

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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.....	39
7.9 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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 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.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
§11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金
基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	400015
前端交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 28 日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,652,077.07 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资管理，精选受益于经济转型下产业结构调整方向的、具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票；努力把握市场趋势，积极进行适当范围内的大类资产配置调整，在严格控制风险的前提下，谋求本基金资产的长期资本增值。
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	本基金采用“中证 700 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%”作为投资业绩比较基准。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数或债券指数时，本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金为混合型基金，股票部分主要投资于具有高成长潜力的中小市值上市公司股票，属于证券投资基金中预期风险和预期收益为中高风险等级的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于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	中国邮政储蓄银行股份有限公

	司	司	
信息披露负责人	姓名	李景岩	步艳红
	联系电话	010-66295888	010-68858112
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	buyanhong@psbc.com
客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	95580	
传真	010-66578700	010-68858120	
注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 3 号	
办公地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座	
邮政编码	100033	100808	
法定代表人	崔伟	李国华	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半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
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	41,786,692.34
本期利润	58,664,475.91
加权平均基金份额本期利润	1.1181
本期加权平均净值利润率	47.17%
本期基金份额净值增长率	70.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	61,295,783.31
期末可供分配基金份额利润	1.3427
期末基金资产净值	131,084,338.78

期末基金份额净值	2.8714
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	187.14%

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

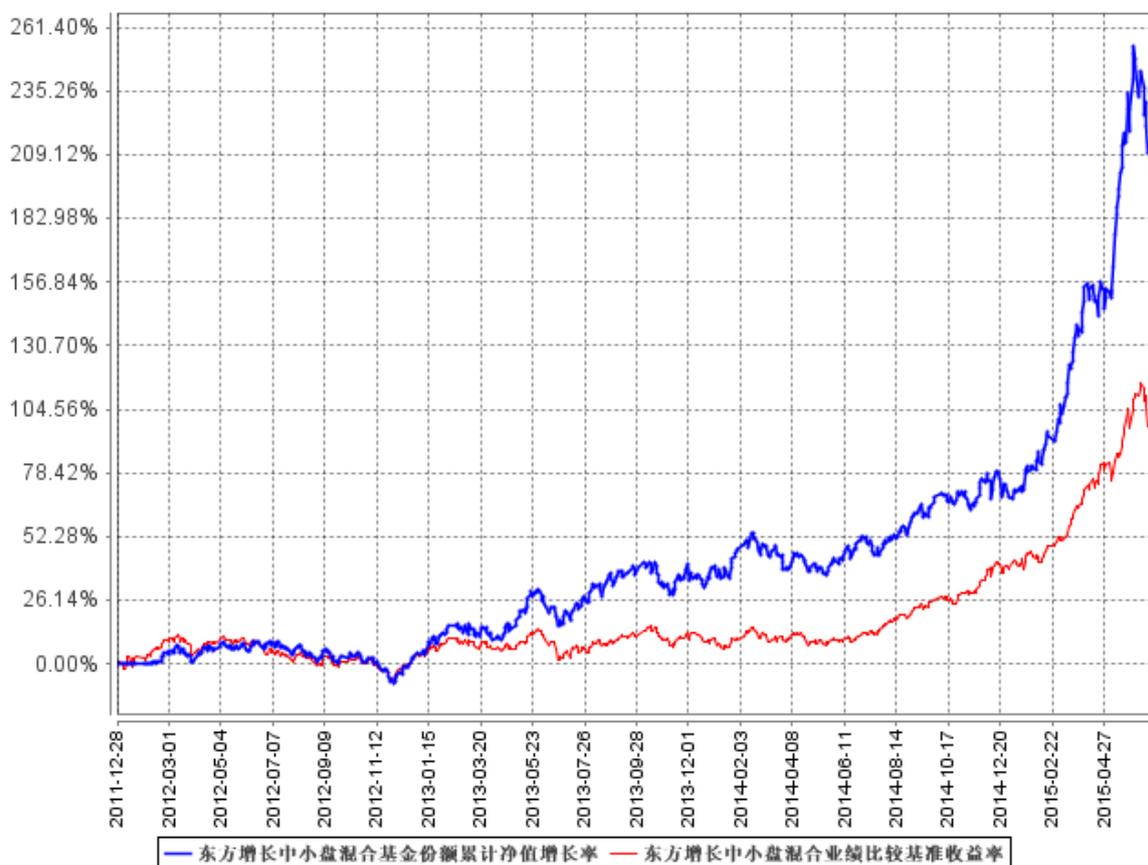
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-12.43%	2.74%	-5.62%	2.28%	-6.81%	0.46%
过去三个月	20.51%	2.39%	12.48%	1.73%	8.03%	0.66%
过去六个月	70.00%	1.95%	33.47%	1.38%	36.53%	0.57%
过去一年	90.42%	1.57%	67.18%	1.08%	23.24%	0.49%
过去三年	165.62%	1.30%	76.60%	0.92%	89.02%	0.38%
自基金合同生效起至今	187.14%	1.24%	86.55%	0.92%	100.59%	0.32%

