东方稳健回报债券型证券投资基金

【2015】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: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	东方稳健回报债券
基金主代码	400009
交易代码	400009
前端交易代码	400009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月10日
报告期末基金份额总额	937,138,870.09份
投资目标	在控制风险和确保资产流动性的前提下,追求较高总回报率,力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金秉行“积极投资、稳健增值”的投资理念,在保持组合较低波动性的同时,采用稳健的资产配置策略和多种积极管理增值手段,实现较高的总回报率。
业绩比较基准	中债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险和预期收益率低于直接参与一级市场股票、权证投资的债券型基金,高于纯债券型基金。
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 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	20,512,982.62
2.本期利润	29,658,697.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0328
4.期末基金资产净值	1,060,439,609.59
5.期末基金份额净值	1.132

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。

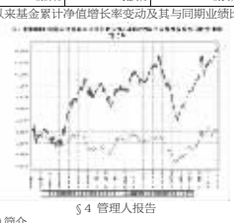
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.00%	0.07%	1.34%	0.14%	1.66%	-0.07%

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		
李仆(先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理、投资决策委员会委员	2014年10月13日	-	15年	15年证券从业经历,曾任宝钢集团财务有限责任公司投资经理、宝钢集团有限公司投资经理、宝乌(香港)贸易有限公司投资部总经理、华宝信托有限责任公司资管部投资副总监、信诚基金管理有限公司基金经理。2014年2月加盟东方基金管理有限责任公司,现任固定收益部总经理、投资决策委员会委员、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券基金基金经理、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金、东方赢安保本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	2013年12月24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,曾任安信证券投资管理部研究员、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、《东方稳健回报债券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。

基金管理人建立了集中交易制度,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

2015年二季度,宏观经济维持低位,表现平淡。具体而言,工业增加值同比增速维持低迷,除房地产行业销量增长以外,其余行业均表现疲弱,如发电耗煤、交运等行业大幅下滑;通胀水平维持低位,其中,食品价格呈现季节性小幅回落,原材料价格持续下跌;PMI制造业指数相较于一季度有所回升,但仍处于历年同期较低水平。

在经济维持低迷的压力下,二季度央行陆续出台宽松政策,先后2次降准、2次降息,并通过降低逆回购利率、SLF、MLF等宽松操作降低社会融资成本、释放流动性,支持资本市场。

二季度债券市场受货币政策因素等影响,其收益率水平仍维持低位。具体而言,4月,债券收益率受央行降准等因素影响有所下行;5月,债券收益率受中核等巨量IPO、地方债挤压等因素影响呈现上行趋势;6月,债券收益率在央行降息降准的影响下再度下降至低位。

报告期内,本基金组合较为稳定,以享受票息为主,获得了较好的绝对收益。

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3.00%,业绩比较基准收益率为1.34%,高于业绩比较基准1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,宏观经济有望在政府稳增长的政策支持下得以回升。具体而言,二季度PMI制造业指数较一季度已经有所上行,预示着三季度经济的进一步好转;央行有望于三季度通过货币政策及定向操作工具进一步降低利率,推动地方政府债务的置换;地产行业将受益于低利率、房市政策改善等因素,于三季度有所好转;一带一路、国企改革等政策热点将一定程度地推动三季度经济的增长。

对于三季度债券市场而言,宽松货币政策将推动利率水平不断下行、宏观企稳的预期有望降低信用利差、IPO暂停及股市调整的因素将重新配置打新基金的流向,利好债券市场。

未来,本基金将继续以持有中短久期、高收益的信用债为主,以获得稳定的票息收入,实现绝对收益。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承“诚信是基、回报为金”的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

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	1,904,323.16	0.12
	其中:股票	1,904,323.16	0.12
2	固定收益投资	1,532,152,153.37	95.98
	其中:债券	1,532,152,153.37	95.98
	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	28,009,042.17	1.75
7	其他资产	34,193,442.94	2.14
8	合计	1,596,258,961.64	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	952.32	0.00
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	-	-
J	金融业	1,903,370.84	0.18
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,904,323.16	0.18

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	600016	民生银行	191,486	1,903,370.84	0.18
2	600023	浙能电力	96	952.32	0.00
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	1,508,550.00	0.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	85,035,500.00	8.02
	其中:政策性金融债	85,035,500.00	8.02
4	企业债券	1,002,158,255.17	94.50
5	企业短期融资券	370,947,570.00	34.98
6	中期票据	71,624,000.00	6.75
7	可转债	878,278.20	0.08
8	其他	-	-
9	合计	1,532,152,153.37	144.48

