

广发标普全球农业指数证券投资基金

2012 第二季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

基金管理人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2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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预示其未来表现,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。
本报告日期为2012年4月1日起至6月30日止。

2.1 基金产品概况
基金简称:广发全球农业指数(QDII)
基金主代码:270027
交易代码:270027
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2011年11月28日
报告期末基金份额总额:130,572,670.79份
投资目标:本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,年跟踪误差不超过5%,实现对标全球农业指数的有效跟踪。
投资策略:本基金以追求标的指数长期增长的稳定性收益为目标,在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下,采用数量化的投资组合。
业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
风险收益特征:本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人名称:Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称:布朗兄弟哈里曼银行

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -3,142,196.80
2.本期利润: -15,722,461.45
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0462
4.期末基金资产净值: 292,963,850.77
5.期末基金份额净值: 2.2428

3.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
广发标普全球农业指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
(2011年6月28日至2012年6月30日)

注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 任职日期: 离任日期: 证券从业年限: 说明:
邱峰 本基金基金经理 2011-6-28 - 5
注:1.任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期。
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。
3.报告期内本基金基金经理变更情况:
本基金报告期内,本基金管理人邱峰曾于2011年6月28日起担任广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理,并于2011年6月28日起兼任广发全球农业指数证券投资基金基金经理。

4.2 异常交易行为的专项说明
4.2.1 异常交易行为的专项说明
4.2.2 异常交易行为的专项说明
4.2.3 异常交易行为的专项说明

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2012年第二季度全球证券市场经过一季度的大幅上涨后,二季度在加息预期的影响下震荡调整,其中美国纳斯达克指数下跌6.63%,香港恒生指数下跌5.42%。
2季度中国国内经济增速明显放缓,PPI指数持续在低位,我们观察到发电量增速下降明显,港口煤炭库存持续高位,甚至大幅超过了2008年全年的最高水平,导致了动力煤价格持续下降,在国内通胀预期以及货币政策紧缩预期影响下,本季度沪深300指数震荡下跌,上证指数下跌1.65%,深证成指下跌3.31%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末在各个国家、地区证券市场的股票及存托凭证投资分布
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.4 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
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
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
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金融衍生品投资明细
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十名基金投资明细

5.9 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.10 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
5.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.13 其他各项资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.15 报告期末持有的资产支持证券明细
5.16 报告期末持有的其他金融衍生品明细

5.17 投资组合报告附注
5.18 投资组合报告附注
5.19 投资组合报告附注

5.20 投资组合报告附注
5.21 投资组合报告附注
5.22 投资组合报告附注

5.23 投资组合报告附注
5.24 投资组合报告附注
5.25 投资组合报告附注

5.26 投资组合报告附注
5.27 投资组合报告附注
5.28 投资组合报告附注

5.29 投资组合报告附注
5.30 投资组合报告附注
5.31 投资组合报告附注

5.32 投资组合报告附注
5.33 投资组合报告附注
5.34 投资组合报告附注

东方龙混合型开放式证券投资基金

2012 第二季度报告

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:2012年7月20日

基金管理人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2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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预示其未来表现,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。
本报告日期为2012年4月1日起至6月30日止。

2.1 基金产品概况
基金简称:东方龙混合
基金主代码:400001
交易代码:400001
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2004年11月25日
报告期末基金份额总额:1,871,170,292.52份
投资目标:本基金为国内经济和资本市场的高速增长,努力成为国内机构投资者长期、稳定的投资选择。
投资策略:本基金的投资策略由自上而下的资产配置和自下而上的个股(债券)选择构成。
业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率*60%+沪深300指数收益率*40%。
风险收益特征:本基金属于混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。
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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: 11,737,363.80
2.本期利润: 33,903,531.62
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0174
4.期末基金资产净值: 1,214,988,227.34
5.期末基金份额净值: 0.6492

3.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
东方龙混合型开放式证券投资基金
自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
(2004年11月25日至2012年6月30日)

注:①此处的任职日期和离任日期指在法定信息披露媒体上公告之日。
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。
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 任职日期: 离任日期: 证券从业年限: 说明:
清华大学MBA,CFA,具有基金从业资格,曾任北京证券有限责任公司资产管理部投资经理(2005年12月-2006年12月),现任东方基金管理有限责任公司基金经理,2006年12月29日,2007年8月14日,2010年9月15日担任东方龙混合证券投资基金基金经理,2008年9月20日,2008年6月31日至2010年9月15日担任东方龙混合证券投资基金基金经理,2008年6月31日至2010年9月15日担任东方龙混合证券投资基金基金经理,2008年6月31日至2010年9月15日担任东方龙混合证券投资基金基金经理,2008年6月31日至2010年9月15日担任东方龙混合证券投资基金基金经理。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末在各个国家、地区证券市场的股票及存托凭证投资分布
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.4 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
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
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
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金融衍生品投资明细
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十名基金投资明细

