

东方精选混合型开放式证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 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

送出日期：二〇一六年三月二十六日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方精选混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	2,034,198,799.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	标普中国 A 股 300 成长指数×60%+中证综合债指数×40%
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。

注：本基金自 2015 年 11 月 2 日起对业绩比较基准进行更名，原业绩比较基准为“中信标普 300 成长指数×60%+中证综合债指数×40%”，更名后的业绩比较基准“标普中国 A 股 300 成长指数×60%+中证综合债指数×40%”。详情可参阅本公司于 2015 年 11 月 4 日发布的《东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金业绩比较基准名称变更并修改基金合同的公告》等相关公告。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东方基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	李景岩	罗菲菲
	联系电话	010-66295888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95568
传真		010-66578700	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	2,160,484,734.30	398,402,950.02	107,964,017.32
本期利润	2,187,087,371.46	825,886,532.99	164,665,470.30
加权平均基金份额本期利润	0.8397	0.1907	0.0324
本期基金份额净值增长率	58.72%	18.98%	3.23%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	1.2987	0.4761	0.3775
期末基金资产净值	3,991,751,712.65	4,666,610,610.58	4,835,342,537.85
期末基金份额净值	1.9623	1.2363	1.0391

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期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

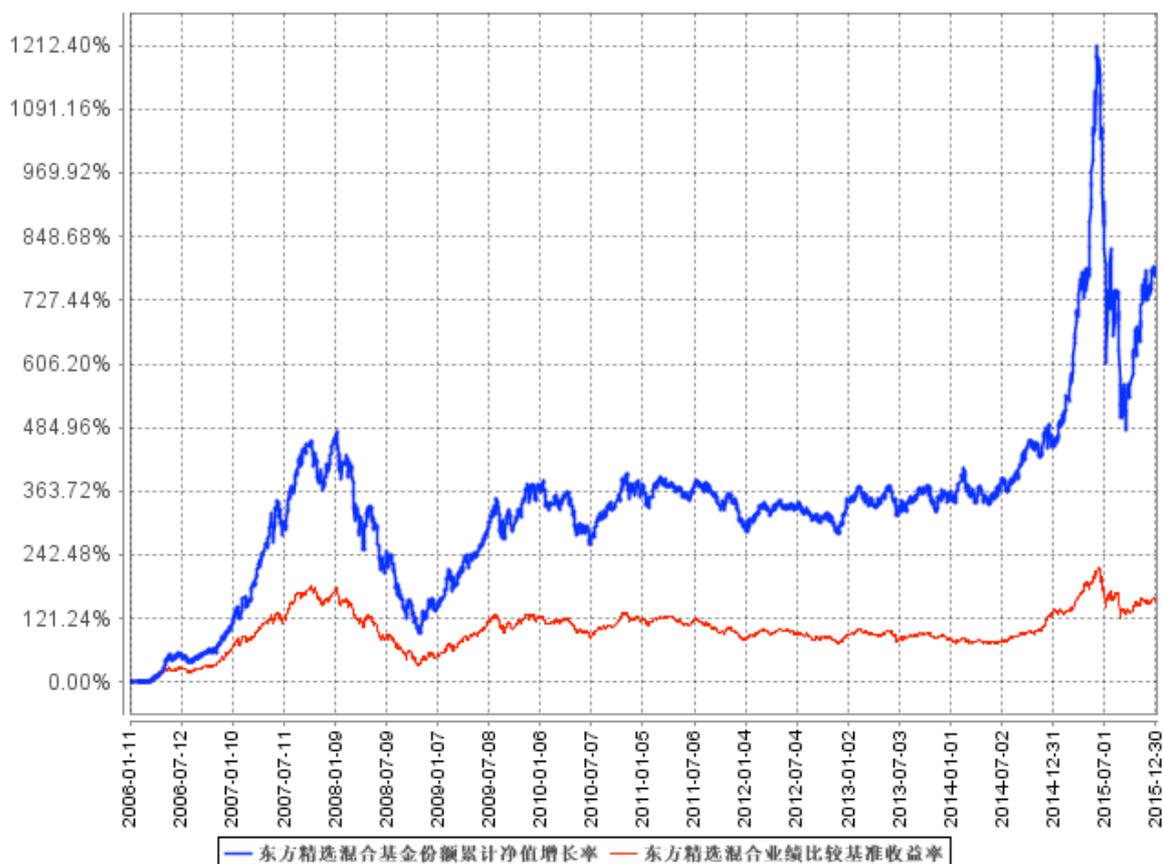
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	31.25%	2.09%	9.78%	1.04%	21.47%	1.05%
过去六个月	-13.93%	3.34%	-14.22%	1.72%	0.29%	1.62%
过去一年	58.72%	2.86%	16.41%	1.55%	42.31%	1.31%
过去三年	94.94%	1.90%	70.50%	1.09%	24.44%	0.81%
过去五年	85.77%	1.58%	30.08%	0.99%	55.69%	0.59%
自基金合同生效起至今	774.52%	1.73%	154.82%	1.16%	619.70%	0.57%

