

## 东方双债添利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的财务指标，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的内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者进行投资时应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同自2010年4月1日起至2015年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	东方双债添利债券
基金代码	400027
交易代码	400027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月24日
报告期末基金份额总额	588,439,625.47份
报告期末基金资产净值	166,046,001.31元
占基金总资产的比例(%)	35.11
其中：股票	166,046,001.31
占比	35.11
2 固定收益投资	852,804,419.20
占比	77.58
其中：债券	852,804,419.20
占比	77.58
其中：国债	—
金融债	—
企业债	—
可转换债券	—
资产支持证券	—
权证	—
其他	—
3 货币市场工具	—
4 金融衍生品投资	—
5 定期存款	—
6 其他资产	—
7 其他负债	56,134,979.40
占比	5.11
8 合计	24,209,468.26
占比	2.26
9 合计	1,099,194,868.17
占比	100.00

报告期末未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 制造业 — —

C 制造业 30,166,575.08 3.22

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 — —

E 建筑业 13,410.00 0.00

F 铁路、船舶、航空航天和其他运输设备制造业 — —

G 交通运输、仓储和邮政业 — —

H 食品、饮料、烟草、纺织、服装、皮革、皮毛、鞋帽、钟表、眼镜等制造业 — —

I 信息传输、软件和信息技术服务业 3,066,000.00 0.33

J 钢铁业 43,155,125.00 4.60

K 房地产业 29,804,100.00 3.18

L 租赁和商务服务业 9,390.00 0.00

M 科学研究和技术服务业 54,860,244.25 5.85

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 1,936,083.90 0.21

R 文化、体育和娱乐业 3,035,073.08 0.32

S 综合 — —

合计 166,046,001.31 17.70

报告期末按行业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 国债 1,528,550.00 0.16

2 短期国债 — —

3 债券基金 46,091,800.00 4.91

4 企业债 46,091,800.00 4.91

5 可转债 48,391,103.30 5.16

6 中票 600,000.00 0.66

7 资产支持证券 350,000.00 0.57

8 其他债券 130,000.00 0.45

9 合计 852,804,419.20 90.89

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 132001 华阳检测 1,273,275 54,836,954.25 5.84

2 000204 招商地产 690,000 21,831,600.00 2.33

3 601099 中国重工 1,040,000 15,392,000.00 1.64

4 601166 光大银行 2,600,000 13,936,000.00 1.49

5 002058 金隅股份 578,000 9,972,225.00 1.06

6 002542 方正证券 280,000 8,680,000.00 0.93

7 002654 万润科技 204,000 6,052,680.00 0.68

8 001169 北京银行 420,000 5,594,400.00 0.60

9 600015 华夏银行 350,000 5,325,200.00 0.57

10 600185 机构 — —

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

序号 贵金属品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国黄金 1,528,550.00 0.16

2 中国白银 — —

3 中国铂金 — —

4 中国钯金 — —

5 中国金币 — —

6 中国金币 — —

7 中国金币 — —

8 中国金币 — —

9 中国金币 — —

10 中国金币 — —

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 华阳检测 1,273,275 54,836,954.25 5.84

2 000204 招商地产 690,000 21,831,600.00 2.33

3 601099 中国重工 1,040,000 15,392,000.00 1.64

4 601166 光大银行 2,600,000 13,936,000.00 1.49

5 002058 万润科技 204,000 6,052,680.00 0.68

6 001169 北京银行 420,000 5,594,400.00 0.60

7 000015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

8 600185 机构 — —

9 600015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

10 600185 机构 — —

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 132001 华阳检测 1,273,275 54,836,954.25 5.84

2 000204 招商地产 690,000 21,831,600.00 2.33

3 601099 中国重工 1,040,000 15,392,000.00 1.64

4 601166 光大银行 2,600,000 13,936,000.00 1.49

5 002058 万润科技 204,000 6,052,680.00 0.68

6 001169 北京银行 420,000 5,594,400.00 0.60

7 000015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

8 600185 机构 — —

9 600015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

10 600185 机构 — —

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 132001 华阳检测 1,273,275 54,836,954.25 5.84

2 000204 招商地产 690,000 21,831,600.00 2.33

3 601099 中国重工 1,040,000 15,392,000.00 1.64

4 601166 光大银行 2,600,000 13,936,000.00 1.49

5 002058 万润科技 204,000 6,052,680.00 0.68

6 001169 北京银行 420,000 5,594,400.00 0.60

7 000015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

8 600185 机构 — —

9 600015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

10 600185 机构 — —

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 132001 华阳检测 1,273,275 54,836,954.25 5.84

2 000204 招商地产 690,000 21,831,600.00 2.33

3 601099 中国重工 1,040,000 15,392,000.00 1.64

4 601166 光大银行 2,600,000 13,936,000.00 1.49

5 002058 万润科技 204,000 6,052,680.00 0.68

6 001169 北京银行 420,000 5,594,400.00 0.60

7 000015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

8 600185 机构 — —

9 600015 中国银行 350,000 5,325,200.00 0.57

10 600185 机构 — —

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债券投资明细