5.9 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.10 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
5.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.13 其他各项资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.15 报告期末持有的资产支持证券明细
5.16 报告期末持有的其他金融衍生品明细

5.17 投资组合报告附注
5.18 投资组合报告附注
5.19 投资组合报告附注

5.20 投资组合报告附注
5.21 投资组合报告附注
5.22 投资组合报告附注

5.23 投资组合报告附注
5.24 投资组合报告附注
5.25 投资组合报告附注

5.26 投资组合报告附注
5.27 投资组合报告附注
5.28 投资组合报告附注

5.29 投资组合报告附注
5.30 投资组合报告附注
5.31 投资组合报告附注

5.32 投资组合报告附注
5.33 投资组合报告附注
5.34 投资组合报告附注

5.35 投资组合报告附注
5.36 投资组合报告附注
5.37 投资组合报告附注

5.38 投资组合报告附注
5.39 投资组合报告附注
5.40 投资组合报告附注

5.41 投资组合报告附注
5.42 投资组合报告附注
5.43 投资组合报告附注

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2012 第二季度报告

2011年12月28日,至披露时点不满一年。

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:2012年7月20日

基金管理人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2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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预示其未来表现,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。
本报告日期为2012年4月1日起至6月30日止。

2.1 基金产品概况
基金简称:东方增长中小盘混合
基金主代码:400015
交易代码:400015
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2011年12月28日
报告期末基金份额总额:56,092,035.90份
投资目标:本基金采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的投资策略。
投资策略:本基金的投资策略由自上而下的资产配置和自下而上的个股(债券)选择构成。
业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率*60%+沪深300指数收益率*40%。
风险收益特征:本基金属于混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。
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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: 2,225,597.98
2.本期利润: 5,299,907.90
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0758
4.期末基金资产净值: 60,632,142.32
5.期末基金份额净值: 1.0829

3.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金
自基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
(2011年12月28日至2012年6月30日)

注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。本基金合同生效日期为2011年12月28日。

2012年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为3.01%,业绩比较基准收益率为0.73%,高于业绩比较基准2.28%。
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3季度,我们认为中国经济有继续放缓,房地产市场在2季度已经企稳,估值危机已初步得到缓解,内部需求有所回升,但仍健康。中国经济增长的动力仍在,中国人民对财富的渴望使他们有动力去克服各种困难,继续以住持稳健。
目前,A股市场整体估值投资价值非常低,这将封杀A股市场大幅下跌的空间,投资者有非理性的资金行为有所改观,部分板块投资价值仍将下跌空间有限;目前对市场影响最大的是投资者的信心,可能导致未来市场的走势充满波折。
从行业层面上,继续看好金融服务、商业贸易、房地产、汽车等低估值、成长确定的行业;自下而上,看好那些未来发展空间大、竞争力强、估值合理的中小市值公司。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末在各个国家、地区证券市场的股票及存托凭证投资分布
5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.4 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
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
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
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金融衍生品投资明细
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十名基金投资明细

5.9 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.10 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
5.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
5.13 其他各项资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.15 报告期末持有的资产支持证券明细
5.16 报告期末持有的其他金融衍生品明细

5.17 投资组合报告附注
5.18 投资组合报告附注
5.19 投资组合报告附注

5.20 投资组合报告附注
5.21 投资组合报告附注
5.22 投资组合报告附注

5.23 投资组合报告附注
5.24 投资组合报告附注
5.25 投资组合报告附注

5.26 投资组合报告附注
5.27 投资组合报告附注
5.28 投资组合报告附注

5.29 投资组合报告附注
5.30 投资组合报告附注
5.31 投资组合报告附注

5.32 投资组合报告附注
5.33 投资组合报告附注
5.34 投资组合报告附注

5.35 投资组合报告附注
5.36 投资组合报告附注
5.37 投资组合报告附注

5.38 投资组合报告附注
5.39 投资组合报告附注
5.40 投资组合报告附注

5.41 投资组合报告附注
5.42 投资组合报告附注
5.43 投资组合报告附注

5.44 投资组合报告附注
5.45 投资组合报告附注
5.46 投资组合报告附注

5.47 投资组合报告附注
5.48 投资组合报告附注
5.49 投资组合报告附注

5.50 投资组合报告附注
5.51 投资组合报告附注
5.52 投资组合报告附注

5.53 投资组合报告附注
5.54 投资组合报告附注
5.55 投资组合报告附注