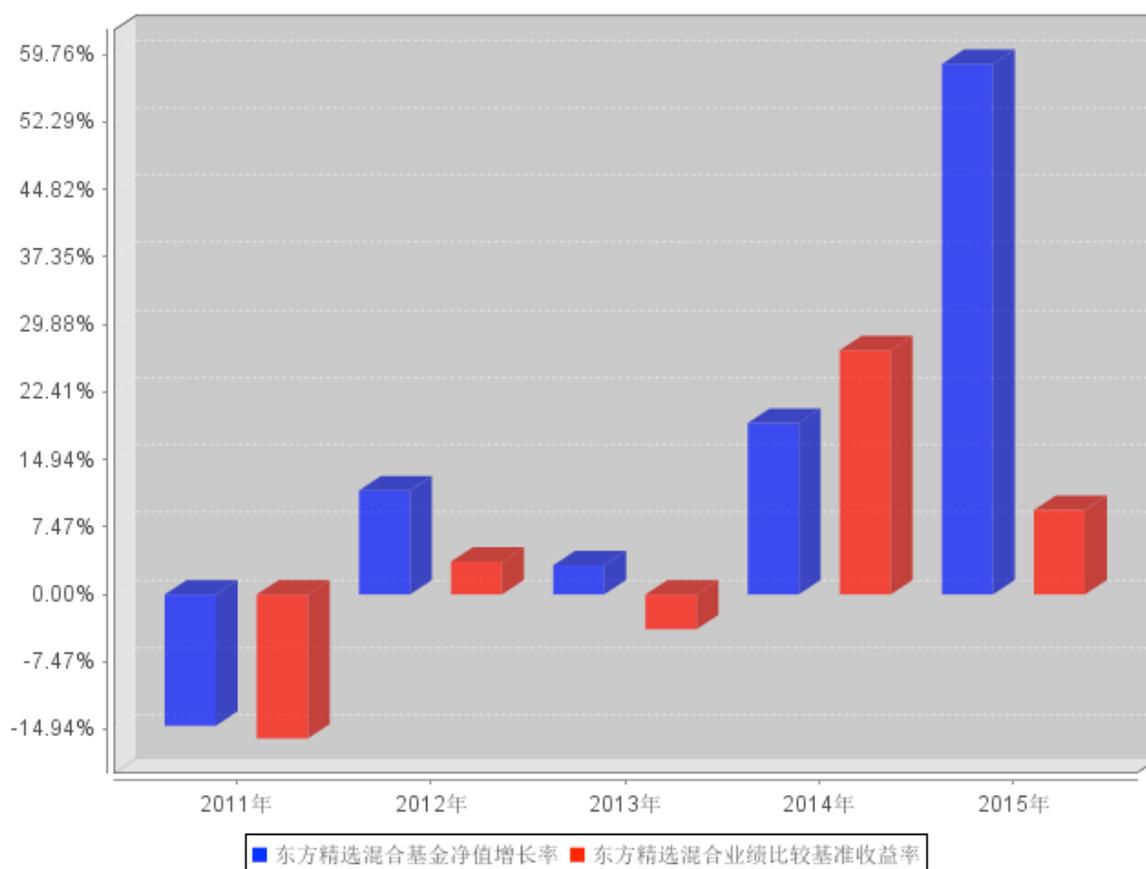
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方精选混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方精选混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立，本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币12800万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币5400万元，占公司注册资本27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币1800万元，占公司注册资本的9%。截止2015年12月31日，本公司管理28只开放式证

券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方保本混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方赢家保本混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2013年1月4日	2015年8月20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。

				<p>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、权益投资部总经理、投资决策委员会委员、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长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</p>
--	--	--	--	--

