东方强化收益债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月24日

§1 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2013年10月21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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方强化收益债券
基金主代码	400016
交易代码	400016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月9日
报告期末基金份额总额	174,968,765.45份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,追求稳定的当期收益和长期增值,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金采用"中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%"作为投资业绩比较基准。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,495,978.45
2.本期利润	-1,568,875.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0075
4.期末基金资产净值	180,687,262.58
5.期末基金份额净值	1.0327

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.66%	0.13%	-0.78%	0.16%	0.12%	-0.03%

3.2.2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

东方强化收益债券型证券投资基金

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

(2012年10月9日至2013年9月30日)

注:本基金合同于2012年10月9日生效,截至报告期末,基金合同生效不满一年。本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1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		
王丹丹(女士)	本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2012-10-9	-	7年	中国人民银行研究生部金融学硕士,7年基金从业经历。2006年6月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券研究员、债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理。现任投资决策委员会委员、固定收益部副总经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型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、东方稳健回报债券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均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

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、《东方强化收益债券型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中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

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。

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年3季度,海外经济体中,欧元区经济复苏有所加快,欧元兑美元一路上行,而美联储将削减购债规模的预期,对部分新兴经济体的利率和外汇市场也形成重创,但美国三季度的就业数据不佳,致使9月的美联储会议作出不削减购债规模的决定,超出市场预期,风险偏好有所恢复。国内方面,补库存推动经济环比增速改善,PPI降幅收窄并在8月份环比转正,8月工业增速突破10%,而克强总理提出"增长有下限,通胀有上限"的政策导向,市场增强了对经济年内企稳的预期。

三季度债市呈单边下跌走势,利率债收益率达到近年来高点,信用利差却明显收窄。债券市场受到以下三个不利因素影响:第一,6月钱荒后,商业银行对流动性管理格外重视,同时又出于盈利的要求提高对高收益资产的配置,最终对利率债的配置需求形成明显挤压;第二,央行货币政策维持中性偏紧,采取"放短锁长"的方式调控市场流动性,降低了商业银行配置中长期债券的能力;第三,利率债供给出现井喷,不仅政策金融债的发行节奏加快,地方债也从三季度开始密集发行,利率债供需矛盾非常突出。总体来看,中长期利率债收益率的上行幅度为50-100bp,7、10年国债收益率突破4%,而信用债由于供给下降,收益率上行幅度小于利率债,信用利差反而缩窄。

三季度股市展开缓慢的修复行情,沪深300上涨9.47%,创业板指数上涨35.2%,市场风险偏好持续提升。

报告期内,本基金继续对权益类资产维持低配,组合债券持仓以高评级为主,随着收益率的走高,在8、9月份买入中长期利率债,组合久期和杠杆均明显提升。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年7月1日至9月30日,本基金净值增长率为-0.66%,业绩比较基准收益率为-0.78%,高于业绩比较基准0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年四季度,国内经济增长保持稳定,通胀有所抬升,但非趋势性且压力不大。美联储削减购债规模进程不确定,但外部流动性明显改善的概率不高,流动性仍然维持中性。利率债收益率处于高位,具有很高的配置价值。我们将继续增强对利率债的配置力度,并关注权益类资产的投资机会。

"诚信是基,回报为金",我们珍惜持有人的每一份利益,用我们的专业知识、勤恳态度,谋求长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1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(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	308,601,918.65	97.25
	其中:债券	308,601,918.65	97.25
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,783,964.66	0.56
6	其他各项资产	6,928,492.51	2.18
7	合计	317,314,375.82	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4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(%)
1	国家债券	78,453,060.00	43.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,723,000.00	10.92
	其中:政策性金融债	19,723,000.00	10.92
4	企业债券	9,903,000.00	5.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	198,178,000.00	109.68
7	可转债	2,344,858.65	1.30
8	其他	-	-
9	合计	308,601,918.65	170.79

5.5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(%)
1	1282553	12东风MTN1	200,000	20,044,000.00	11.09
2	1282462	12人福MTN1	200,000	20,032,000.00	11.09
3	1282394	12新奥MTN1	200,000	20,026,000.00	11.08
4	1282463	12郑路桥MTN1	200,000	20,016,000.00	11.08
5	1282156	12中石油MTN1	200,000	19,604,000.00	10.85

