

# 东方龙混合型开放式证券投资基金

## 2014 年半年度报告

2014 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2014 年 8 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 22 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	1
§ 2 基金简介 .....	3
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
§ 4 管理人报告 .....	6
§ 5 托管人报告 .....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
§ 7 投资组合报告 .....	34
7.1 期末基金资产组合情况 .....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	34
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 .....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	42
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 .....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
§ 8 基金份额持有人信息 .....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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情况 .....	43
§ 9 开放式基金份额变动 .....	43
§ 10 重大事件揭示 .....	44
§ 11 备查文件目录 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方龙混合型开放式证券投资基金
基金简称	东方龙混合
基金主代码	400001
交易代码	400001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年11月25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	1,652,968,618.76份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济和资本市场的高速增长，为基金份额持有人谋求长期发展、稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股（包括债券）选择组成。本基金将资产配置、基金风格管理和个股选择都建立在全面、深入而有效的研究的基础上。研究贯穿于基金投资管理的每一个环节。
业绩比较基准	<p>本基金股票投资部分的业绩比较基准是中信标普300风格指数，具体包括中信标普300成长指数和中信标普300价值指数，本基金债券部分的业绩比较基准为中信标普全债指数。</p> <p>本基金整体业绩比较基准=中信标普300成长指数*30% + 中信标普300价值指数*45% + 中信标普全债指数*25%。</p> <p>如果中信标普指数有限公司停止计算编制这些指数或更改指数名称，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为</p>

	市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
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。

### 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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578或 400-628-5888	010-67595096
传真		010-66578700	010-66275853
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25号
办公地址		北京市西城区锦什坊街28号1-4层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		崔伟	王洪章

### 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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.orient-fund.com">http://www.orient-fund.com</a> 或 <a href="http://www.df5888.com">http://www.df5888.com</a>
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（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	-35,845,051.32
本期利润	382,263.39
加权平均基金份额本期利润	0.0002
本期加权平均净值利润率	0.03%
本期基金份额净值增长率	0.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014年6月30日）
期末可供分配利润	-531,958,810.02
期末可供分配基金份额利润	-0.3218
期末基金资产净值	1,121,009,808.74
期末基金份额净值	0.6782
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014年6月30日）
基金份额累计净值增长率	174.39%

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	1.69%	0.55%	0.73%	0.57%	0.96%	-0.02%
过去三个月	3.94%	0.58%	1.47%	0.65%	2.47%	-0.07%
过去六个月	0.52%	0.83%	-3.47%	0.77%	3.99%	0.06%

过去一年	3.73%	0.88%	2.08%	0.87%	1.65%	0.01%
过去三年	-1.64%	0.93%	-16.60%	0.96%	14.96%	-0.03%
自基金成立起至今	174.39%	1.36%	97.00%	1.35%	77.39%	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

东方龙混合型开放式证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2004 年 11 月 25 日至 2014 年 6 月 30 日)



## § 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6月30日,本

公司管理十三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。

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	2008-09-20	-	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责任公司，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、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。
李坤元 (女士)	本基金基金经理	2013-10-11	-	8 年	南开大学金融学硕士，8 年证券从业经历。曾任申银万国证券研究所宏观策略部固定收益分析师，信达澳银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2013 年 4 月加盟东方基金管理有限责任公司，现任东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理。
朱晓栋 (先生)	本基金基金经理助理	2012-08-16	2014-01-30	5 年	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责任公司，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、《东方龙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

2014 年上半年，本基金继续持有估值低、业绩优良、成长确定的绩优公司，少量调整

持仓结构，适当降低仓位，积极参与网下新股，等待投资机会的来临。

报告期内，本基金继续坚定持有保险、食品饮料等行业的龙头公司，根据地产销售数据，减持了部分地产公司的股票；出于对银行坏账的担忧，降低了银行股的持仓；继续分散投资组合，增持新兴行业的股票，行业的集中度有所降低；五月份，出于对后市的谨慎，以及参与新股网下配售的需要，本基金降低了股票仓位。

总的看来，上半年本基金表现尚可，净值表现好于市场，重仓的部分行业有较好的表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金净值增长率为 0.52%，业绩比较基准收益率为 -3.47%，高于业绩比较基准 3.99%。

