

东方利群混合型发起式证券投资基金 2014 年年度报告 摘要

2014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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年三月二十八日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 20 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 2014 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	东方利群混合
基金主代码	400022
前端交易代码	400022
基金运作方式	契约型开放式发起式
基金合同生效日	2013 年 7 月 17 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
报告期末基金份额总额	414,542,432.23 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	努力把握市场趋势，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	本基金的业绩比较基准为：同期五年期人民币定期存 款基准利率(税后)
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	林葛
	联系电话	010-66295888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816

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	2014 年	2013 年 7 月 17 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	47,622,686.78	2,381,936.92
本期利润	48,346,516.89	1,273,694.89
加权平均基金份额本期利润	0.1090	0.0077
本期基金份额净值增长率	9.28%	0.44%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0976	0.0044
期末基金资产净值	455,022,092.54	76,508,231.59
期末基金份额净值	1.0976	1.0044

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。

④本基金基金合同于 2013 年 7 月 17 日生效，上年度为不完整会计年度。

3.2 基金净值表现

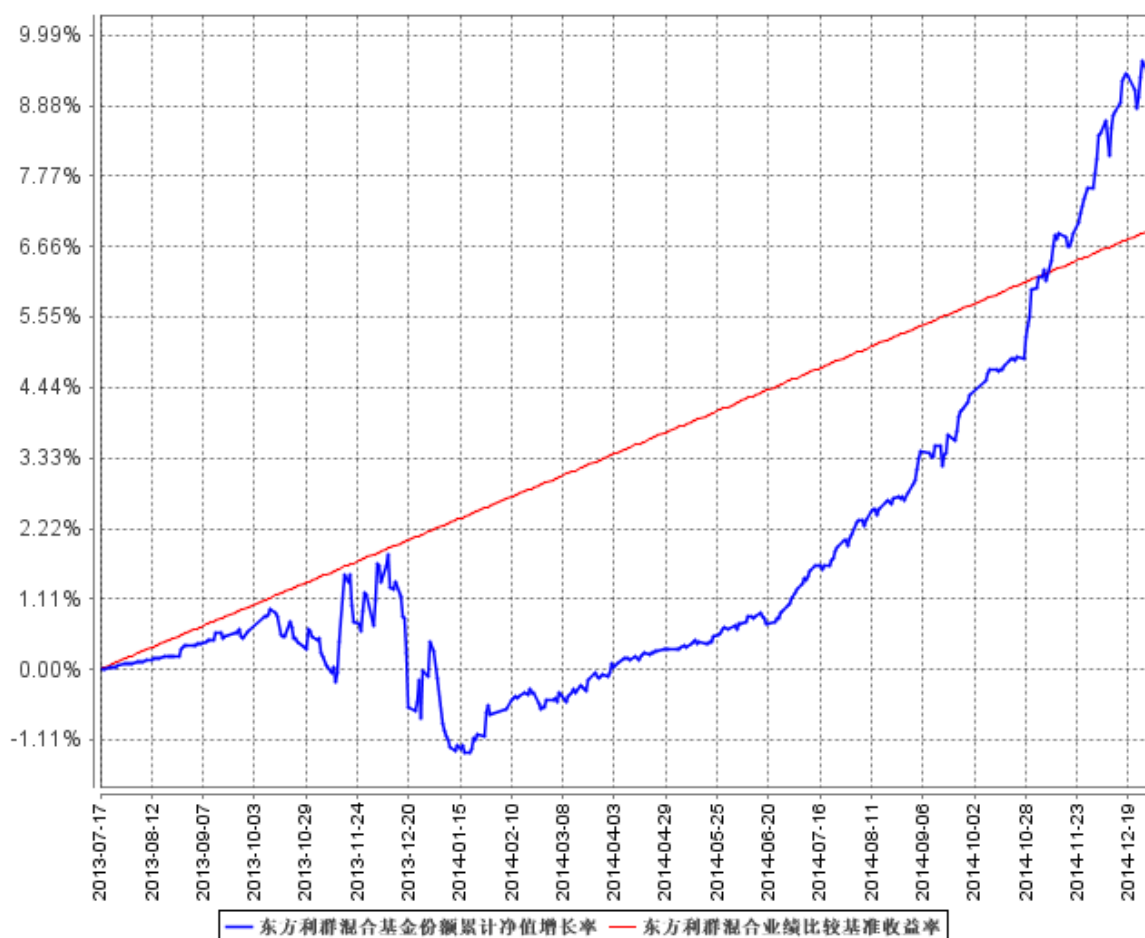
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.22%	0.16%	1.20%	0.00%	4.02%	0.16%

