

东方策略成长股票型开放式证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	东方策略成长股票
基金主代码	400007
前端交易代码	400007
后端交易代码	400008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 3 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,768,104.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司，分享国民经济快速发展带来的成长性收益，追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析宏观经济发展战略，确定基金重点投资的行业，自上而下配置资产，自下而上精选证券。本基金从重点投资的行业中寻找成长性公司，通过成长风险值控制成长风险，以合理的价格投资于优秀公司和/或相对价值低估的其他公司；通过组合投资有效分散风险，谋求基金资产长期稳定的增长。
业绩比较基准	本基金的股票业绩比较基准是中信标普 300 指数；债券业绩比较基准是中信标普全债指数。 本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30% 随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适合本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
风险收益特征	本基金属于成长型股票基金，为证券投资基金中的高风险品种。长期平均的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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田青
	联系电话	010-66295888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	010-67595096
传真		010-66578700	010-66275853

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	2012 年
本期已实现收益	18,516,494.58	3,480,817.48	-597,323.39
本期利润	31,266,264.53	-1,086,474.74	8,152,653.87
加权平均基金份额本期利润	0.6257	-0.0199	0.1264
本期基金份额净值增长率	46.39%	-1.96%	10.07%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.8491	0.3529	0.3799
期末基金资产净值	96,584,637.00	66,196,956.40	86,752,847.75
期末基金份额净值	1.9805	1.3529	1.3799