#### 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 2014 年下半年，我们认为中国经济增速能够保持平稳增长的态势。从已公布的数据看，年初以来的经济微调政策已产生效果，利率缓慢下行，电力消耗以及货物运输情况有所好转；受益于全球经济的复苏，出口不断好转；国内消费也保持稳定，依旧保持了两位数的增长；铁路、特高压的投资开始加快，地产投资也保持了一定的增长。总的看，全球经济的复苏有助于中国保持稳定的发展速度。

高估值品种的业绩不达预期，可能会对 A 股市场的部分品种产生压力，新股的持续发行也会分流资金，从而加快小盘股泡沫破灭的速度；但经济数据的好转，将对权重股的走势会产生积极的效果；沪港通的预期对上海大盘蓝筹股也会有支撑。由于资金不足，结构分化可能成为下半年的主基调。

从行业层面上，我们继续看好保险、房地产、汽车等低估值、成长确定的行业，积极把握白酒、银行等行业见底后的投资机会；关注铁路设备、节能环保、家电、医药、食品饮料等行业的投资机会。我们认为沪港通有助于提振上述板块的估值。

本基金将积极参与新股的网下申购，并在市场探底过程中逐渐提高仓位，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）。

#### 4.7 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，本基金本报告期末进行利润分配。

## § 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东方龙混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,143,812.64	105,286.63
结算备付金		16,370,104.02	15,848,656.19
存出保证金		548,336.60	321,160.04
交易性金融资产	6.4.7.2	784,830,250.73	1,195,672,791.54
其中：股票投资		601,425,850.73	998,919,606.44
基金投资		-	-
债券投资		183,404,400.00	196,753,185.10
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	300,000,000.00	100,000,000.00
应收证券清算款		24,419,426.04	25,944,988.98
应收利息	6.4.7.5	6,274,456.38	1,822,941.50
应收股利		-	-
应收申购款		50,943.96	73,256.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,143,637,330.37	1,339,789,081.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		7,000,000.00	-
应付证券清算款		9,528,293.54	-
应付赎回款		993,396.60	3,341,326.40
应付管理人报酬		1,357,059.33	1,739,848.72
应付托管费		226,176.54	289,974.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,032,544.93	1,107,112.73
应交税费		-	-
应付利息		4,968.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	485,082.64	1,631,045.83
负债合计		22,627,521.63	8,109,308.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,652,968,618.76	1,973,713,329.81
未分配利润	6.4.7.1 0	-531,958,810.02	-642,033,556.48
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,121,009,808.74</b>	<b>1,331,679,773.33</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,143,637,330.37</b>	<b>1,339,789,081.80</b>

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6782 元，基金份额总额 1,652,968,618.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方龙混合型开放式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		17,932,839.84	-43,673,403.14
1. 利息收入		5,599,251.	5,288,821.77

		05	
其中：存款利息收入	6.4.7.11	313,478.13	1,114,837.50
债券利息收入		3,205,878.84	760,364.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,079,894.08	3,413,619.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-24,099,130.61	44,098,549.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-33,379,433.18	33,883,164.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-264,607.89	65,583.42
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	9,544,910.46	10,149,802.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	36,227,314.71	-93,607,472.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	205,404.69	546,697.77
<b>减：二、费用</b>		<b>17,550,576.45</b>	<b>15,153,678.64</b>
1. 管理人报酬		8,390,369.78	9,955,496.52
2. 托管费		1,398,394.92	1,659,249.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,416,044.50	3,335,118.89

5. 利息支出		126,792.96	-
其中：卖出回购金融资产支出		126,792.96	-
6. 其他费用	6.4.7.19	218,974.29	203,813.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>382,263.39</b>	<b>-58,827,081.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>382,263.39</b>	<b>-58,827,081.78</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方龙混合型开放式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,973,713,329.81	-642,033,556.48	1,331,679,773.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	382,263.39	382,263.39
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）	-320,744,711.05	109,692,483.07	-211,052,227.98
其中：1. 基金申购款	21,380,371.11	-7,222,842.48	14,157,528.63
2. 基金赎回款	-342,125,082.16	116,915,325.55	-225,209,756.61
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）	1,652,968,618.76	-531,958,810.02	1,121,009,808.74
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	1,914,532,733.57	-593,727,844.12	1,320,804,889.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-58,827,081.78	-58,827,081.78
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）	-139,931,641.04	38,138,532.85	-101,793,108.19
其中：1. 基金申购款	676,624,327.08	-201,057,935.75	475,566,391.33
2. 基金赎回款	-816,555,968.12	239,196,468.60	-577,359,499.52
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）	1,774,601,092.53	-614,416,393.05	1,160,184,699.48