过去六个月	8.65%	0.13%	2.39%	0.00%	6.26%	0.13%
过去一年	9.28%	0.12%	4.75%	0.00%	4.53%	0.12%
自基金合同生效起至今	9.76%	0.17%	6.94%	0.00%	2.82%	0.17%

注：本基金业绩比较基准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，本基金本报告期业绩比较基准采用原中国人民银行公布五年期定期存款基准利率 4.75%。

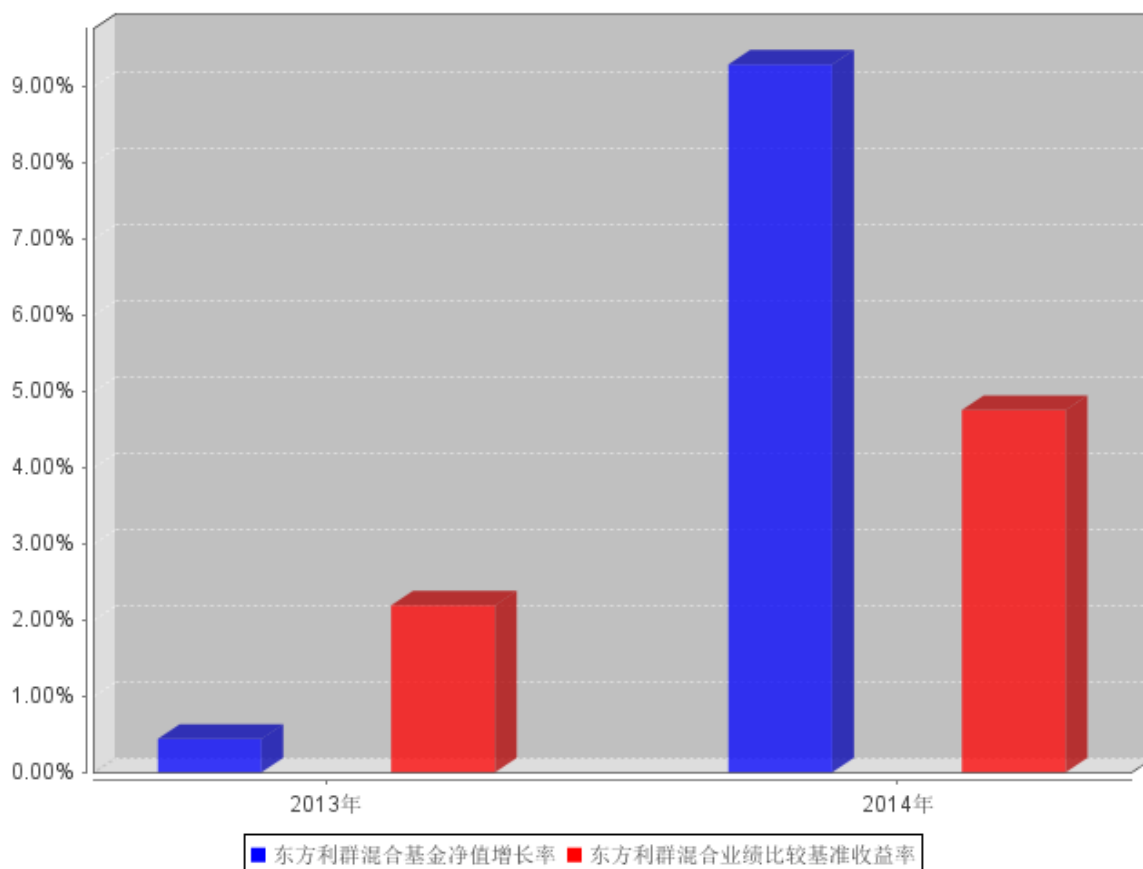
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金基金合同于 2013 年 7 月 17 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。