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。

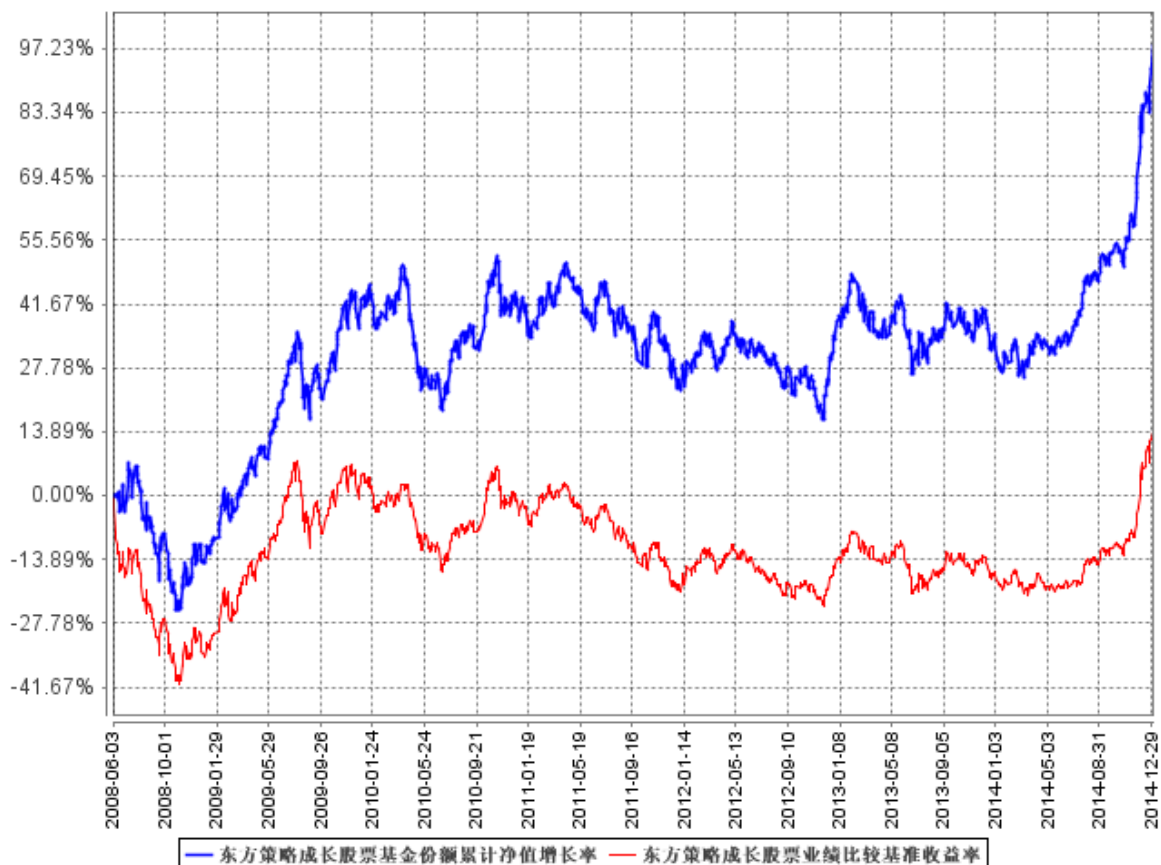
3.2 基金净值表现

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	29.36%	1.14%	28.33%	1.13%	1.03%	0.01%
过去六个月	45.44%	0.90%	40.64%	0.91%	4.80%	-0.01%
过去一年	46.39%	0.88%	36.26%	0.84%	10.13%	0.04%
过去三年	57.97%	0.95%	41.19%	0.89%	16.78%	0.06%
过去五年	38.34%	1.00%	8.64%	0.94%	29.70%	0.06%
自基金合同生效起至今	98.05%	1.17%	13.91%	1.18%	84.14%	-0.01%

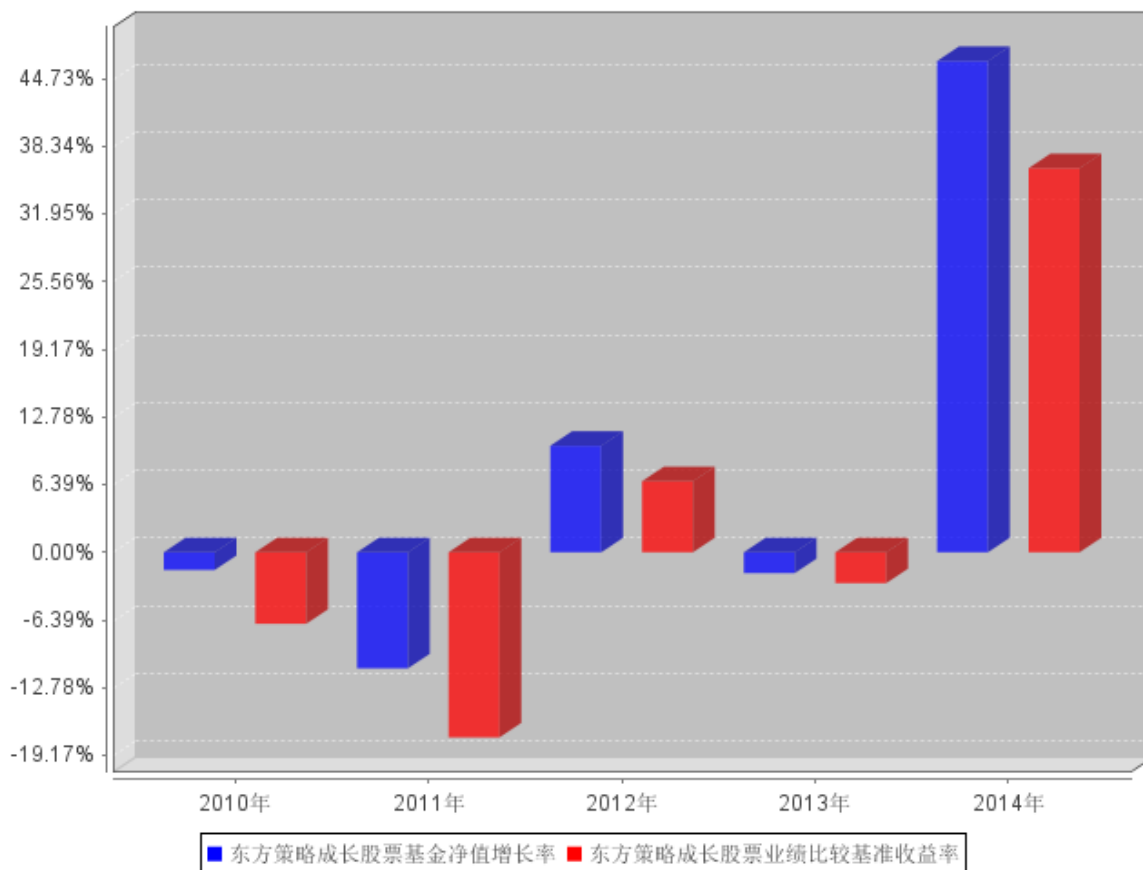
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方策略成长股票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