5.6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。

5.7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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,874.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,882,724.26
5	应收申购款	27,894.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,928,492.51

5.10.4报告期未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(%)
1	110023	民生转债	1,541,651.70	0.85
2	127001	海直转债	803,206.95	0.44

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	219,822,221.52
本报告期基金总申购份额	11,337,247.17
减:本报告期基金总赎回份额	56,190,703.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	174,968,765.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

东方基金管理有限责任公司根据中国证券监督管理委员会《关于核准东方基金管理有限责任公司设立子公司的批复》(证监许可[2013]1085号)设立子公司东方汇智资产管理有限公司(以下简称"东方汇智"),业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

一、《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方强化收益债券型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

9.2存放地点

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

9.3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(www.orient-fund.com)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2013年10月24日

东方安心收益保本混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月24日

§1 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2013年10月21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2013年7月3日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方安心收益保本
基金主代码	400020
交易代码	400020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月3日
报告期末基金份额总额	174,536,833.11份
投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,控制本金损失的风险,并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将综合运用固定比例投资组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简称CPPI策略)与基于期权的投资组合保险策略(Option-Based Portfolio Insurance,以下简称OBPI策略)在保本周期内实现保值增值的目的。
业绩比较基准	以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月3日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,513,110.84
2.本期利润	1,513,110.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0078
4.期末基金资产净值	175,910,228.40
5.期末基金份额净值	1.0079

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。

③本基金基金合同于2013年7月3日生效。

3.2基金净值表现

3.2.1本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

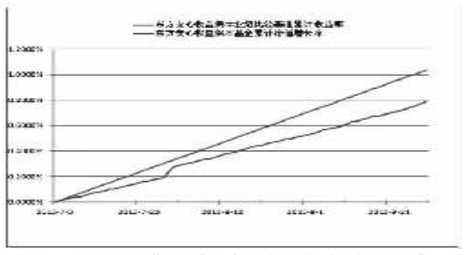
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.79%	0.01%	1.05%	0.01%	-0.26%	0.00%

3.2.2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

东方安心收益保本混合型证券投资基金

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

(2013年7月3日至2013年9月30日)



注:本基金合同于2013年7月3日生效,截至报告期末,本基金成立不满六个月,仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1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		
张岗(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2013-7-3	-	11年	西北大学经济管理学院经济学博士,11年证券从业经验。曾任健桥证券股份公司行业公司部经理、天治基金管理有限公司研究员、基金经理、投资副总监,建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部经理,现任权益投资部总经理、投资决策委员会委员、东方保本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、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。
王丹丹(女士)	本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2013-7-3	-	7年	中国人民银行研究生部金融学硕士,7年基金从业经历。2006年6月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券研究员、债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理。现任投资决策委员会委员、固定收益部副总经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型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、东方稳健回报债券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均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

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、《东方安心收益保本混合型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作基金资产,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中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

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。

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年3季度,国际方面,美国经济持续复苏,且联储也推迟了QE3的退出;国内方面,政府提出"稳增长"口号,并加大了信贷的投放力度。宏观经济在基建投资的带动之下加速,经历了较为明显的复苏。资金面方面,"钱荒"之后,央行采取了更为精细的调控方式,不断采取逆回购的方式为市场注入流动性,1天和7天回购利率一直维持在低位水平。

债券市场三季度,尽管资金面并不紧张,但在基本面复苏超预期和供给放量的背景下,经历了收益率大幅上升的过程。10年国债收益率一度上升到4.15%以上,超过2011年熊市高点。信用债收益率也随之上行。

报告期内,本基金进行了大量的同业存款和逆回购操作,成功规避了三季度的市场调整。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年7月3日至9月30日,本基金净值增长率为0.79%,业绩比较基准收益率为1.05%,低于业绩比较基准0.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,经济恢复动能的可持续性值得怀疑。稳增长政策所带来的基建投资是否能持续强劲值得怀疑。加上房地产投资可能高位回落,未来经济下台阶基本已成市场共识。国际方面,美国QE退出仍有悬念,再加上财政政策的干扰,美国经济仍然没有表现出非常强劲的复苏动能,对中国的出口拉动有限。