3.2.3 自基金合同生效以来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

东方利群混合自基金合同生效以来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



注：自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2013年7月17日）至报告期截止日（2014年12月31日）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。东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）经中国证监会批准（证监基金字【2004】80号）于2004年6月11日成立，是《中华人民共和国证券投资基金法》施行后成立的第一家基金管理公司。本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东为东北证券股份有限公司，持有股份64%；河北省国有资产控股运营有限公司，持有股份27%；渤海国际信托有限公司，持有股份9%。截止2014年12月31日，本公司管理十六只开放

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、东方策略成长股票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、东方核心动力股票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、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、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。

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		
于鑫（先生）	本基金基金经理、总经理助理、投资决策委员会委员	2013 年 7 月 17 日	-	13 年	清华大学 IMBA ， CFA ， 13 年证券从业经验。曾任世纪证券有限公司资产管理部投资经理。2005 年加盟东方基金管理有限公司，曾任基金管理部经理、投资副总监、投资总监、投资决策委员会委员、投资决策委员会副主任委员、东方精选证券投资基金基金经理助理、

					<p>东方金账簿货币市场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。现任总经理助理、投资决策委员会委员、东方龙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、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理。</p>
朱晓栋 (先生)	本基金经理	2013年7月 17日	-	5年	<p>对外经济贸易大学经济学硕士,5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</p>

				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。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、东方多策略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合规守信情况的说明

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。

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

在报告期内，本基金以绝对回报为出发点，综合公司的成长性与估值的安全性，逐步买入值得长期持有的优质公司，力争为投资者创造良好的收益。

报告期内，鉴于本基金以绝对收益为主，本基金报告期内基本维持了原有权益仓位；从权益部分的持仓来看，本基金结构出现了一定的变化，在前三季度以蓝筹股配置为主，在蓝筹股上涨的过程中，采取了逐步兑收益的策略，同时增加了部分基本面良好、股价超跌中小市值个股配置。

报告期内，本基金在报告期上涨 9.30%，完成了绝对收益的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年 1 月 1 日至 12 月 31 日，本基金净值增长率为 9.28%，业绩比较基准收益率为 4.75%，高于业绩比较基准 4.53%。

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，虽然信贷持续宽松、中央投资项目加码，但受制于平台整顿与影子银行清理，以及地产开发商对投资的谨慎，经济基本面依然没有明显起色，预计 2015 年经济增速继续保持小幅回落的态势。

但在 A 股市场，资金风险偏好的上升，导致市场流动性依然宽裕，在大类资产配置从地产向股市转移的背景之下，市场有望保持强势格局。展望 2015 年，我们看好受益于市场花改革的行业与个股，尤其是国企改革，将是我们重点关注的投资机会。

本基金将立足于基本面，兼顾业绩成长与估值的合理性，寻找符合本基金绝对回报策略的标的，争取为投资者创造持续稳定的投资回报。

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，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，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本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管业务，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领域的合法合规。(2) 根据中国证监会颁布的相关法律法规, 进一步加强了基金投资监察力度, 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”), 成员由总经理、督察长、投资总监、基金经理和风险管理部、交易部、登记清算部、监察稽核部负责人组成, 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:

总经理、督察长、投资总监: 参与估值小组的日常工作, 负责对基金投资组合中“长期停牌”等没有市价的股票所属行业和重估方法形成最后决议;

基金经理: 参与估值小组的日常工作, 对采纳的估值方法和估值模型等发表意见和建议, 但对估值政策和估值方案不具备最终表决权;

交易部: 负责提议召开估值委员会会议, 并将已形成决议的重估方法所适用的金融产品明细提供风险管理部;

风险管理部: 负责制定估值模型、假设及参数、确定参考行业指数并采集行业指数, 据其计算估值公允价格;

登记清算部: 负责估值事宜的内外部协调, 依据风险管理部提供的公允价格对投资品种进行估值, 计算基金资产净值及基金份额净值, 并按照监管部门要求作好相关信息披露工作;

监察稽核部: 对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督, 发现问题及时要求整改。

除基金经理外, 参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截止本报告期末, 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)。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理有限责任公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东方基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，东方基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、