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2004 年 9 月 24 日中国证监会《关于同意东方龙混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2004】152 号）和《关于募集东方龙混合型开放式证券投资基金的确认函》（基金部函【2004】117 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《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》自 2004 年 10 月 11 日至 2004 年 11 月 19 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 1,130,234,808.17 元人民币，业经普华永道中天会计师事务所有限公司“普华永道中天验字（2004）第 220 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》于 2004 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,727,725.99 份基金单位，其中认购资金利息折合 492,917.82 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方龙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。

#### 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

#### 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 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
	2014 年 6 月 30 日
活期存款	11,143,812.64
定期存款	-
其他存款	-
合计	11,143,812.64

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	596,511,075.21	601,425,850.73	4,914,775.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	10,296,443.84	10,360,000.00	63,556.16

	银行间市场	172,400,976.56	173,044,400.00	643,423.44
	合计	182,697,420.40	183,404,400.00	706,979.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		779,208,495.61	784,830,250.73	5,621,755.12

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末本基金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

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	300,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	300,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金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 2014年6月30日
应收活期存款利息	29,196.09
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	7,367.80
应收债券利息	6,136,055.90
应收买入返售证券利息	101,153.25
应收申购款利息	436.64
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	246.70
合计	6,274,456.38

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6其他资产

本期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
	2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,031,297.43
银行间市场应付交易费用	1,247.50
合计	3,032,544.93

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	1,906.29
预提费用	188,437.29
其他	44,739.06
合计	485,082.64

注：预提费用包括按日计提的审计费和信息披露费；其他为上海、深圳证券交易所返还证管费。

6.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,973,713,329.81	1,973,713,329.81
本期申购	21,380,371.11	21,380,371.11
本期赎回(以“-”号填列)	-342,125,082.16	-342,125,082.16
本期末	1,652,968,618.76	1,652,968,618.76

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	-501,715,324.10	-140,318,232.38	-642,033,556.48
本期利润	-35,845,051.32	36,227,314.71	382,263.39
本期基金份额交易产生的变动数	82,739,567.83	26,952,915.24	109,692,483.07
其中：基金申购款	-5,755,311.50	-1,467,530.98	-7,222,842.48
基金赎回款	88,494,879.33	28,420,446.22	116,915,325.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-454,820,807.59	-77,138,002.43	-531,958,810.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	212,419.87
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	97,395.09
其他	3,663.17
合计	313,478.13

注：其他包括基金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
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	2,580,211,109.29
减：卖出股票成本总额	2,613,590,542.47
买卖股票差价收入	-33,379,433.18

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	202,713,035.93

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,946,680.68
减：应收利息总额	2,030,963.14
债券投资收益	-264,607.89

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,544,910.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,544,910.46

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	36,227,314.71
——股票投资	37,238,830.21
——债券投资	-1,011,515.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	36,227,314.71

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	181,564.92

基金转换费收入	23,839.77
合计	205,404.69

6.4.7.18交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	7,414,094.50
银行间市场交易费用	1,950.00
合计	7,416,044.50

6.4.7.19其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	12,137.00
债券账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	218,974.29

注：其他为上清所 CFCA 证书服务费。

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

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

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、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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	233,463,936.42	4.96%	-	-

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 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6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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	123,682,388.69	82.94%	-	-

6.4.10.1.4 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6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券股份有限公司	484,000,000.00	4.45%	-	-

6.4.10.1.5 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 6 月 30 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	212,522.02	4.96%	212,522.02	7.01%
关联方名称	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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	-	-	-	-

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。

#### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	8,390,369.78
其中：支付销售机构的客户维护费	575,105.35	696,425.85

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,支付日期顺延。

6.4.10.2 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 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,398,394.92	1,659,249.46