					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

					<p>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。</p>
朱晓栋 (先生)	<p>本基金基金经理、权益投资部总经理助理、投资决策委员会委员</p>	2015年8月12日	-	6年	<p>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</p>

					<p>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。现任权益投资部总经理助理、投资决策委员会委员、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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式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</p>
--	--	--	--	--	---

					证券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）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、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。
邱义鹏 (先生)	本基金基金经理助理	2014 年 4 月 17 日	2015 年 3 月 6 日	7 年	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

本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用基金资产，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。本基金无重大违法、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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内的公平交易程序；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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，在受益经济转型和风险偏好提升的创业板带领下，市场出现了大幅上涨，但随着年中去杠杆与人民币汇率下跌，市场也经历了两轮明显地调整，最终上证综指、中小板指、创业板指分别上涨 9.41%、53.7%、84.41%。

报告期内，本基金进行持仓结构优化，积极布局现代服务业、新材料、新能源等战略方向，全年净值出现较高增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 58.72%，业绩比较基准收益率为 16.41%，高于业绩比较基准 42.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济数据所显示的趋势来看，经济基本面依然处于下降的弱势之中，在 2016 年，中国制造业的困局有望在人民币持续贬值中得到改善，同时供给侧的改革政策也将推进传统过剩产能的出清，经济基本面有望得到改善；需要警惕的是供给侧改革带来的阵痛，使得经济呈现前低后高走势的概率较大。

市场层面而言，支持 2015 年股市上涨的几大因素均发生了一些变化，无风险利率在央行连续降息以及汇率的制约之下，下行空间已经不大，而企业盈利的改善需要等到下半年才能看到，因此我们对一季度市场持谨慎态度。但由资产荒导致的被动配置需求支撑，市场调整充分之后将重新迎来较好的投资机会，在此情况出现之前，本基金将保持中性仓位运作，并根据市场情况择机提高仓位。对于行业配置策略而言，我们看好“破旧立新”两个方向，“立新”来自于行业景气度较高、可持续性好的新兴行业，例如新材料、新能源、文化传媒；同时，我们积极关注受益于供给侧改革的“破旧”行业，传统产业的过剩产能出清将带来行业整体盈利的改善，相关行业将迎来较好的投资机会。

本基金将立足产业发展方向、公司基本面，寻找中国经济转型中具有核心竞争力的龙头企业，以合适的价格买入优质企业，为持有人创造稳定、持续的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内

部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会公告【2008】38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任1名，委员会副主任1-2名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，

根据估值委员会要求和运营部的估值方案, 负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当, 对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”, 建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时, 建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末, 公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》, 并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》, 并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值(适用非货币基金)。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定, 结合本基金实际运作情况, 本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 人或基金资产规模低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对东方精选混合型开放式证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定, 依法安全保管了基金财产, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人—东方基金管理有限责任公司在东方精选混合型开放式证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由东方精选混合型开放式证券投资基金管理人—东方基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金本年度财务会计报告已经审计，立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方精选混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	247,476,465.06	58,599,139.05
结算备付金		11,097,606.03	5,349,164.72
存出保证金		1,984,367.73	2,457,671.80
交易性金融资产	7.4.7.2	3,621,910,052.56	4,631,434,087.10

其中：股票投资		3,437,434,052.56	4,175,617,787.10
基金投资		-	-
债券投资		184,476,000.00	455,816,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	120,000,580.00	-
应收证券清算款		4,023,093.58	36,982,278.54
应收利息	7.4.7.5	3,190,379.54	11,642,234.53
应收股利		-	-
应收申购款		3,812,595.57	727,619.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,013,495,140.07	4,747,192,195.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,701,284.40	48,839,260.54
应付赎回款		5,571,934.09	21,086,078.50
应付管理人报酬		5,065,494.49	6,296,236.64
应付托管费		844,249.08	1,049,372.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	8,237,610.48	3,091,090.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	322,854.88	219,546.30
负债合计		21,743,427.42	80,581,584.83
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	746,872,657.63	1,385,875,597.76
未分配利润	7.4.7.10	3,244,879,055.02	3,280,735,012.82
所有者权益合计		3,991,751,712.65	4,666,610,610.58
负债和所有者权益总计		4,013,495,140.07	4,747,192,195.41

注：①报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9623 元，基金份额总额 2,034,198,799.95 份。

