国联安双力中小板综指分级证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]日

基金管理人：国联安基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年七月二十日

第1节 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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[illegible]年[illegible]月[illegible]日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至这[illegible]止。

第2节 基金产品概况

基金简称	国联安双力中小板综指分级（场内简称：国安双力）
基金主代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过[illegible]，年跟踪误差不超过[illegible]，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	[illegible]中小板综指收益率[illegible]（税后银行存款利率（税后）
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属三级基金的基金简称	国联安双力中小板综指（场内简称：双力[illegible]） / 国联安双力中小板综指（场内简称：双力[illegible]） / 国联安双力中小板综指（场内简称：国安双力）
下属三级基金的交易代码	[illegible] / [illegible] / [illegible]
报告期末下属三级基金的份额总额	[illegible] / [illegible] / [illegible]
下属三级基金的风险收益特征	低风险低收益 / 高风险高收益 / 本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

第3节 主要财务指标和基金净值表现

[illegible] 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注：[illegible]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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

[illegible]上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申赎赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

[illegible]期末净值表现

[illegible]期末报告期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

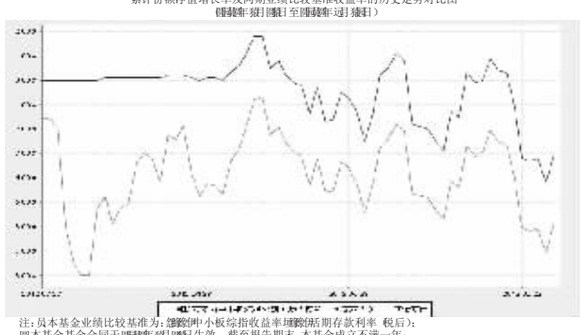
阶段	净值增长率[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率[illegible]	业绩比较基准收益率标准差[illegible]	[illegible]于[illegible]	[illegible]于[illegible]
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]自基金合同生效以来基金累计份额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

国联安双力中小板综指分级证券投资基金

累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日）



注：员本基金业绩比较基准为：[illegible]中小板综指收益率[illegible]（税后银行存款利率（税后）；

圆本基金基金合同于[illegible]年[illegible]月[illegible]日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；

猿本基金建仓期为自基金合同生效之日起的这个月。截至本报告期末本基金尚在建仓期。

第4节 管理人报告

[illegible] 基金经理（或基金经理小组）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		
黄志钢	本基金基金经理、兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]年	黄志钢先生，硕士，先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于[illegible]年[illegible]月加盟国联安基金管理有限公司，曾担任金融工程分析师。[illegible]年[illegible]月起，担任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。[illegible]年[illegible]月起，兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。[illegible]年[illegible]月起，兼任本基金基金经理。[illegible]年[illegible]月起，兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理。

注：员本基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

圆证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

[illegible]管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

[illegible]公平交易专项说明

[illegible]公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先、价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量[illegible]的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

[illegible]异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

[illegible]报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

[illegible]报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

[illegible]年第二季度，经济增长速度出现了一定程度的下滑，通货膨胀水平有所回落；另一方面，央行降低存款准备金率和基准利率，宏观政策放松的预期，在一定程度上减缓了经济下滑的趋势。第二季度市场总体呈现横盘整理的格局，其中中小板综指的涨幅为[illegible]，上证综指的涨幅为[illegible]。

本报告期内，本基金基本完成了建仓。在建仓的过程中，为了避免净值的大幅波动，我们采取了逐步建仓的策略。第三季度，本基金将根据基金合同的约定，紧密跟踪标的指数，力争将跟踪误差控制在合理范围。

[illegible]报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为[illegible]元，本报告期份额净值增长率为[illegible]，同期业绩比较基准收益率为[illegible]。自[illegible]年[illegible]月[illegible]日本基金在深圳证券交易所上市至本报告期末，日均跟踪偏离度为[illegible]，年化跟踪误差为[illegible]。本基金跟踪误差较大的主要原因是由于本基金尚处于建仓期，待建仓期结束后，本基金的跟踪误差将会恢复到正常水平。

第5节 投资组合报告

[illegible]报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
猿	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
源	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按行业分类的股票投资组合

[illegible]按指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
粤	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
悦员	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
悦圆	木材、家具	[illegible]	[illegible]
悦猿	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
悦愿愿	其他制造业	[illegible]	[illegible]
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
耘	建筑业	[illegible]	[illegible]
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郧	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
配	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
员	[illegible]	洋河股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	苏宁电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	金螳螂	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	宁波银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	美邦服饰	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	歌尔声学	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	荣盛发展	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	露天煤业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	新和成	[illegible]	[illegible]	[illegible]
园园	[illegible]	獐子岛	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

[illegible]报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

[illegible]报告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

本基金本报告期末未持有债券。

[illegible]报告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。

[illegible]报告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。

[illegible]投资组合报告附注

[illegible]本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

[illegible]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。

[illegible]其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	[illegible]
苑	待摊费用	[illegible]
愿	其他	[illegible]
怨	合计	[illegible]

[illegible]报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

[illegible]报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

[illegible]报告期末指数投资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情况。

[illegible]报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限情况。

第6节 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安双力（[illegible]中小板综指场内简称：双力[illegible]）	国联安双力（[illegible]中小板综指场内简称：双力[illegible]）	国联安双力中小板综指（场内简称：国安双力）
报告期期初基金份额总额	[illegible]	[illegible]	[illegible]
报告期期间基金总申购份额	原	原	[illegible]
减：报告期期间基金总赎回份额	原	原	[illegible]
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“[illegible]”填列）	[illegible]	[illegible]	[illegible]
报告期期末基金份额总额	[illegible]	[illegible]	[illegible]