目前市场已经有所企稳,收益率开始具备一定的吸引力。基本面也没有出现进一步利空债市的情况。本基金将在优选发债主体资质的前提下,逐步加大债券的配置力度。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承"诚信是基、回报为金"的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

§5 投资组合报告

5.1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(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	308,601,918.65	97.25
	其中:债券	308,601,918.65	97.25
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	27,000,000.00	15.29
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	149,386,822.33	84.62
6	其他各项资产	154,767.50	0.09
7	合计	176,541,589.83	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4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。

5.5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。

5.6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。

5.7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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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、处罚的情形。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	154,757.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,767.50

5.10.4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债券。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	221,496,054.75
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	338,260.10
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	47,297,481.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	174,536,833.11

注:本基金基金合同于2013年7月3日生效。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

东方基金管理有限责任公司根据中国证券监督管理委员会《关于核准东方基金管理有限责任公司设立子公司的批复》(证监许可[2013]1085号)设立子公司东方汇智资产管理有限公司(以下简称"东方汇智"),业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

一、《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方安心收益保本混合型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

9.2存放地点

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

9.3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(www.orient-fund.com)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2013年10月24日

东方利群混合型发起式证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24日

§1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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2013年7月17日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方利群混合
基金主代码	400022
交易代码	400022
基金运作方式	契约型开放式发起式
基金合同生效日	2013年7月17日
报告期末基金份额总额	108,006,308.98份
投资目标	努力把握市场趋势,在适当范围内灵活的进行资产配置调整,在严格控制风险的前提下,谋求本基金资产的保值增值,分享经济发展的成果,提供全面超越通货膨胀的收益回报。
投资策略	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:同期五年期人民币定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月17日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,312,619.05
2.本期利润	1,282,892.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0051
4.期末基金资产净值	108,652,486.46
5.期末基金份额净值	1.0060

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。

③本基金基金合同于2013年7月17日生效。

3.2基金净值表现

3.2.1本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

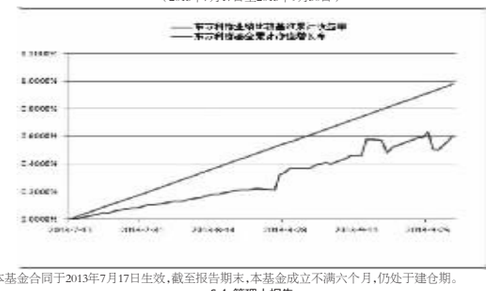
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.60%	0.04%	0.99%	0.01%	-0.39%	0.03%

3.2.2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

东方利群混合型发起式证券投资基金

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

(2013年7月17日至2013年9月30日)



注:本基金合同于2013年7月17日生效,截至报告期末,本基金成立不满六个月,仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1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		
于鑫(先生)	本基金基金经理、投资总监、投资决策委员会副主任委员	2013-7-17	-	12年	清华大学IMBA、CFA、12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、投资决策委员会委员、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。现任投资总监、投资决策委员会副主任委员、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方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。
朱晓栋(先生)	本基金基金经理	2013-7-17	-	4年	对外经济贸易大学经济学硕士,4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。现任东方精选混合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、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理。

注:①此处的任职日期和离任日期均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

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、《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,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中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

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。

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

6月底钱荒之后,央行的逆回购操作使得市场流动性开始恢复至正常水平。同时,随着短期库存周期进入补库存阶段、外围经济回暖带动出口回升、叠加7月稳增长政策开始发酵,经济基本面在三季度出现了一些积极的现象,中采PMI指数连续3个月逐步提升。此外,从上海自贸区的批复到温州土改、新一轮改革政策在三中全会前的密集推出,激发了市场的做多热情,导致三季度市场整体表现较为抢眼。

由于本基金在报告期内仍属于建仓期,且本基金以绝对收益为目标,因此本基金采取了积累安全垫,稳步建仓的策略,但这也导致了基金业绩低于指数涨幅。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年7月17日至9月30日,本基金净值增长率为0.60%,业绩比较基准收益率为0.99%,低于业绩比较基准0.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中采PMI9月回升幅度低于历史