②本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：东方精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		2,292,814,093.18	925,205,386.96
1. 利息收入		16,073,386.87	19,746,656.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,237,381.34	1,281,111.01
债券利息收入		11,014,958.60	17,949,227.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		821,046.93	516,318.15
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,244,485,482.13	476,128,686.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,233,929,593.65	450,060,423.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	-76,302.77	3,129,933.55
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	10,632,191.25	22,938,329.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	26,602,637.16	427,483,582.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,652,587.02	1,846,460.79
减：二、费用		105,726,721.72	99,318,853.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	70,371,324.87	71,835,799.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	11,728,554.21	11,972,633.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	22,712,806.21	14,518,824.39
5. 利息支出		476,460.40	539,994.31
其中：卖出回购金融资产支出		476,460.40	539,994.31
6. 其他费用	7.4.7.20	437,576.03	451,602.91
三、利润总额（亏损总额以		2,187,087,371.46	825,886,532.99

“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,187,087,371.46	825,886,532.99

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,385,875,597.76	3,280,735,012.82	4,666,610,610.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,187,087,371.46	2,187,087,371.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-639,002,940.13	-2,222,943,329.26	-2,861,946,269.39
其中：1. 基金申购款	886,476,079.19	4,233,620,012.45	5,120,096,091.64
2. 基金赎回款	-1,525,479,019.32	-6,456,563,341.71	-7,982,042,361.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	746,872,657.63	3,244,879,055.02	3,991,751,712.65
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,708,502,674.75	3,126,839,863.10	4,835,342,537.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	825,886,532.99	825,886,532.99

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-322,627,076.99	-671,991,383.27	-994,618,460.26
其中：1. 基金申购款	728,910,487.85	1,540,782,585.49	2,269,693,073.34
2. 基金赎回款	-1,051,537,564.84	-2,212,773,968.76	-3,264,311,533.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,385,875,597.76	3,280,735,012.82	4,666,610,610.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孙晔伟	_____ 秦熠群	_____ 张蓉梅
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方精选混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2005 年 9 月 7 日中国证监会《关于同意东方精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2005】153 号）和《关于东方精选混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2005】273 号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》自 2005 年 11 月 21 日至 2006 年 1 月 6 日公开募集设立。本基金为混合型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 345,693,780.96 元人民币，业经天华会计师事务所“天华验字（2006）第 058-03 号”及“天华验字（2006）第 058-04 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》于 2006 年 1 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 345,758,456.53 份基金单位，其中认购资金利息折合 64,675.57 份基金单位。本基金的基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照中国财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合新会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一年保持一致，会计估计发生变更。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），本公司旗下公募基金自 2015 年 3 月 30 日起实施新的债券估值标准。对在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价。对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价。对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用成本估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关

于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》财税[2015]101 号及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。
6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国民生银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	70,371,324.87	71,835,799.16
其中：支付销售机构的客户维护费	11,920,446.73	14,004,521.94

注：①计提标准：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.5\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,728,554.21	11,972,633.20

注：①计提标准：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.25\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2006 年 1 月 11 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	302,424.23	302,424.23
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	302,424.23	302,424.23
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.01%

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	247,476,465.06	4,086,976.56	58,599,139.05	1,096,908.91

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600502	安徽水利	2015 年 10 月 20 日	重大事项	13.65	-	-	4,000,000	48,620,430.45	54,600,000.00	-
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项	26.49	2016 年 1 月 11 日	21.21	1,807,392	38,227,739.38	47,877,814.08	-
002465	海格通信	2015 年 12 月 30 日	重大事项	16.69	2016 年 2 月 4 日	15.02	2,000,000	31,551,321.11	33,380,000.00	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大事项	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	625,000	25,025,176.63	19,531,250.00	-
300194	福安药业	2015 年 10 月 8 日	重大事项	24.55	2016 年 1 月 4 日	20.85	599,961	9,238,622.91	14,729,042.55	-
300036	超图	2015	重大	39.01	2016 年 1	35.11	52,000	1,517,800.00	2,028,520.00	-

	软件	年 10 月 30 日	事项		月 15 日					
--	----	-------------------	----	--	--------	--	--	--	--	--