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

东方增长中小盘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



§ 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%。截至2015年6月30日，本公司管理24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、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。

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、投资决策委员会委员	2011年12月28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 、 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 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 。
薛子徽 (先生)	本基金基 金经理	2015 年 4 月 30 日	-	8 年	山西大学 工 商 管 理、应用

				<p>心理学专业学士，8 年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员，投资经理。现任东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混</p>
--	--	--	--	---

					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、《东方增长中小盘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。

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。

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场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 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

报告期内市场经历了杠杆资金加速入场带来的快速上涨以及邻近二季度季末监管层清理配资导致的市场整体大幅回调，A 股市场表现为冲高后的巨幅回落，上半年创业板指、中小板指、上证综指分别上涨 94.23%、69.06%、32.23%。

报告期内，本基金权益仓位进行了较大幅度下降，较好地回避了六月以来的大幅下跌，也为未来市场企稳后能够以较好的价格购买优秀的公司储备充足的子弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金净值增长率为 70.00%，业绩比较基准收益率为 33.47%，高于业绩比较基准 36.53%。

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 年三季度，随着货币政策的持续宽松、地产政策的逐步调整、以及投资项目的加码，宏观经济在 9-10 月期间全触底回升的概率较大，从而为市场的进一步上涨提供良好的宏观环境。同时，在企业盈利质量回升、资金风险评估下降，以及大类资产配置导致的流动性宽裕等多重因素叠加之下，市场有望保持强势格局，二季度末市场的深度调整，是本轮牛市较好的入场时机。

从行业层面上，企稳预期带来的低估值蓝筹股机会，特别是金融地产类行业低估值、高分红的特点将重新成为市场关注点。而作为国家改革战略重要一环的国企改革板块由于其较高的估值天花板特征也将成为另一重点关注板块。

本基金还将择机参与新股的网下申购，把握好可能的投资机会，力争为投资者实现正收益。

4.6 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）。

注：截至 2015 年 6 月 30 日，交易部与登记清算部合并为运营部。

4.7 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 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 人或基金资产净值低于 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

基金托管人依据《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》与《东方增长中小

盘混合型开放式证券投资基金托管协议》，自 2011 年 12 月 28 日起托管东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,562,149.28	3,329,673.00
结算备付金		39,639.99	208,850.85
存出保证金		114,505.27	109,226.66
交易性金融资产	6.4.7.2	124,349,475.68	98,675,818.18
其中：股票投资		90,400,965.68	71,683,268.18
基金投资		-	-
债券投资		33,948,510.00	26,992,550.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	824,719.10	840,062.57
应收股利		-	-

应收申购款		286,154.73	153,019.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		135,176,644.05	103,316,650.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,556,338.45	677,363.58
应付管理人报酬		181,295.50	141,770.57
应付托管费		30,215.92	23,628.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	249,805.34	219,473.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	74,650.06	77,085.89
负债合计		4,092,305.27	1,139,321.80
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	45,652,077.07	60,491,582.57
未分配利润	6.4.7.10	85,432,261.71	41,685,746.07
所有者权益合计		131,084,338.78	102,177,328.64
负债和所有者权益总计		135,176,644.05	103,316,650.44

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.8714 元，基金份额总额 45,652,077.07 份。

6.2 利润表

会计主体：东方增长中小盘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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		60,112,673.38	8,034,046.18
1.利息收入		832,990.67	424,808.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,995.96	27,667.94
债券利息收入		801,994.71	395,323.42