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。

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,本基金均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,本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	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013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
中国建设银行股份有限公司	11,143,812.64	212,419.87	33,935,895.24	1,052,208.30

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，本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2014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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	认购新发	12.20	12.20	22,420	273,524.00	273,524.00	-
603168	莎普爱思	2014-06-24	2014-07-02	认购新发	21.85	21.85	9,892	216,140.20	216,140.20	-

注：本期末本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的债券。

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
002571	德力股份	2014-03-12	重大资产重组	15.05	2014-07-16	16.56	200,000	2,664,612.00	3,010,000.00	-
300369	绿盟科技	2014-06-26	重大资产重组	61.27	-	-	81,771	4,501,659.80	5,010,109.17	-
300379	东方通	2014-06-23	重大资产重组	62.17	2014-08-15	67.39	82,800	4,994,478.47	5,147,676.00	-

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 2014 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 2014 年 6 月 30 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 7,000,000.00 元，于 2014 年 7 月 3 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。

#### 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 2014年6月30日	上年末 2013年12月31日
A-1	111,032,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	111,032,000.00	-

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。

##### 6.4.13.2.2 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 2014 年 6 月 30 日	上年末 2013 年 12 月 31 日
AAA	-	42,054,870.00
AAA 以下	10,360,000.00	4,698,115.10
未评级	-	-
合计	10,360,000.00	46,752,985.10

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（2014 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 2014 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	11,143,812. 64	-	-	-	11,143,812. 64
结算备付金	16,370,104. 02	-	-	-	16,370,104. 02
存出保证金	548,336.60	-	-	-	548,336.60
交易性金融 资产-股票投 资	-	-	-	601,425,850 .73	601,425,850 .73
交易性金融 资产-债券投 资	173,044,400 .00	10,360,000. 00	-	-	183,404,400 .00
买入返售金 融资产	300,000,000 .00	-	-	-	300,000,000 .00
应收证券清 算款	-	-	-	24,419,426. 04	24,419,426. 04
应收利息	-	-	-	6,274,456.3 8	6,274,456.3 8
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	50,943.96	-	-	-	50,943.96
资产总计	501,157,597 .22	10,360,000. 00	-	632,119,733 .15	1,143,637,3 30.37
负债					
卖出回购金 融资产款	7,000,000.0 0	-	-	-	7,000,000.0 0
应付证券清 算款	-	-	-	9,528,293.5 4	9,528,293.5 4
应付赎回款	-	-	-	993,396.60	993,396.60
应付管理人	-	-	-	1,357,059.3	1,357,059.3

报酬				3	3
应付托管费	-	-	-	226,176.54	226,176.54
应付交易费用	-	-	-	3,032,544.93	3,032,544.93
应付利息	-	-	-	4,968.05	4,968.05
其他负债	-	-	-	485,082.64	485,082.64
负债总计	7,000,000.00	-	-	15,627,521.63	22,627,521.63
利率敏感度缺口	494,157,597.22	10,360,000.00	-	616,492,211.52	1,121,009,808.74
上年度末 2013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	105,286.63	-	-	-	105,286.63
结算备付金	15,848,656.19	-	-	-	15,848,656.19
存出保证金	321,160.04	-	-	-	321,160.04
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	998,919,606.44	998,919,606.44
交易性金融资产-债券投资	150,000,200.00	-	46,752,985.10	-	196,753,185.10
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	25,944,988.98	25,944,988.98
应收利息	-	-	-	1,822,941.50	1,822,941.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	73,256.92	-	-	-	73,256.92

资产总计	266,348,559 .78	-	46,752,985. 10	1,026,687,5 36.92	1,339,789,0 81.80
负债					
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,341,326.4 0	3,341,326.4 0
应付管理人 报酬	-	-	-	1,739,848.7 2	1,739,848.7 2
应付托管费	-	-	-	289,974.79	289,974.79
应付交易费 用	-	-	-	1,107,112.7 3	1,107,112.7 3
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,631,045.8 3	1,631,045.8 3
负债总计	-	-	-	8,109,308.4 7	8,109,308.4 7
利率敏感度 缺口	266,348,559 .78	-	46,752,985. 10	1,018,578,2 28.45	1,331,679,7 73.33