东方策略成长股票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。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	2008年6月3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

					金基金助理、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。
张 洪 建 (先生)	本基金基金经理	2014年12月25日	-	5年	清华大学物理学博士,5年证券从业经历,曾任银联商务创新业务部专员,平安证券综合研究所 TMT 行业研究

					<p>员。2012年5月加盟东方基金管理有限公司，曾任权益投资部电子、传媒、家用电器、电气设备行业研究员，东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理助理。现任东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理。</p>
王然（女士）	本基金基金经理助理	2014年4月17日	-	6年	<p>北京交通大学产业经济学硕士，6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公司，曾任权益投资部交通运</p>

					输、纺织服装、商业零售行业研究员，现任东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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、《东方策略成长股票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

2014 年，本基金继续投资于估值低、业绩优良、成长确定的绩优公司，以少量仓位进行波段操作。

报告期内，本基金继续持有保险、地产、食品饮料等行业的龙头公司。年底，随着蓝筹股的大幅度上涨，本基金适当调整了持仓结构，减持了银行、保险等行业的股票，增持了地产股，对部分中小市值股票进行了波段操作。

总的看，本基金的重仓品种在年底的行情中表现不俗，对基金净值贡献巨大。

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 46.39%，业绩比较基准收益率为 36.26%，高于业绩比较基准 10.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2015 年的中国经济，我们并不悲观。总的看，中国经济可能会触底回升，上半年会差一些，下半年同比数据会逐渐好起来。上市公司的利润增长可能是个位数。

就证券市场而言，2014 年年底的行情有所透支，我们认为 2015 年难以重复 2014 年的涨幅。蓝筹股由于估值低，盈利增速相对确定，仍是较好的投资品种。如果实行市场化发行新股，小盘股泡沫在 2015 年可能会被刺破，特别是所谓壳资源的垃圾股，下跌空间巨大。

从行业层面上，我们看好保险、房地产、汽车、食品饮料、家电等行业，对于医药、环保、零售等行业，我们也将保持关注。

转眼间，管理东方策略成长基金已经超过 6 年多了。这段时间里，有成功的喜悦，也有失败的懊恼，但坚持价值投资的理念从未改变。虽然期间市场涨幅不大，但东方策略成长的净值还是震荡向上，其收益率远好于同期市场的表现，也远好于银行理财、债券等替代金融产品的收益率。总算没有辜负基金持有人的信任。深深感谢基金持有人的支持。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：东方策略成长股票型开放式证券投资基金

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	6,272,468.36	135,441.43
结算备付金		1,891,635.77	618,877.48
存出保证金		44,890.25	15,883.98
交易性金融资产	7.4.7.2	65,446,046.07	56,321,201.20
其中：股票投资		61,440,446.07	52,155,055.00
基金投资		-	-
债券投资		4,005,600.00	4,166,146.20
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	25,000,000.00	7,500,000.00
应收证券清算款		-	1,901,077.30
应收利息	7.4.7.5	65,757.11	49,933.71
应收股利		-	-
应收申购款		679,886.86	20,593.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		99,400,684.42	66,563,008.87
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		-	-
应付证券清算款		1,988,400.97	-
应付赎回款		376,579.51	82,535.25
应付管理人报酬		113,561.99	84,985.20
应付托管费		18,927.00	14,164.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	249,516.37	106,206.18
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	69,061.58	78,161.66
负债合计		2,816,047.42	366,052.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	48,768,104.03	48,928,635.41

未分配利润	7.4.7.10	47,816,532.97	17,268,320.99
所有者权益合计		96,584,637.00	66,196,956.40
负债和所有者权益总计		99,400,684.42	66,563,008.87

注：①报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9805 元，基金份额总额 48,768,104.03 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：东方策略成长股票型开放式证券投资基金