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,817.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,287,086.01	2,757,280.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	41,988,925.18	2,341,831.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	127,092.73	73,815.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	171,068.10	341,633.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,877,783.57	4,813,380.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	114,813.13	38,577.43
减：二、费用		1,448,197.47	1,115,072.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	921,393.53	708,556.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	153,565.54	118,092.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	304,914.56	164,566.37
5. 利息支出		533.46	1,317.99
其中：卖出回购金融资产支出		533.46	1,317.99
6. 其他费用	6.4.7.20	67,790.38	122,538.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		58,664,475.91	6,918,973.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		58,664,475.91	6,918,973.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方增长中小盘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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	60,491,582.57	41,685,746.07	102,177,328.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	58,664,475.91	58,664,475.91

期利润)			
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)	-14,839,505.50	-14,917,960.27	-29,757,465.77
其中：1.基金申购款	40,542,800.73	59,875,770.63	100,418,571.36
2.基金赎回款	-55,382,306.23	-74,793,730.90	-130,176,037.13
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)	45,652,077.07	85,432,261.71	131,084,338.78
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	53,171,623.96	21,188,548.75	74,360,172.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,918,973.83	6,918,973.83
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)	26,577,191.19	12,396,955.10	38,974,146.29
其中：1.基金申购款	48,735,175.79	22,593,004.26	71,328,180.05
2.基金赎回款	-22,157,984.60	-10,196,049.16	-32,354,033.76
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)	79,748,815.15	40,504,477.68	120,253,292.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

孙晔伟

基金管理人负责人

秦熠群

主管会计工作负责人

张蓉梅

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2011 年 10 月 20 日中国证监会《关于核准东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1687 号）和《关于东方增长中小盘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[2011]860 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《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》自 2011 年 11 月 21 日至 2011 年 12 月 23 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 335,816,080.11 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（2011）第 82483 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 335,865,199.76 份基金单位，其中认购资金利息折合 49,119.65 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于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的相关规定）。其中，股票主要包括基本面良好、具有较高成长性的中小盘股票；债券主要包括具有相对投资价值的国债、央行票据、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、短期融资券与可转换债券等固定收益品种。

6.4.2 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 3 号—半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。

6.4.3 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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”），经与会计师事务所协商一致，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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	9,562,149.28
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,562,149.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,655,937.41	90,400,965.68	29,745,028.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,904,300.00	311,435.79
	银行间市场	17,903,166.68	141,043.32

	合计	33,496,030.89	33,948,510.00	452,479.11
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	94,151,968.30	124,349,475.68	30,197,507.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,508.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	16.19
应收债券利息	823,147.17
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.22
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	46.35
合计	824,719.10

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	249,805.34

银行间市场应付交易费用	-
合计	249,805.34

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,313.56
预提费用	58,590.38
其他应付款	5,746.12
合计	74,650.06

注：①预提费用包括按日计提的审计费、信息披露费和银行间债券账户维护费。

②其他应付款为上海、深圳证券交易所返还的证管费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,491,582.57	60,491,582.57
本期申购	40,542,800.73	40,542,800.73
本期赎回(以“-”号填列)	-55,382,306.23	-55,382,306.23
本期末	45,652,077.07	45,652,077.07

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,165,925.31	11,519,820.76	41,685,746.07
本期利润	41,786,692.34	16,877,783.57	58,664,475.91
本期基金份额交易产生的变动数	-10,656,834.34	-4,261,125.93	-14,917,960.27
其中：基金申购款	34,608,407.22	25,267,363.41	59,875,770.63
基金赎回款	-45,265,241.56	-29,528,489.34	-74,793,730.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,295,783.31	24,136,478.40	85,432,261.71

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,497.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	980.27
其他	2,517.89
合计	30,995.96

注：其他包括基金直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	114,818,556.53
减：卖出股票成本总额	72,829,631.35
买卖股票差价收入	41,988,925.18

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,997,096.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,226,009.07
减：应收利息总额	643,994.51
买卖债券差价收入	127,092.73

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

根据本基金基金合同规定，本基金不投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	171,068.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	171,068.10

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	16,877,783.57
——股票投资	16,598,767.56
——债券投资	279,016.01
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	16,877,783.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	108,747.32
基金转换费收入	6,065.81
合计	114,813.13