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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月 31日）
	市场利率下调0.25%	170,774.13	1,363,597.67
	市场利率上调0.25%	-170,231.93	-1,349,402.74

#### 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（本基金持有的金融工具以人民币计价，无重大外汇风险）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 2014年6月30日		上年度末 2013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	601,425,850.73	53.65	998,919,606.44	75.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	183,404,400.00	16.36	196,753,185.10	14.77
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	784,830,250.73	70.01	1,195,672,791.54	89.79

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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	沪深300指数下跌5%	-32,090,371.04	-52,830,569.19
沪深300指数上涨5%	32,090,371.04	52,830,569.19	

#### 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 11,946,894.00 元，占基金资产净值比例为 1.07%；上年度末本基金风险价值为 21,150,530.00 元，占基金资产净值比例为 1.82%。

#### 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	601,425,850.73	52.59
	其中：股票	601,425,850.73	52.59
2	固定收益投资	183,404,400.00	16.04
	其中：债券	183,404,400.00	16.04
	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	300,000,000.00	26.23
	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	27,513,916.66	2.41
7	其他各项资产	31,293,162.98	2.74
8	合计	1,143,637,330.37	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,601,325.39	0.68
C	制造业	202,463,771.77	18.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,640,000.00	0.50
F	批发和零售业	18,236,986.00	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	11,943,600.00	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,954,918.99	8.65
J	金融业	128,619,075.06	11.47
K	房地产业	107,558,253.64	9.59
L	租赁和商务服务业	13,529,000.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,072,500.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,806,419.88	0.34
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	601,425,850.73	53.65

### 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	601318	中国平安	1,000,000	39,340,000.00	3.51
2	600036	招商银行	2,500,000	25,600,000.00	2.28
3	000002	万科A	2,500,000	20,675,000.00	1.84
4	000858	五粮液	1,150,000	20,619,500.00	1.84
5	000001	平安银行	1,750,000	17,342,500.00	1.55
6	600266	北京城建	2,126,100	15,881,967.00	1.42

7	601166	兴业银行	1,499,999	15,044,989.97	1.34
8	600519	贵州茅台	104,500	14,836,910.00	1.32
9	000718	苏宁环球	2,800,000	12,628,000.00	1.13
10	600240	华业地产	2,500,000	12,200,000.00	1.09
11	601169	北京银行	1,299,973	10,477,782.38	0.93
12	600258	首旅酒店	700,000	10,262,000.00	0.92
13	000501	鄂武商 A	870,860	10,189,062.00	0.91
14	600887	伊利股份	300,000	9,936,000.00	0.89
15	600048	保利地产	2,000,000	9,920,000.00	0.88
16	601336	新华保险	449,967	9,507,802.71	0.85
17	000423	东阿阿胶	280,000	9,329,600.00	0.83
18	600000	浦发银行	1,000,000	9,050,000.00	0.81
19	601231	环旭电子	286,870	8,847,070.80	0.79
20	300115	长盈精密	381,042	8,390,544.84	0.75
21	300207	欣旺达	284,300	8,301,560.00	0.74
22	000024	招商地产	780,000	8,127,600.00	0.73
23	002085	万丰奥威	361,169	7,678,452.94	0.68
24	300010	立思辰	307,500	7,662,900.00	0.68
25	300386	飞天诚信	128,045	7,392,037.85	0.66
26	300017	网宿科技	108,300	6,909,540.00	0.62
27	300367	东方网力	79,400	6,717,240.00	0.60
28	600376	首开股份	1,500,000	6,480,000.00	0.58
29	002383	合众思壮	240,300	5,937,813.00	0.53
30	300002	神州泰岳	370,100	5,829,075.00	0.52
31	601668	中国建筑	2,000,000	5,640,000.00	0.50
32	000402	金融街	1,010,000	5,504,500.00	0.49
33	600446	金证股份	176,633	5,429,698.42	0.48
34	600697	欧亚集团	300,000	5,352,000.00	0.48
35	300287	飞利信	190,400	5,289,312.00	0.47
36	600438	通威股份	557,200	5,287,828.00	0.47
37	002268	卫士通	142,400	5,275,920.00	0.47
38	002104	恒宝股份	263,500	5,164,600.00	0.46
39	300379	东方通	82,800	5,147,676.00	0.46