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日, 本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,437,434,052.56	85.65
	其中: 股票	3,437,434,052.56	85.65
2	固定收益投资	184,476,000.00	4.60
	其中: 债券	184,476,000.00	4.60
	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	120,000,580.00	2.99
	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	258,574,071.09	6.44
7	其他各项资产	13,010,436.42	0.32
8	合计	4,013,495,140.07	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	120,546,371.20	3.02
B	采矿业	19,972,064.30	0.50
C	制造业	1,824,891,229.78	45.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	172,874,952.69	4.33
F	批发和零售业	68,670,188.34	1.72
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	289,465,266.87	7.25
J	金融业	116,802,904.75	2.93
K	房地产业	41,321,990.35	1.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	201,638,000.00	5.05
N	水利、环境和公共设施管理业	11,848,000.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	246,321,505.18	6.17
R	文化、体育和娱乐业	323,081,579.10	8.09
S	综合	-	-
	合计	3,437,434,052.56	86.11

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000681	视觉中国	8,499,910	323,081,579.10	8.09
2	300015	爱尔眼科	7,799,921	246,321,505.18	6.17

3	300012	华测检测	8,200,000	201,638,000.00	5.05
4	300285	国瓷材料	4,000,000	182,000,000.00	4.56
5	002260	德奥通航	3,199,978	144,639,005.60	3.62
6	002375	亚厦股份	7,499,997	118,274,952.69	2.96
7	300182	捷成股份	4,900,000	117,600,000.00	2.95
8	002665	首航节能	3,599,828	109,794,754.00	2.75
9	300304	云意电气	3,419,943	101,230,312.80	2.54
10	600579	天华院	6,000,000	100,020,000.00	2.51

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300012	华测检测	183,084,029.80	3.92
2	300285	国瓷材料	163,501,529.50	3.50
3	000681	视觉中国	140,527,931.99	3.01
4	600094	大名城	139,484,543.13	2.99
5	000156	华数传媒	127,220,340.07	2.73
6	002129	中环股份	115,877,114.69	2.48
7	002230	科大讯飞	110,130,390.45	2.36
8	300203	聚光科技	109,327,219.03	2.34
9	600699	均胜电子	105,281,129.60	2.26
10	002260	德奥通航	104,333,033.25	2.24
11	002665	首航节能	102,579,691.99	2.20
12	300182	捷成股份	91,933,606.23	1.97
13	300429	强力新材	87,752,753.86	1.88
14	300027	华谊兄弟	86,217,163.48	1.85
15	300304	云意电气	84,115,468.90	1.80
16	300385	雪浪环境	80,462,965.80	1.72
17	002546	新联电子	78,810,006.65	1.69
18	000998	隆平高科	78,612,506.90	1.68

19	000413	东旭光电	77,256,215.85	1.66
20	601318	中国平安	74,849,801.00	1.60

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300170	汉得信息	622,217,634.86	13.33
2	300024	机器人	560,894,578.12	12.02
3	600570	恒生电子	545,277,174.29	11.68
4	000681	视觉中国	413,323,385.78	8.86
5	300252	金信诺	294,285,913.97	6.31
6	600372	中航电子	286,946,208.24	6.15
7	000915	山大华特	237,038,387.57	5.08
8	300124	汇川技术	207,611,284.71	4.45
9	002375	亚厦股份	188,166,606.82	4.03
10	002421	达实智能	185,913,446.69	3.98
11	002214	大立科技	184,744,084.09	3.96
12	000939	凯迪生态	162,562,085.04	3.48
13	300203	聚光科技	162,065,072.88	3.47
14	000669	金鸿能源	160,155,539.73	3.43
15	300012	华测检测	157,606,028.06	3.38
16	300084	海默科技	143,795,054.50	3.08
17	600184	光电股份	127,618,588.61	2.73
18	600557	康缘药业	125,175,409.33	2.68
19	600094	大名城	115,755,264.92	2.48
20	300015	爱尔眼科	114,414,789.72	2.45
21	300027	华谊兄弟	103,142,678.31	2.21
22	002230	科大讯飞	93,574,178.21	2.01

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费

用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,552,210,253.60
卖出股票收入（成交）总额	8,545,690,216.18

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	184,476,000.00	4.62
	其中：政策性金融债	184,476,000.00	4.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	184,476,000.00	4.62

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120309	12 进出 09	1,000,000	101,580,000.00	2.54
2	130231	13 国开 31	200,000	21,218,000.00	0.53
3	130230	13 国开 30	200,000	21,032,000.00	0.53
4	130312	13 进出 12	200,000	20,624,000.00	0.52

5	110221	11 国开 21	200,000	20,022,000.00	0.50
---	--------	----------	---------	---------------	------