净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：东方利群混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,105,670.41	5,229,592.40
结算备付金		5,362,242.47	4,368,180.42
存出保证金		117,010.45	12,398.92
交易性金融资产	7.4.7.2	254,639,126.38	21,203,507.52
其中：股票投资		31,968,498.52	21,203,507.52
基金投资		-	-
债券投资		222,670,627.86	-
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	179,000,595.00	46,000,000.00
应收证券清算款		1,472,915.22	1,337,536.11
应收利息	7.4.7.5	7,104,910.85	20,511.94
应收股利		-	-
应收申购款		9,999,000.00	492.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		460,801,470.78	78,172,219.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 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		1,000,000.00	-
应付证券清算款		3,646,953.42	1,335,118.59
应付赎回款		200,758.67	119,887.25
应付管理人报酬		558,684.40	102,419.18
应付托管费		93,114.07	17,069.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	209,469.52	49,041.64
应交税费		-	-
应付利息		17.07	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	70,381.09	40,451.81
负债合计		5,779,378.24	1,663,988.34
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	414,542,432.23	76,170,759.44
未分配利润	7.4.7.10	40,479,660.31	337,472.15
所有者权益合计		455,022,092.54	76,508,231.59
负债和所有者权益总计		460,801,470.78	78,172,219.93

注：①报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0976 元，基金份额总额 414,542,432.23 份。

②本基金基金合同于 2013 年 7 月 17 日生效，上年度为不完整会计年度。

③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：东方利群混合型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 7 月 17 日(基 金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		59,003,097.82	2,831,330.01
1. 利息收入		17,719,381.71	2,591,745.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,086,015.31	1,007,381.69
债券利息收入		13,327,455.83	2,397.28

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,305,910.57	1,581,966.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40,186,728.90	1,004,595.96
其中：股票投资收益	7.4.7.12	34,063,601.07	838,227.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	5,248,622.11	166,368.32
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	874,505.72	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	723,830.11	-1,108,242.03
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	373,157.10	343,230.66
减：二、费用		10,656,580.93	1,557,635.12
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,781,175.95	1,102,677.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,130,195.97	183,779.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	658,571.13	90,169.91
5. 利息支出		1,660,499.15	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,660,499.15	-
6. 其他费用	7.4.7.20	426,138.73	181,007.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,346,516.89	1,273,694.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,346,516.89	1,273,694.89

注：本基金基金合同于 2013 年 7 月 17 日生效，上年度为不完整会计年度。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方利群混合型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	76,170,759.44	337,472.15	76,508,231.59

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	48,346,516.89	48,346,516.89
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）	338,371,672.79	-8,204,328.73	330,167,344.06
其中：1. 基金申购款	645,455,664.02	-734,145.97	644,721,518.05
2. 基金赎回款	-307,083,991.23	-7,470,182.76	-314,554,173.99
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）	414,542,432.23	40,479,660.31	455,022,092.54
项目	上年度可比期间 2013 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2013 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）	342,748,351.30	-	342,748,351.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,273,694.89	1,273,694.89
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）	-266,577,591.86	-936,222.74	-267,513,814.60
其中：1. 基金申购款	7,039,573.20	30,981.87	7,070,555.07
2. 基金赎回款	-273,617,165.06	-967,204.61	-274,584,369.67
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）	76,170,759.44	337,472.15	76,508,231.59

注：本基金基金合同于 2013 年 7 月 17 日生效，上年度为不完整会计年度。

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：

<u>孙晔伟</u>	<u>秦熠群</u>	<u>张蓉梅</u>
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

东方利群混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2013 年 4 月 18 日中国证监会《关于核准东方利群混合型发起式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]360 号）和《关于东方利群混合型发起式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]448 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《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》自 2013 年 6 月 17 日至 2013 年 7 月 12 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 342,669,464.11 元人民币，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）“信会师报字[2013]第 230039 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 342,748,351.30 份基金单位，其中认购资金利息折合 78,887.19 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方利群混合型发起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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。其中，债券主要包括国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券、银行存款等固定收益类品种。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 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《企业会计准则》及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

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》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. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税。自 2013 年 1 月 1 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；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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、代销机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构
渤海国际信托有限公司	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。

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。

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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 7 月 17 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,781,175.95	1,102,677.80
其中：支付销售机构的客户维护费	303,039.65	547,389.67

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计算，具体计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五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、公休假等，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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 7 月 17 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,130,195.97	183,779.65

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
东北证 券股份 有限公 司	10,001,250.00	2.41%	10,001,250.00	13.13%

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。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2013 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
中国农业银行 股份有限公司	3,105,670.41	339,701.36	5,229,592.40	84,633.46

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（2014 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

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的股票。

金额单位：人民币元

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券											
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注	