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	1480501	14安康高新债	500,000	53,075,000.00	5.00
2	041555011	15冀建投CP001	497,000	50,102,570.00	4.72
3	011519005	15国电SCP005	500,000	49,955,000.00	4.71
4	1080155	10安顺国资债02	400,000	41,708,000.00	3.93
5	1080101	10邵阳城投债	400,000	41,108,000.00	3.88

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 根据基金合同的规定,本基金可投资于一级市场新股网上申购,公开增发新股、可转换债券转股、股票或可分离交易债券派发的权证。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的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	87,409.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,985,843.34
5	应收申购款	1,120,190.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,193,442.94

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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	789,887,862.54
报告期期间基金总申购份额	253,836,439.24
减:报告期期间基金总赎回份额	106,585,431.69
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	937,138,870.09

§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、《东方稳健回报债券型证券投资基金合同》

二、《东方稳健回报债券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

东方新兴成长混合型证券投资基金

【2015】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	东方新兴成长混合
基金主代码	400025
交易代码	400025
前端交易代码	400025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月3日
报告期末基金份额总额	250,908,104.87份
投资目标	本基金以稳健收益为目标,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整。同时,重点投资于符合本基金定义的新兴成长股票,获得基金的长期稳定增值。
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	43,317,986.34
2.本期利润	12,307,179.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0641
4.期末基金资产净值	424,847,252.84
5.期末基金份额净值	1.6932

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。

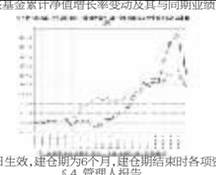
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	21.39%	2.51%	7.24%	1.57%	14.15%	0.94%

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2014年9月3日生效,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。

§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、投资决策委员会委员	2014年9月3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。
王然(女士)	本基金基金经理	2015年6月25日	-	7年	北京交通大学产业经济学硕士,7年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员,东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理,现任东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理、东方策略成长股票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、东方新思路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》及其各项实施细则、《东方新兴成长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,恐慌情绪收重。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,侧重对战略新兴产业的成长股龙头的价值挖掘,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1日至2015年6月30日,本基金净值增长率为21.39%,业绩比较基准收益率为7.24%,高于业绩比较基准14.15%。

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,充分分享科技蓬勃带来的价值成长。

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	359,203,701.94	79.87
	其中:股票	359,203,701.94	79.87
2	固定收益投资	20,074,000.00	4.46
	其中:债券	20,074,000.00	4.46
	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	69,503,360.41	15.45
7	其他资产	946,161.36	0.21
8	合计	449,727,223.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	154,236,842.79	36.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,010.00	0.06
E	建筑业	17,524,422.66	4.12
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	58,819,733.91	13.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,054,317.35	4.01
M	科学研究和技术服务业	38,760,458.87	9.12
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	28,494,999.92	6.71
R	文化、体育和娱乐业	44,045,916.44	10.37
S	综合	-	-
	合计	359,203,701.94	84.55

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	899,941	38,760,458.87	9.12
2	300015	爱尔眼科	883,292	28,494,999.92	6.71
3	000681	视觉中国	519,324	21,323,443.44	5.02
4	600570	恒生电子	170,000	19,048,500.00	4.48
5	600699	均胜电子	479,931	18,386,156.61	4.33
6	002375	亚厦股份	599,946	17,524,422.66	4.12
7	000915	山大华特	300,000	16,800,000.00	3.95
8	300252	金信诺	399,912	15,864,509.04	3.73
9	600184	光电股份	519,946	14,641,679.36	3.45
10	000156	华数传媒	400,000	14,312,000.00	3.37

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	10,043,000.00	2.36
	其中:政策性金融债	10,043,000.00	2.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,031,000.00	2.36
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,074,000.00	4.72

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	150411	15农发11	100,000	10,043,000.00	2.36
2	041572006	15扬州经开CP001	100,000	10,031,000.00	2.36
3					
4					
5					

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	106,359.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	132,707.32
5	应收申购款	707,094.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	946,161.36

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	300012	华测检测	38,760,458.87	9.12	筹划重大事项
2	002375	亚厦股份	17,524,422.66	4.12	筹划并审议员工持股计划

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	145,397,316.78
报告期期间基金总申购份额	302,054,080.80
减:报告期期间基金总赎回份额	196,543,292.71
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	250,908,104.87

§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、《东方新兴成长混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方新兴成长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

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