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	304,747.06
银行间市场交易费用	167.50
合计	304,914.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	24,795.19
其他	200.00
债券账户维护费	18,000.00
合计	67,790.38

注：其他为上交所 CFCA 证书费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008]38 号）的规定，经与基金托管人——中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，本公司自 2015 年 7 月 7 日起，对基金持有的停牌股票潜在调整对前一估值日的基金资产净值影响在 0.25%以上的采用“指数收益法”进行估值，并且本公司将综合参考各项相关影响因素并与基金托管人协商，待该股票交易体现了活跃市场交易特征后，恢复采用当日收盘价格进行估值。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	921,393.53	708,556.80
其中：支付销售机构的客户维护费	136,596.65	160,547.27

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 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6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	153,565.54		118,092.84	

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：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.3 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，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	9,562,149.28	27,497.80	7,610,702.94	24,451.19

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

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，本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
300012	华测检测	2015 年 6 月 15 日	筹划重大事项	43.07	2015 年 7 月 27 日	38.76	259,900	5,186,616.96	11,193,893.00	-
300203	聚光科技	2015 年 4 月 20 日	筹划重大事项	37.68	2015 年 7 月 8 日	37.64	165,700	6,348,468.85	6,243,576.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	13,026,710.00	16,041,550.00
A-1 以下	-	-
未评级	5,017,500.00	-
合计	18,044,210.00	16,041,550.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	9,837,000.00	-
AAA 以下	6,067,300.00	5,940,000.00
未评级	-	-
合计	15,904,300.00	5,940,000.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金

投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,562,149.28	-	-	-	9,562,149.28
结算备付金	39,639.99	-	-	-	39,639.99
存出保证金	114,505.27	-	-	-	114,505.27
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	90,400,965.68	90,400,965.68
交易性金融资产-债券投资	20,550,960.00	13,397,550.00	0.00	-	33,948,510.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	824,719.10	824,719.10
应收股利	-	-	-	-	0.00
应收申购款	286,154.73	-	-	-	286,154.73
资产总计	30,553,409.27	13,397,550.00	0.00	91,225,684.78	135,176,644.05
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	3,556,338.45	3,556,338.45
应付管理人报酬	-	-	-	181,295.50	181,295.50
应付托管费	-	-	-	30,215.92	30,215.92
应付交易费用	-	-	-	249,805.34	249,805.34
应付利息	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	74,650.06	74,650.06
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	4,092,305.27	4,092,305.27
利率敏感度缺口	30,553,409.27	13,397,550.00	0.00	87,133,379.51	131,084,338.78
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,329,673.00	-	-	-	3,329,673.00
结算备付金	208,850.85	-	-	-	208,850.85
存出保证金	109,226.66	-	-	-	109,226.66
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	71,683,268.18	71,683,268.18
交易性金融资产-债券投资	21,052,550.00	5,940,000.00	-	-	26,992,550.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	840,062.57	840,062.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	153,019.18	-	-	-	153,019.18
资产总计	24,853,319.69	5,940,000.00	-	72,523,330.75	103,316,650.44
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	677,363.58	677,363.58
应付管理人报酬	-	-	-	141,770.57	141,770.57
应付托管费	-	-	-	23,628.44	23,628.44
应付交易费用	-	-	-	219,473.32	219,473.32
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	77,085.89	77,085.89
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	1,139,321.80	1,139,321.80
利率敏感度缺口	24,853,319.69	5,940,000.00	-	71,384,008.95	102,177,328.64

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下调0.25%	95,928.56	78,760.17
	市场利率上调0.25%	-95,448.92	-309,878.49

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并

且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	90,400,965.68	68.96	71,683,268.18	70.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	33,948,510.00	25.90	26,992,550.00	26.42
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	124,349,475.68	94.86	98,675,818.18	96.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的Beta系数计算基金资产变动		
	Beta系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-4,181,124.49	-1,388,320.50
	沪深 300 指数上涨 5%	4,181,124.49	1,388,320.50