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 张)	成本总额	额	
110030	格力转债	2014年 12月30 日	2015年 1月13 日	认购新 发	100.00	100.00	19,930	1,993,000.00	1,993,000.00	-

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
002021	中捷资源	2014年 9月5 日	因公 司存 在不 确定 性的 重大 事项	7.01	-	-	50,000	321,748.28	350,500.00	-

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 2014 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 2014 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2015 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本年度报告报出日，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	31,968,498.52	6.94
	其中：股票	31,968,498.52	6.94
2	固定收益投资	222,670,627.86	48.32
	其中：债券	222,670,627.86	48.32
	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	179,000,595.00	38.85
	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	8,467,912.88	1.84
7	其他各项资产	18,693,836.52	4.06
8	合计	460,801,470.78	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,814,171.22	4.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	12,194,117.30	2.68
J	金融业	60,960.00	0.01
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	899,250.00	0.20
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	31,968,498.52	7.03

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	002618	丹邦科技	399,959	10,438,929.90	2.29
2	002315	焦点科技	189,880	10,405,424.00	2.29
3	300274	阳光电源	170,000	2,747,200.00	0.60
4	600612	老凤祥	60,000	1,939,800.00	0.43
5	300182	捷成股份	99,927	1,788,693.30	0.39
6	000848	承德露露	50,000	1,099,500.00	0.24
7	002216	三全食品	50,000	970,500.00	0.21
8	002738	中矿资源	75,000	899,250.00	0.20
9	300411	金盾股份	44,094	812,652.42	0.18
10	300410	正业科技	29,285	455,088.90	0.10

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	002618	丹邦科技	12,622,173.12	16.50
2	002315	焦点科技	12,443,645.02	16.26
3	600000	浦发银行	10,999,000.00	14.38
4	600028	中国石化	10,404,000.00	13.60
5	600485	信威集团	6,121,126.32	8.00
6	601668	中国建筑	5,924,900.00	7.74

7	000002	万 科A	5,796,750.00	7.58
8	601988	中国银行	5,564,000.00	7.27
9	600016	民生银行	5,429,932.00	7.10
10	601628	中国人寿	5,193,010.43	6.79
11	600266	北京城建	4,970,930.36	6.50
12	601318	中国平安	3,730,188.38	4.88
13	002722	金轮股份	3,673,158.76	4.80
14	000540	中天城投	3,339,041.63	4.36
15	600149	廊坊发展	3,296,197.24	4.31
16	300274	阳光电源	3,057,731.05	4.00
17	600240	华业地产	3,049,150.60	3.99
18	600340	华夏幸福	2,790,990.00	3.65
19	000933	神火股份	2,642,000.00	3.45
20	002421	达实智能	2,583,490.00	3.38
21	000568	泸州老窖	2,524,644.00	3.30
22	600519	贵州茅台	2,311,850.00	3.02
23	600612	老凤祥	2,230,404.89	2.92
24	300182	捷成股份	2,119,049.70	2.77
25	600705	中航资本	1,984,600.00	2.59
26	000625	长安汽车	1,931,519.50	2.52
27	601009	南京银行	1,878,483.00	2.46
28	002216	三全食品	1,696,093.70	2.22
29	601888	中国国旅	1,696,048.96	2.22
30	000848	承德露露	1,558,687.36	2.04
31	600376	首开股份	1,547,245.00	2.02

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	600000	浦发银行	11,999,785.16	15.68
2	600028	中国石化	11,224,451.00	14.67
3	000002	万 科A	9,236,589.61	12.07

