科学研究和技术服务业	677,645.42	0.02
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	4,944,000.00	0.17
S	综合	–	–
	合计	70,355,851.92	2.47

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	002651	利君股份	450,000	19,440,000.00	0.68
2	002318	久立特材	100,000	5,238,000.00	0.18
3	000673	当代东方	150,000	4,944,000.00	0.17
4	600310	桂东电力	131,300	4,139,889.00	0.15
5	300274	阳光电源	100,000	3,057,000.00	0.11
6	002763	汇洁股份	84,064	3,055,726.40	0.11
7	601368	绿城水务	152,547	2,849,577.96	0.10
8	601968	宝钢包装	157,140	2,192,103.00	0.08
9	300477	合纵科技	42,625	1,686,671.25	0.06
10	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.06

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	186,096,500.00	6.53
	其中:政策性金融债	186,096,500.00	6.53
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	474,203,000.00	16.63
6	中期票据	–	–
7	可转债	23,054,958.00	0.81
8	合计	683,354,458.00	23.97

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	150301	15进出01	600,000	60,348,000.00	2.12
2	041456037	14北大荒CP001	500,000	50,535,000.00	1.77
3	041460096	14宜兴城投CP001	500,000	50,475,000.00	1.77
4	150307	15进出07	500,000	50,365,000.00	1.77
5	011473008	14鲁高速SCP008	500,000	50,345,000.00	1.77

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	109,632.13
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	17,237,725.88
5	应收申购款	470,135.21
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	17,817,493.22

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600310	桂东电力	4,139,889.00	0.15	筹划重要事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,956,986,466.85
报告期期间基金总申购份额	1,223,753,424.68
减:报告期期间基金总赎回份额	800,622,602.89
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	2,380,117,288.64

§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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	–	–	–	–	–
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	10,001,250.00	0.42	10,001,250.00	0.42	自合同生效之日起不少于3年
其他	–	–	–	–	–
合计	10,001,250.00	0.42	10,001,250.00	0.42	–

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》

二、《东方利群混合型发起式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)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2015年7月21日

东方龙混合型开放式证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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