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 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		33,728,289.95	900,276.70
1. 利息收入	7.4.7.11	775,519.86	543,183.28
其中：存款利息收入		48,443.94	81,677.23
债券利息收入		366,628.24	135,227.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		360,447.68	326,278.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,142,193.51	4,901,985.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,581,750.00	3,841,407.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	484,889.45	12,286.81
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	1,075,554.06	1,048,290.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	12,749,769.95	-4,567,292.22
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	60,806.63	22,400.24
减：二、费用		2,462,025.42	1,986,751.44
1. 管理人报酬	7.4.7.21	1,084,414.31	1,127,723.60
2. 托管费	7.4.7.22	180,735.72	187,953.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	937,048.07	374,283.57

5. 利息支出		9,176.10	-
其中：卖出回购金融资产支出		9,176.10	-
6. 其他费用	7.4.7.20	250,651.22	296,790.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,266,264.53	-1,086,474.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,266,264.53	-1,086,474.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方策略成长股票型开放式证券投资基金

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）	48,928,635.41	17,268,320.99	66,196,956.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	31,266,264.53	31,266,264.53
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）	-160,531.38	-718,052.55	-878,583.93
其中：1. 基金申购款	44,052,516.89	23,174,882.87	67,227,399.76
2. 基金赎回款	-44,213,048.27	-23,892,935.42	-68,105,983.69
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）	48,768,104.03	47,816,532.97	96,584,637.00
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 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）	62,868,991.52	23,883,856.23	86,752,847.75

监会批准允许基金投资的其它金融工具。

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编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》、《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》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
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
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构
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

金额单位：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1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东北证券股份 有限公司	-	-	72,415,792.08	30.13%

债券交易

金额单位：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1月1日至2013年12月31日	
	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 成交总额的比 例
东北证券股份 有限公司	-	-	354,000.00	11.22%

债券回购交易

金额单位：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1月1日至2013年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
东北证券股份 有限公司	-	-	71,700,000.00	10.66%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券股份 有限公司	65,245.58	29.95%	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,084,414.31	1,127,723.60
其中：支付销售机构的客 户维护费	167,250.46	186,069.66

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 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
当期发生的基金应支付	180,735.72	187,953.93

的托管费		
------	--	--

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 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2008 年 6 月 3 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,001,722.50	9,001,722.50
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	9,001,722.50	9,001,722.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.460%	18.400%

注：基金管理人投资本基金时，本基金按照基金合同、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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 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
中国建设银行股份有限公司	6,272,468.36	31,573.16	135,441.43	75,900.57

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

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
600240	华业地产	2014 年 10 月 16 日	重大资产重组	7.19	2015 年 1 月 22 日	7.91	130,000	630,512.30	934,700.00	-
002068	黑猫股份	2014 年 12 月 30 日	配股临时停牌	8.71	2015 年 1 月 9 日	7.96	80,000	633,054.71	696,800.00	-
002072	凯瑞德	2014 年 12 月 31 日	临时停牌	13.38	2015 年 2 月 10 日	14.72	30,000	502,492.00	401,400.00	-
601519	大智慧	2014 年 7 月 21 日	重大资产重组	5.98	2015 年 1 月 23 日	6.58	10,000	71,580.00	59,800.00	-

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, 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	61,440,446.07	61.81
	其中: 股票	61,440,446.07	61.81
2	固定收益投资	4,005,600.00	4.03
	其中: 债券	4,005,600.00	4.03
	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	25,000,000.00	25.15
	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	8,164,104.13	8.21
7	其他各项资产	790,534.22	0.80
8	合计	99,400,684.42	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	336,791.25	0.35
C	制造业	17,769,598.31	18.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,449,364.94	2.54
E	建筑业	1,819,250.00	1.88
F	批发和零售业	892,500.00	0.92

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	1,166,300.00	1.21
J	金融业	8,162,870.00	8.45
K	房地产业	23,554,021.57	24.39
L	租赁和商务服务业	961,600.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	398,750.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	3,300,000.00	3.42
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	629,400.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	61,440,446.07	63.61