4	600266	北京城建	8,105,571.96	10.59
5	601668	中国建筑	7,725,099.00	10.10
6	601318	中国平安	7,547,199.25	9.86
7	600485	信威集团	6,292,859.60	8.23
8	601988	中国银行	5,933,000.00	7.75
9	601628	中国人寿	5,696,237.13	7.45
10	600016	民生银行	5,693,926.66	7.44
11	600240	华业地产	5,411,333.89	7.07
12	002722	金轮股份	5,274,830.10	6.89
13	600705	中航资本	4,223,249.00	5.52
14	000540	中天城投	3,853,855.00	5.04
15	000568	泸州老窖	3,150,414.92	4.12
16	600149	廊坊发展	3,142,627.00	4.11
17	002421	达实智能	2,895,419.00	3.78
18	000933	神火股份	2,732,478.69	3.57
19	600519	贵州茅台	2,677,705.84	3.50
20	002618	丹邦科技	2,573,167.55	3.36
21	600340	华夏幸福	2,555,015.21	3.34
22	603011	合锻股份	2,211,527.00	2.89
23	300405	科隆精化	2,194,964.00	2.87
24	600376	首开股份	2,143,445.00	2.80
25	000926	福星股份	2,112,213.67	2.76
26	000625	长安汽车	2,080,139.08	2.72
27	601009	南京银行	1,920,372.00	2.51
28	600009	上海机场	1,840,169.00	2.41
29	000718	苏宁环球	1,767,185.00	2.31
30	300386	飞天诚信	1,719,328.02	2.25
31	601888	中国国旅	1,704,600.00	2.23
32	000024	招商地产	1,681,667.24	2.20
33	601226	华电重工	1,653,211.00	2.16
34	000858	五粮液	1,645,047.46	2.15
35	000402	金融街	1,639,355.00	2.14
36	600893	航空动力	1,532,076.00	2.00

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	201,954,080.60
卖出股票收入（成交）总额	225,029,412.39

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	20,996,200.00	4.61
	其中：政策性金融债	20,996,200.00	4.61
4	企业债券	47,359,164.30	10.41
5	企业短期融资券	120,964,000.00	26.58
6	中期票据	29,877,000.00	6.57
7	可转债	3,474,263.56	0.76
8	其他	-	-
9	合计	222,670,627.86	48.94

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	041452006	14 桂建工 CP001	300,000	30,249,000.00	6.65
2	1282198	12 荣盛 MTN2	300,000	29,877,000.00	6.57
3	041464007	14 宁化工 CP001	200,000	20,182,000.00	4.44
4	041459007	14 国电集 CP001	200,000	20,166,000.00	4.43
5	041458032	14 鄂供销 CP001	200,000	20,158,000.00	4.43

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

根据本基金基金合同规定，本基金不投资贵金属。

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

根据本基金基金合同规定，本基金不投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同规定，本基金不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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	117,010.45
2	应收证券清算款	1,472,915.22
3	应收股利	-
4	应收利息	7,104,910.85

5	应收申购款	9,999,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,693,836.52

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债。

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
465	891,489.10	404,222,491.80	97.51%	10,319,940.43	2.49%

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	69,172.59	0.02%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 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	2.41	10,001,250.00	2.41	自合同生效之日起不少于 3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,250.00	2.41	10,001,250.00	2.41	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 7 月 17 日）基金份额总额	342,748,351.30
本报告期期初基金份额总额	76,170,759.44
本报告期基金总申购份额	645,455,664.02
减：本报告期基金总赎回份额	307,083,991.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	414,542,432.23

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

经本基金管理人第四届董事会第五次临时会议决议，于 2014 年 4 月 4 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，王兴宇先生不再担任公司副总经理，于 5 月 16 日发布

了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，陈振宇先生担任公司副总经理；经本基金管理人第四届董事会第六次临时会议决议，于 6 月 6 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，秦熠群先生担任公司副总经理；经本基金管理人 2014 年第一次临时股东会会议决议，聘任张兴志先生担任公司董事，杨树财先生不再担任公司董事。

本基金管理人已通过证监会指定报刊及本基金管理人网站对上述高级管理人员变更情况履行了信息披露义务，并在本基金及本基金管理人管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述高级管理人员、董事变更情况。

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，公司发生一起涉及基金管理人的诉讼案件，系原公司员工与公司之间的民事诉讼案件，公司为被告。截至报告日，该案件已经北京市西城区人民法院调解完毕。

报告期内，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，公司为被告。截至报告日，上述诉讼仍在审理中。

公司没有其他诉讼和仲裁情况。

本报告期，无涉及基金财产的诉讼事项。

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 70,000.00 元；截至 2014 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 2 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	
宏源证券股份有限公司	2	414,820,957.72	100.00%	372,971.02	100.00%	-
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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资力雄厚，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：由投研部门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）本报告期内本基金新增租用 4 个交易单元，分别为兴业证券股份有限公司上海、深圳交易所交易单元各 1 个，光大证券股份有限公司上海、深圳交易所交易单元各 1 个。

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
宏源证券股份有限公司	759,578,313.09	100.00%	13,881,950,000.00	100.00%	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东方基金管理有限责任公司
2015年3月28日