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 4,237,681.00 元，占基金资产净值比例为 3.23%；上年度末本基金风险价值为 1,727,994.00 元，占基金资产净值比例为 1.69%。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日，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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	90,400,965.68	66.88
	其中：股票	90,400,965.68	66.88
2	固定收益投资	33,948,510.00	25.11
	其中：债券	33,948,510.00	25.11
	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	9,601,789.27	7.10
7	其他各项资产	1,225,379.10	0.91
8	合计	135,176,644.05	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,465,000.00	1.12
C	制造业	32,957,380.14	25.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	235,260.00	0.18
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	20,575,368.50	15.70

J	金融业	240,380.00	0.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,565.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	11,214,183.00	8.55
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	9,673,290.04	7.38
R	文化、体育和娱乐业	14,017,539.00	10.69
S	综合	-	-
	合计	90,400,965.68	68.96

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300012	华测检测	259,900	11,193,893.00	8.54
2	300015	爱尔眼科	299,854	9,673,290.04	7.38
3	000681	视觉中国	189,600	7,784,976.00	5.94
4	300252	金信诺	175,000	6,942,250.00	5.30
5	300203	聚光科技	165,700	6,243,576.00	4.76
6	300429	强力新材	50,000	6,100,500.00	4.65
7	600184	光电股份	199,982	5,631,493.12	4.30
8	600570	恒生电子	50,000	5,602,500.00	4.27
9	600699	均胜电子	120,000	4,597,200.00	3.51
10	300170	汉得信息	182,650	4,436,568.50	3.38
11	002421	达实智能	220,000	4,406,600.00	3.36
12	000156	华数传媒	120,000	4,293,600.00	3.28
13	002410	广联达	142,500	3,334,500.00	2.54
14	002230	科大讯飞	80,000	2,795,200.00	2.13
15	600166	福田汽车	300,000	2,649,000.00	2.02
16	300251	光线传媒	77,870	1,938,963.00	1.48
17	000939	凯迪电力	100,000	1,465,000.00	1.12
18	300024	机器人	10,000	772,600.00	0.59
19	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.18
20	601985	中国核电	18,000	235,260.00	0.18

21	002769	普路通	500	22,565.00	0.02
22	002776	柏堡龙	500	20,290.00	0.02
23	002761	多喜爱	500	14,810.00	0.01
24	002770	科迪乳业	500	4,930.00	0.00
25	002121	科陆电子	34	1,021.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600699	均胜电子	7,574,054.00	7.41
2	300203	聚光科技	7,297,908.85	7.14
3	000156	华数传媒	6,626,826.00	6.49
4	300429	强力新材	5,668,990.00	5.55
5	300251	光线传媒	4,935,839.97	4.83
6	002230	科大讯飞	4,434,365.12	4.34
7	300182	捷成股份	4,257,904.68	4.17
8	000939	凯迪电力	4,131,380.00	4.04
9	600166	福田汽车	3,333,716.00	3.26
10	600804	鹏博士	3,325,134.38	3.25
11	300104	乐视网	3,043,043.22	2.98
12	002410	广联达	3,015,195.74	2.95
13	300027	华谊兄弟	2,937,192.62	2.87
14	002465	海格通信	2,469,812.38	2.42
15	002121	科陆电子	2,345,244.98	2.30
16	300170	汉得信息	1,906,944.00	1.87
17	300012	华测检测	1,804,956.60	1.77
18	300124	汇川技术	1,726,210.65	1.69
19	600588	用友网络	1,593,142.26	1.56
20	600184	光电股份	1,305,867.84	1.28

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。

7.4.2 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	12,067,856.00	11.81
2	300024	机器人	7,897,177.00	7.73
3	600570	恒生电子	7,215,074.25	7.06
4	300182	捷成股份	7,056,725.68	6.91
5	600804	鹏博士	4,931,870.00	4.83
6	000681	视觉中国	4,896,892.31	4.79
7	300203	聚光科技	4,507,384.78	4.41
8	000939	凯迪电力	4,433,040.00	4.34
9	600372	中航电子	4,349,834.65	4.26
10	300251	光线传媒	4,182,826.08	4.09
11	002121	科陆电子	4,067,149.00	3.98
12	002421	达实智能	3,598,375.00	3.52
13	300206	理邦仪器	3,453,460.00	3.38
14	300027	华谊兄弟	3,343,671.00	3.27
15	300104	乐视网	3,231,893.00	3.16
16	002465	海格通信	3,179,948.00	3.11
17	002230	科大讯飞	2,995,020.00	2.93
18	300077	国民技术	2,831,361.50	2.77
19	002354	天神娱乐	2,778,300.00	2.72
20	000848	承德露露	2,283,523.04	2.23
21	000547	闽福发A	2,251,167.00	2.20
22	600699	均胜电子	2,183,906.00	2.14