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	600048	保利地产	700,000	7,574,000.00	7.84
2	601318	中国平安	75,000	5,603,250.00	5.80
3	000002	万科A	250,000	3,475,000.00	3.60
4	000069	华侨城A	400,000	3,300,000.00	3.42
5	000024	招商地产	120,000	3,166,800.00	3.28
6	600376	首开股份	280,000	2,822,400.00	2.92
7	000848	承德露露	120,000	2,638,800.00	2.73
8	600036	招商银行	150,000	2,488,500.00	2.58
9	600683	京投银泰	300,000	2,277,000.00	2.36
10	600742	一汽富维	55,000	1,542,750.00	1.60

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	600048	保利地产	11,108,081.89	16.78
2	601668	中国建筑	9,903,000.00	14.96
3	000002	万科A	8,146,341.61	12.31
4	601318	中国平安	6,641,507.00	10.03
5	600000	浦发银行	5,435,672.76	8.21
6	000024	招商地产	5,418,200.94	8.18
7	000858	五粮液	5,279,533.49	7.98
8	600036	招商银行	4,871,423.58	7.36
9	601166	兴业银行	4,417,841.00	6.67
10	600028	中国石化	4,111,400.00	6.21
11	600315	上海家化	4,004,407.28	6.05
12	000568	泸州老窖	3,942,564.18	5.96
13	000848	承德露露	3,776,061.61	5.70
14	000718	苏宁环球	3,697,711.33	5.59
15	600809	山西汾酒	3,636,942.00	5.49
16	000069	华侨城A	3,534,479.00	5.34
17	000402	金融街	3,527,526.00	5.33
18	601628	中国人寿	3,453,376.53	5.22
19	600066	宇通客车	3,370,735.98	5.09
20	600535	天士力	3,303,441.02	4.99
21	000423	东阿阿胶	3,288,315.05	4.97
22	000001	平安银行	3,175,416.41	4.80
23	002241	歌尔声学	3,097,266.87	4.68
24	600016	民生银行	3,025,582.20	4.57
25	002146	荣盛发展	3,006,892.83	4.54
26	600887	伊利股份	2,881,681.22	4.35
27	600008	首创股份	2,828,618.00	4.27
28	600050	中国联通	2,763,600.00	4.17
29	600519	贵州茅台	2,745,335.95	4.15
30	000538	云南白药	2,526,922.88	3.82

31	600030	中信证券	2,512,938.00	3.80
32	600683	京投银泰	2,453,050.04	3.71
33	600376	首开股份	2,430,734.42	3.67
34	600995	文山电力	2,228,640.85	3.37
35	600266	北京城建	2,031,657.30	3.07
36	000581	威孚高科	2,025,766.99	3.06
37	300070	碧水源	1,985,726.60	3.00
38	000797	中国武夷	1,927,029.00	2.91
39	002658	雪迪龙	1,909,408.38	2.88
40	601336	新华保险	1,883,896.70	2.85
41	600533	栖霞建设	1,777,625.00	2.69
42	600741	华域汽车	1,696,730.14	2.56
43	002672	东江环保	1,616,263.00	2.44
44	002216	三全食品	1,600,440.51	2.42
45	002310	东方园林	1,593,962.85	2.41
46	300055	万邦达	1,544,778.00	2.33
47	601258	庞大集团	1,518,888.00	2.29
48	002398	建研集团	1,496,142.00	2.26
49	000651	格力电器	1,478,097.00	2.23
50	601009	南京银行	1,446,571.00	2.19
51	002707	众信旅游	1,419,380.00	2.14
52	600703	三安光电	1,370,897.00	2.07
53	000620	新华联	1,354,421.00	2.05
54	600240	华业地产	1,344,900.00	2.03
55	002304	洋河股份	1,340,091.06	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	601668	中国建筑	11,883,915.49	17.95
2	000002	万科A	10,967,347.71	16.57
3	601318	中国平安	10,240,886.16	15.47