40	601333	广深铁路	2,000,000	5,080,000.00	0.45
41	300369	绿盟科技	81,771	5,010,109.17	0.45
42	000918	嘉凯城	1,850,000	4,773,000.00	0.43
43	002279	久其软件	200,000	4,772,000.00	0.43
44	000069	华侨城 A	1,000,000	4,690,000.00	0.42
45	300037	新宙邦	127,700	4,635,510.00	0.41
46	600571	信雅达	237,400	4,626,926.00	0.41
47	300339	润和软件	245,958	4,476,435.60	0.40
48	601222	林洋电子	189,900	4,289,841.00	0.38
49	300359	全通教育	60,065	4,284,436.45	0.38
50	600497	驰宏锌锗	464,259	4,275,825.39	0.38
51	600699	均胜电子	170,100	4,274,613.00	0.38
52	600158	中体产业	450,000	4,221,000.00	0.38
53	300170	汉得信息	318,211	4,104,921.90	0.37
54	300075	数字政通	125,515	4,057,899.95	0.36
55	300128	锦富新材	294,700	3,993,185.00	0.36
56	300307	慈星股份	370,000	3,922,000.00	0.35
57	600741	华域汽车	400,000	3,912,000.00	0.35
58	600661	新南洋	143,422	3,806,419.88	0.34
59	300212	易华录	119,400	3,739,608.00	0.33
60	300213	佳讯飞鸿	234,600	3,739,524.00	0.33
61	600588	用友软件	250,530	3,524,957.10	0.31
62	002311	海大集团	318,782	3,509,789.82	0.31
63	002327	富安娜	310,854	3,459,805.02	0.31
64	002475	立讯精密	104,306	3,419,150.68	0.31
65	002194	武汉凡谷	266,006	3,391,576.50	0.30
66	300219	鸿利光电	246,216	3,323,916.00	0.30
67	600276	恒瑞医药	100,000	3,316,000.00	0.30
68	600138	中青旅	150,000	3,267,000.00	0.29
69	600410	华胜天成	255,200	3,034,328.00	0.27
70	601238	广汽集团	400,000	3,012,000.00	0.27
71	002571	德力股份	200,000	3,010,000.00	0.27
72	600089	特变电工	351,260	2,982,197.40	0.27

73	002290	禾盛新材	225,300	2,976,213.00	0.27
74	002146	荣盛发展	300,000	2,841,000.00	0.25
75	600009	上海机场	200,000	2,580,000.00	0.23
76	300240	飞力达	200,000	2,440,000.00	0.22
77	000401	冀东水泥	300,000	2,439,000.00	0.22
78	002604	龙力生物	195,000	2,402,400.00	0.21
79	601688	华泰证券	300,000	2,256,000.00	0.20
80	000939	凯迪电力	300,000	2,220,000.00	0.20
81	002376	新北洋	200,000	2,200,000.00	0.20
82	300352	北信源	87,700	1,876,780.00	0.17
83	002601	佰利联	100,000	1,850,000.00	0.17
84	000895	双汇发展	50,000	1,789,500.00	0.16
85	002417	三元达	250,000	1,787,500.00	0.16
86	000338	潍柴动力	100,000	1,779,000.00	0.16
87	002368	太极股份	52,495	1,758,057.55	0.16
88	600684	珠江实业	250,000	1,705,000.00	0.15
89	002185	华天科技	150,000	1,677,000.00	0.15
90	000596	古井贡酒	80,000	1,525,600.00	0.14
91	600704	物产中大	180,000	1,490,400.00	0.13
92	600066	宇通客车	90,000	1,452,600.00	0.13
93	002450	康得新	60,000	1,365,000.00	0.12
94	600809	山西汾酒	100,000	1,328,000.00	0.12
95	000926	福星股份	200,000	1,304,000.00	0.12
96	600208	新潮中宝	444,242	1,297,186.64	0.12
97	601519	大智慧	200,000	1,174,000.00	0.10
98	000733	振华科技	90,000	1,164,600.00	0.10
99	600535	天士力	30,000	1,163,100.00	0.10
100	600583	海油工程	150,000	1,105,500.00	0.10
101	000581	威孚高科	40,000	1,078,800.00	0.10
102	002508	老板电器	37,500	1,060,125.00	0.09
103	600787	中储股份	80,000	1,045,600.00	0.09
104	600386	北巴传媒	100,000	932,000.00	0.08
105	002401	中海科技	80,000	816,800.00	0.07