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金所持有的德奥通航（002260）全资子公司南通德奥斯太尔航空发动机有限公司于 2014 年 12 月 1 日与南通中奥苏通生态园产业发展有限公司签署了《通用航空发动机技术平台-转子发动机开发委托合同》，金额 6,500 万元人民币，其中，合同一期项目已于 2014 年 12 月 23 日完成，公司确认收入 4,000 万元，增加公司 2014 年度净利润 2,810 万元，占公司 2013 年度经审计净利润的 140.04%。对于公司全资子公司签署前述委托合同的事项，公司未及时履行信息披露义务，直至 2015 年 1 月 14 日才对外披露。2015 年 6 月 15 日深圳证券交易所针对公司未及时披露公司重大事项进行公开批评。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 运营部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资德奥通航主要基于以下原因：从基本面上看，2013 年 8 月公司提出通用航空业务未来 5 年的发展战略规划，此后公司通过国内和连续收购及合作展开通航业务布局。国内方面，2013 年 10 月收购东营德奥直升机公司，2014 年 1 月与江苏南通苏通科技产业园合作组织实施通用航空产业项目。国际方面，成立伊立浦国际控股作为通航业务国际运作平台，2014 年 5 月收购瑞士 MESA85.6%的股权和德国 SkyTRAC/SkyRIDER 共轴双旋翼直升机项目的全部技术资产和样机，2014 年 7 月与奥地利 SAG 公司合作成为其无人机系统中国区独家总代理，2014 年 8 月收购 ROTORFLY 公司 R30 共轴双旋翼直升机资产包。公司在通航领域布局不断推进，逐步由传统家电企业转型为通航企业。我们认为公司未来有望进一步打造成为直升机和无人机生产、维修、服务和培训一体化的通航平台。公司所从事的通用航空发展潜力巨大，同国内同业相比竞争优势也非常突出。本基金在这一投资过程中严格遵守了上述投资程序。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,984,367.73
2	应收证券清算款	4,023,093.58
3	应收股利	-
4	应收利息	3,190,379.54

5	应收申购款	3,812,595.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,010,436.42

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
100,997	20,141.18	488,223,482.73	24.00%	1,545,975,317.22	76.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	301,644.82	0.01%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年1月11日）基金份额总额	345,758,456.53
本报告期期初基金份额总额	3,774,598,002.52
本报告期基金总申购份额	2,414,426,488.16
减:本报告期基金总赎回份额	4,154,825,690.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,034,198,799.95

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金管理人（公司）存在一起未决诉讼案件，系原公司员工与公司之间的民事诉讼案件。二审已开庭审理，尚未判决。

本报告期内，无涉及本基金财产业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 80,000.00 元；截至 2015 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 8 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	1	2,335,836,746.14	16.57%	2,112,581.41	16.52%	-
海通证券股份有限公司	1	1,886,030,859.94	13.38%	1,706,328.72	13.35%	-
安信证券股份有限公司	1	1,460,714,093.16	10.36%	1,358,611.88	10.63%	-
方正证券股份有限公司	1	1,143,983,085.80	8.11%	1,012,316.36	7.92%	-
华泰证券股份有限公司	1	1,085,368,071.14	7.70%	973,080.63	7.61%	-
长江证券股份有限公司	1	1,051,195,951.38	7.46%	930,205.73	7.28%	-
广发证券股份有限公司	2	980,490,355.62	6.96%	885,203.39	6.92%	-
申万宏源证券有限公司	1	973,444,579.05	6.91%	893,241.70	6.99%	-
渤海证券股份有限公司	1	943,628,128.58	6.69%	859,928.96	6.73%	-

中国银河证券股份有限公司	1	790,107,644.46	5.60%	734,538.54	5.74%	-
东兴证券股份有限公司	1	552,171,594.62	3.92%	502,697.22	3.93%	-
光大证券股份有限公司	1	451,182,560.44	3.20%	411,162.07	3.22%	-
招商证券股份有限公司	1	403,490,215.33	2.86%	371,015.06	2.90%	-
中信证券股份有限公司	2	39,922,894.00	0.28%	35,327.26	0.28%	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：① 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③ 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④ 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦ 收取的佣金率。

券商选择程序：① 对符合选择标准的券商的服务进行评价；② 拟定租用对象：由研究部根据

以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本报告期内，本基金撤销 1 个交易单元，为五矿证券有限公司上海交易单元；新增租用 1 个交易单元，为东方证券股份有限公司深圳交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

东方基金管理有限责任公司
2016 年 3 月 26 日