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。

7.4.3 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	74,948,561.29
卖出股票收入（成交）总额	114,818,556.53

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。

7.5 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	5,017,500.00	3.83
	其中：政策性金融债	5,017,500.00	3.83
4	企业债券	15,904,300.00	12.13
5	企业短期融资券	13,026,710.00	9.94
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	33,948,510.00	25.90

7.6 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	126018	08 江铜债	100,000	9,837,000.00	7.50
2	041552007	15 农垦 CP001	70,000	7,032,900.00	5.37
3	041462035	14 华映科技 CP002	59,000	5,993,810.00	4.57
4	140444	14 农发 44	50,000	5,017,500.00	3.83
5	122522	12 兴城建	35,000	3,560,550.00	2.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	114,505.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	824,719.10
5	应收申购款	286,154.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,225,379.10

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300012	华测检测	11,193,893.00	8.54	筹划重大事项
2	300203	聚光科技	6,243,576.00	4.76	筹划重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
4,978	9,170.77	32,382,751.33	70.93%	13,269,325.74	29.07%

8.2 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	430,182.18	0.94%

8.3 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年12月28日）基金份额总额	335,865,199.76
本报告期期初基金份额总额	60,491,582.57
本报告期基金总申购份额	40,542,800.73
减：本报告期基金总赎回份额	55,382,306.23
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	45,652,077.07

注：基金总申购份额包含基金转换转入的份额，基金总赎回份额包含基金转换转出的份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，基金管理人不存在重大人事变动。基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为步艳红女士，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国信证券股份有限公司	1	151,974,188.44	80.18%	134,482.20	79.73%	-
五矿证券有限公司	1	37,560,984.38	19.82%	34,195.80	20.27%	-

渤海证券股份 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）本报告期内基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限 公司	32,261,098.24	100.00%	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方增长中小盘混合型开放式证	指定报刊、网站	2015 年 1 月 1 日

	券投资基金年度最后一日净值公告		
2	关于增加增财基金为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 1 月 8 日
3	关于在海通证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 1 月 20 日
4	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2015 年 1 月 21 日
5	关于在华安证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 1 月 30 日
6	东方基金管理有限责任公司关于参加同花顺基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 9 日
7	东方基金管理有限责任公司关于参加同花顺基金积分兑换活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 9 日
8	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）（2014 年第 2 号）	网站	2015 年 2 月 10 日
9	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2014 年第 2 号）	指定报刊、网站	2015 年 2 月 10 日
10	东方基金管理有限责任公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 27 日
11	关于在中信证券、中信证券（山东）及中信证券（浙江）开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 27 日

12	关于在东莞证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 4 日
13	关于在华福证券和江海证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 12 日
14	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2014 年年度报告	网站	2015 年 3 月 28 日
15	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2014 年年度报告摘要	指定报刊、网站	2015 年 3 月 28 日
16	关于在京东电商平台开通东方基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 30 日
17	关于增加上海证券为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 31 日
18	关于调整旗下基金交易所固定收益品种估值方法的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 31 日
19	东方基金管理有限责任公司关于子公司增加注册资本的公告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 3 日
20	东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 20 日
21	东方基金管理有限责任公司关于参加同花顺基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 22 日
22	关于增加上海利得为旗下基金销售渠道及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 28 日
23	东方增长中小盘混合型开放式证	指定报刊、网站	2015 年 5 月 5 日

	券投资基金基金经理变更公告		
24	关于在东海证券和广发证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 5 月 19 日
25	关于旗下基金参与农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 5 月 29 日
26	关于增加工商银行为东方增长中小盘混合基金基金销售渠道并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 6 月 5 日
27	东方基金管理有限责任公司关于子公司增加注册资本的公告	指定报刊、网站	2015 年 6 月 23 日
28	关于增加恒天明泽为旗下基金销售渠道及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 一、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方增长中小盘混合型开放式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、基金份额净值及其他临时公告

11.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，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。

11.3 查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方基金管理有限责任公司
2015 年 8 月 27 日