106	600717	天津港	100,000	798,000.00	0.07
107	000917	电广传媒	50,000	761,500.00	0.07
108	002269	美邦服饰	79,919	664,126.89	0.06
109	000729	燕京啤酒	100,000	650,000.00	0.06
110	002726	龙大肉食	37,493	639,630.58	0.06
111	002515	金字火腿	30,000	519,900.00	0.05
112	000848	承德露露	20,000	397,400.00	0.04
113	600054	黄山旅游	30,000	382,500.00	0.03
114	600329	中新药业	20,000	309,800.00	0.03
115	002727	一心堂	22,420	273,524.00	0.02
116	002415	海康威视	15,000	254,100.00	0.02
117	002539	新都化工	20,000	217,800.00	0.02
118	603168	莎普爱思	9,892	216,140.20	0.02
119	000800	一汽轿车	20,000	192,000.00	0.02
120	603006	联明股份	7,567	108,208.10	0.01
121	002568	百润股份	1,000	18,000.00	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	000541	佛山照明	41,105,990.37	3.09
2	601166	兴业银行	34,876,312.37	2.62
3	000001	平安银行	34,533,571.70	2.59
4	300207	欣旺达	32,843,515.44	2.47
5	300296	利亚德	30,240,979.97	2.27
6	002304	洋河股份	25,264,897.19	1.90
7	600036	招商银行	24,315,579.01	1.83
8	000858	五粮液	22,075,166.10	1.66
9	600588	用友软件	21,407,425.94	1.61
10	300300	汉鼎股份	20,584,019.86	1.55
11	300323	华灿光电	19,964,485.42	1.50
12	300232	洲明科技	18,534,827.30	1.39

13	300212	易华录	18,167,134.04	1.36
14	600048	保利地产	17,691,930.26	1.33
15	000718	苏宁环球	17,571,956.73	1.32
16	000049	德赛电池	17,396,249.11	1.31
17	002660	茂硕电源	17,273,308.06	1.30
18	600405	动力源	17,241,080.30	1.29
19	600887	伊利股份	16,870,928.70	1.27
20	300115	长盈精密	16,262,909.07	1.22

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	000002	万科A	73,132,935.29	5.49
2	601318	中国平安	52,699,669.39	3.96
3	600036	招商银行	44,863,877.17	3.37
4	000541	佛山照明	41,837,646.33	3.14
5	600383	金地集团	41,044,132.07	3.08
6	000001	平安银行	36,779,493.07	2.76
7	600016	民生银行	35,834,013.72	2.69
8	300296	利亚德	31,745,589.60	2.38
9	000620	新华联	30,606,924.76	2.30
10	600519	贵州茅台	27,629,872.15	2.07
11	300207	欣旺达	27,371,183.35	2.06
12	601601	中国太保	27,046,225.05	2.03
13	600048	保利地产	27,038,054.81	2.03
14	002304	洋河股份	24,766,872.90	1.86
15	300323	华灿光电	24,548,696.31	1.84
16	601166	兴业银行	22,825,411.52	1.71
17	300300	汉鼎股份	20,863,247.69	1.57
18	300232	洲明科技	20,833,641.27	1.56

19	600742	一汽富维	20,748,946.50	1.56
20	300372	欣泰电气	20,559,096.43	1.54

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	2,178,857,956.55
卖出股票收入（成交）总额	2,580,211,109.29

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	62,012,400.00	5.53
	其中：政策性金融债	62,012,400.00	5.53
4	企业债券	10,360,000.00	0.92
5	企业短期融资券	111,032,000.00	9.90
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	183,404,400.00	16.36

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	130236	13 国开 36	620,000	62,012,400.00	5.53

2	041361044	13 中普天 CP001	500,000	50,460,000.00	4.50
3	041366011	13 津保税 CP002	400,000	40,416,000.00	3.61
4	041454010	14 洋河 CP001	200,000	20,156,000.00	1.80
5	124504	11 鹰投债	100,000	10,360,000.00	0.92