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

第7节 备查文件目录

[illegible]备查文件目录

员 《中国证监会批准国联安双力中小板综指分级证券投资基金发行及募集的文件

圆 《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》

猿 《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》

源 《国联安双力中小板综指分级证券投资基金托管协议》

缘 基金管理人业务资格批件和营业执照

远 基金托管人业务资格批件和营业执照

苑 中国证监会要求的其他文件

[illegible]存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路[illegible]号星展银行大厦[illegible]

[illegible]查阅方式

网址：[illegible]或[illegible]

国联安基金管理有限公司

二〇一二年七月二十日

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]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
报告送出日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]日

第1节 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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[illegible]年[illegible]月[illegible]日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至这[illegible]止。

第2节 基金产品概况

基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]
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[illegible]指数收益率[illegible]中证综合债券指数收益率[illegible]”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。
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

第3节 主要财务指标和基金净值表现

[illegible] 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注：[illegible]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。

于所述基金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。

[illegible]期末净值表现

[illegible]期末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	净值增长率[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率盂	业绩比较基准收益率标准差榆	[illegible]于[illegible]
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]自基金合同生效以来基金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型开放式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日）

注：本基金建仓期为这个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。本基金合同生效日为[illegible]年[illegible]月[illegible]日，至披露时点不满一年。

第4节 管理人报告

[illegible]基金经理（或基金经理小组）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		
呼振翼（先生）	本基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]年	对外经济贸易大学金融学硕士，[illegible]年期货和证券从业经历。历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。[illegible]年[illegible]月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究员，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：[illegible]此处的任职日期和离任日期均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

于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。

[illegible]报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

[illegible]管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

[illegible]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》（[illegible]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，未直接或通过与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。

[illegible]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[illegible]的情况。

[illegible]报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

[illegible]报告期内基金投资策略和运作分析

[illegible]年[illegible]度，本基金适当均衡持仓的行业结构和风格特征，减持周期性行业股票，增持非周期行业股票，少量增持小盘成长股。

报告期内，行业配置上，本基金保持了对银行、保险、商业贸易、地产、食品饮料等行业的龙头公司的配置，减持了煤炭、机械、化工等行业的配置，增持纺织服装、医药等行业的稳定增长公司，均衡行业配置；在投资风格上，本基金增持了小盘股，开始少量建仓。鉴于[illegible]开始，中国经济呈现加速探底的迹象，[illegible]季度本基金没有增加仓位，仅进行了结构调整。

[illegible]报告期内基金的业绩表现

[illegible]年[illegible]月[illegible]日至这[illegible]日，本基金净值增长率为[illegible]，业绩比较基准收益率为[illegible]，高于业绩比较基准[illegible]。

[illegible]管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望[illegible]季度，我们对中国经济持审慎乐观的看法。企业去库存的过程已经告一段落，工业生产增速有望在[illegible]季度得到改善；房地产销售有明显恢复，出口也将随着欧美经济的复苏有所起色。中国经济增速有望好转，但复苏的力度将远弱于以往的复苏。

目前制约[illegible]股市场表现的主要是场内投资者行为的短期化以及场外投资者信心的缺失。虽然市场估值较低，股票相对债券、房产有很强的优势，但过去几年市场的表现让人们对[illegible]股缺乏信心，资金不愿意进入股市。

[illegible]季度，我们看好保险、券商、地产、环保等受益于产业政策的行业，也看好医药、食品饮料、商业贸易等增长稳健的行业。

第5节 投资组合报告

[illegible]报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
粤	农、林、牧、渔业	原	原
月	采掘业	原	原
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	原	原
悦员	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属、非金属	原	原
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
悦愿愿	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	原	原
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郧	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
配	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
员	[illegible]	新北洋	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	星辉车模	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	海通证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	上海家化	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	招商地产	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	中信证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	中国国旅	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	海宁皮城	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	恒生电子	[illegible]	[illegible]	[illegible]
园园	[illegible]	东华软件	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
员	国家债券	原	原
圆	央行票据	原	原
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中：政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	原	原
缘	企业短期融资券	[illegible]	[illegible]
远	中期票据	原	原
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	原	原
怨	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
员	[illegible]	[illegible]熙港悦[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	[illegible]熙[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	原	原	原	原	原
缘	原	原	原	原	原

[illegible]报告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。

[illegible]报告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。

[illegible]投资组合报告附注

[illegible]本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

[illegible]本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

[illegible]其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	原
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

[illegible]报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
员	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告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情况。

第6节 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

第7节 备查文件目录

[illegible]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、基金份额净值及其临时公告

[illegible]存放地点

上述各查文本存放在基金管理人办公场所。

[illegible]查阅方式

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，投资者还可在基金管理人网站（[illegible]）查阅。

东方基金管理有限责任公司

[illegible]年[illegible]月[illegible]日

东方策略成长股票型开放式证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]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：[illegible]年[illegible]月[illegible]日

第1节 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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[illegible]年[illegible]月[illegible]日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至这[illegible]止。

第2节 基金产品概况

基金简称	东方策略成长股票	
基金主代码	[illegible]	
交易代码	[illegible]（前端）	[illegible]（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	
报告期末基金份额总额	[illegible]	
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[illegible]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[illegible]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[illegible]指数收益率[illegible]+中信标普全债指数收益率[illegible]	
	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[illegible]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。	
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	

第3节 主要财务指标和基金净值表现

[illegible] 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注：[illegible]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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

[illegible]上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申赎赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

[illegible]期末净值表现

[illegible]期末报告期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 |