4	600048	保利地产	8,375,371.65	12.65
5	600036	招商银行	6,259,492.52	9.46
6	600000	浦发银行	6,057,841.20	9.15
7	600016	民生银行	5,445,506.84	8.23
8	000024	招商地产	5,252,596.82	7.93
9	000858	五粮液	4,628,084.84	6.99
10	600519	贵州茅台	4,616,489.59	6.97
11	601166	兴业银行	4,576,650.00	6.91
12	600028	中国石化	4,428,776.62	6.69
13	600266	北京城建	4,372,717.95	6.61
14	601628	中国人寿	4,340,362.06	6.56
15	000402	金融街	4,107,759.65	6.21
16	000001	平安银行	4,098,362.24	6.19
17	000718	苏宁环球	3,992,327.27	6.03
18	600887	伊利股份	3,869,453.49	5.85
19	000423	东阿阿胶	3,762,275.81	5.68
20	600535	天士力	3,344,848.11	5.05
21	000568	泸州老窖	3,306,736.06	5.00
22	600809	山西汾酒	3,202,329.10	4.84
23	600383	金地集团	3,193,745.82	4.82
24	600066	宇通客车	3,171,011.81	4.79
25	600030	中信证券	2,983,719.35	4.51
26	600240	华业地产	2,949,911.38	4.46
27	002146	荣盛发展	2,875,859.40	4.34
28	600050	中国联通	2,851,800.00	4.31
29	600008	首创股份	2,833,491.41	4.28
30	600315	上海家化	2,605,252.07	3.94
31	601336	新华保险	2,581,677.24	3.90
32	000918	嘉凯城	2,473,521.09	3.74
33	000926	福星股份	2,416,971.64	3.65
34	002241	歌尔声学	2,343,193.17	3.54
35	000069	华侨城A	2,271,127.59	3.43
36	000620	新华联	2,202,567.45	3.33
37	300070	碧水源	2,187,488.00	3.30
38	000581	威孚高科	2,029,183.03	3.07
39	000538	云南白药	2,003,832.63	3.03
40	600694	大商股份	1,921,114.27	2.90
41	002658	雪迪龙	1,857,259.63	2.81

42	002672	东江环保	1,823,166.70	2.75
43	601009	南京银行	1,809,579.60	2.73
44	600697	欧亚集团	1,765,150.62	2.67
45	300055	万邦达	1,676,327.00	2.53
46	601169	北京银行	1,581,474.54	2.39
47	600009	上海机场	1,581,280.95	2.39
48	002310	东方园林	1,551,938.88	2.34
49	600741	华域汽车	1,513,424.11	2.29
50	000651	格力电器	1,468,470.34	2.22
51	600104	上汽集团	1,453,874.66	2.20
52	002142	宁波银行	1,398,020.00	2.11
53	002304	洋河股份	1,389,110.68	2.10
54	000939	凯迪电力	1,363,021.63	2.06
55	000598	兴蓉投资	1,362,100.00	2.06
56	000596	古井贡酒	1,348,970.84	2.04
57	600703	三安光电	1,325,073.66	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“卖出金额”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	291,422,039.07
卖出股票收入（成交）总额	313,495,538.15

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	4,005,600.00	4.15
	其中：政策性金融债	4,005,600.00	4.15

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,005,600.00	4.15

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	140443	14 农发 43	40,000	4,005,600.00	4.15
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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	44,890.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,757.11
5	应收申购款	679,886.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	790,534.22

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
4,968	9,816.45	16,348,013.46	33.52%	32,420,090.57	66.48%

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	77,851.30	0.160%

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	0~10
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 (2008 年 6 月 3 日) 基金份额总额	329,346,406.20
本报告期期初基金份额总额	48,928,635.41
本报告期基金总申购份额	44,052,516.89
减:本报告期基金总赎回份额	44,213,048.27
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	48,768,104.03

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。

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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 7 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	
中信建投证券有限责任公司	1	311,543,640.16	51.56%	283,629.25	51.56%	-
国海证券股份有限公司	1	292,675,136.91	48.44%	266,452.13	48.44%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	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 实力雄厚，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，本基金交易席位未发生变更。

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
中信建投证券有限责任公司	8,746,311.30	98.70%	1,981,400,000.00	100.00%	-	-
国海证券股份有限公司	115,008.00	1.30%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东方基金管理有限责任公司
2015年3月28日