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**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	548,336.60
2	应收证券清算款	24,419,426.04
3	应收股利	-
4	应收利息	6,274,456.38
5	应收申购款	50,943.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,293,162.98

**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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 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
51,725	31,956.86	804,081,424.44	48.64%	848,887,194.32	51.36%

### 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,123,523.83	0.07%

### 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	>=100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年11月25日）基金 份额总额	1,130,727,725.99
本报告期期初基金份额总额	1,973,713,329.81
本报告期基金总申购份额	21,380,371.11
减：本报告期基金总赎回份额	342,125,082.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,652,968,618.76

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。

## § 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

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。

本基金管理人已分别通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》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。

### 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。该案件于报告期内在北京市西城区人民法院开庭审理。截至报告日，上述诉讼仍在审理中。

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	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

称	单元 数量	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	
中国 国际金 融有 限公 司	2	977,603,199.94	20.78%	890,011.02	20.78%	-
平安证 券有限 责任公 司	1	893,502,985.95	18.99%	813,445.97	18.99%	-
申银万 国证券 股份有 限公司	1	589,694,513.17	12.53%	536,857.02	12.53%	-
东方证 券股份 有限公 司	1	487,793,487.38	10.37%	444,086.31	10.37%	-
中国中 投证券 有限责 任公司	1	368,262,183.90	7.83%	335,266.20	7.83%	-
国金证 券股份 有限公 司	1	319,458,852.03	6.79%	290,836.19	6.79%	-
国信证 券股份 有限公 司	1	265,806,862.47	5.65%	241,989.49	5.65%	-
安信证 券股份 有限公 司	1	248,177,766.20	5.27%	225,941.57	5.27%	-

司						
东北证 券股份 有限公 司	2	233,463,936.42	4.96%	212,522.02	4.96%	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	1	198,627,744.52	4.22%	180,831.20	4.22%	-
中信证 券股份 有限公 司	1	122,890,129.84	2.61%	111,878.76	2.61%	-
东莞证 券有限 责任公 司	1	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
国元证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
恒泰长 财证券 有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
江海证 券有限 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 2 个交易单元, 分别为安信证券股份有限公司深圳证券交易所交易单元 1 个、国泰君安证券股份有限公司深圳证券交易所交易单元 1 个; 取消租用 1 个交易单元, 为东莞证券有限责任公司上海证券交易所交易单元。

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		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
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	10,440,654.60	7.00%	6,089,800,000.00	55.98%	-	-

限公司						
东方证 券股份 有限公 司	-	-	3,044,500,000.00	27.99%	-	-
中国中 投证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	10,535,699.10	7.06%	1,170,500,000.00	10.76%	-	-
安信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	123,682,388.69	82.94%	484,000,000.00	4.45%	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	4,472,829.60	3.00%	90,000,000.00	0.83%	-	-

东莞证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰长财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-

**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	东方龙混合型开放式证券投资基金年度最后一日净值公告	指定报刊、网站	2014-01-02
2	东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）（2013年第2号）	网站	2014-01-08
3	东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2013年第2号）	指定报刊、网站	2014-01-08
4	东方龙混合型开放式证券投资基金2013年第4季度报告	指定报刊、网站	2014-01-22
5	关于增加北京展恒基金销售有限公司为旗下基金销售渠道的公告	指定报刊、网站	2014-03-11
6	东方基金管理有限责任公司关于子公司增加注册资本等相关事项的公告	指定报刊、网站	2014-03-13

7	东方龙混合型开放式证券投资基金2013年年度报告摘要	指定报刊、网站	2014-03-29
8	东方龙混合型开放式证券投资基金2013年年度报告	网站	2014-03-29
9	关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2014-04-02
10	东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2014-04-04
11	东方龙混合型开放式证券投资基金2014年第1季度报告	指定报刊、网站	2014-04-21
12	东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2014-05-16
13	关于增加吉林银行为旗下基金代销渠道的公告	指定报刊、网站	2014-05-21
14	东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2014-06-06
15	关于旗下基金参与华泰证券基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2014-06-09

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 一、《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方龙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](http://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

2014 年 8 月 28 日