东方央视财经50指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2013年第2号)

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

日　期：二〇一四年一月

重要提示

东方央视财经50指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2012年10月10日中国证券监督管理委员会《关于核准东方央视财经50指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1344号)和2012年11月9日《关于东方央视财经50指数增强型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2012]1034号)的核准,进行募集。本基金基金合同于2012年12月19日正式生效。

东方基金管理有限责任公司(以下简称"本基金管理人"、"管理人"或"本公司")保证《东方央视财经50指数增强型证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书"或"本招募说明书")的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特有风险,等等。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

有关财务数据和净值表现截止日为2013年9月30日(财务数据未经审计),本招募说明书其他所载内容截止日为2013年12月19日。

本摘要根据本基金合同和本基金《招募说明书》编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金合同。

一、基金合同生效日期

2012年12月19日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:东方基金管理有限责任公司

住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人:崔伟

成立日期:2004年6月11日

注册资本:贰亿元人民币

经营范围:基金募集;基金销售;资产管理;中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2004】80号

基金管理公司法人许可证编号:A039

企业法人营业执照注册号:1100001704226

联系人:李景岩

电话:010-66295888

股权结构:

股东名称	出资金额(人民币)	出资比例
东北证券股份有限公司	12,800万元	64%
河北省国有资产控股运营有限公司	5,400万元	27%
渤海国际信托有限公司	1,800万元	9%
合　计	20,000万元	100%

内部组织结构:

股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会,董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会;公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制,下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、风险管理部、监察稽核部、财务部、信息技术部、登记清算部、权益投资部、固定收益部、交易部、专户业务部、指数与量化投资部、公募业务部十四个职能部门及上海分公司、北京分公司、广州分公司;公司设督察长,分管风险管理部、监察稽核部,负责组织指导公司的风险管理和监察稽核工作。

(二)基金管理人主要人员情况

1.董事会成员

崔伟先生,董事长,经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书,中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长,中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员,中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长,中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记,中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人;现任东方基金管理有限责任公司董事长,兼任东北证券股份有限公司副董事长、吉林大学商学院教师、中国证券投资基金业协会理事、东方汇智资产管理有限公司董事长。

杨树财先生,董事,硕士,中国注册会计师,高级会计师。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师,吉林会计师事务所副所长,东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监,东方基金管理有限责任公司董事长;现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长,兼任中国证券业协会创新发展战略委员会副主任委员,吉林省高级专业技术资格评审委员会评委。

何俊岩先生,董事,硕士,高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师,吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长,东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理,福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监,东北证券有限责任公司财务部负责人、财务总监,东北证券股份有限公司副总裁兼财务总监,东方基金管理有限责任公司监事会主席;现任东北证券股份有限公司副总裁,兼任吉林省总会计师协会副会长、吉林省会计学会常务理事、吉林省金融学会理事、吉林省见义勇为基金会理事、吉林省消费者协会常务理事、吉林省青联委员、吉林大学研究生校外合作导师、东证融通投资管理有限公司董事。

郭兴哲先生,董事,硕士,高级经济师。历任唐山钢铁公司技术员、调度,河北省委科教部干部,河北省经济体制改革委员会干部,河北省体改委证管办副主任,河北省证券委员会国内业务处处长、综合处处长,中国证监会石家庄特派员办公室综合处调研员,河北证券有限责任公司总裁、顾问;现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁、党委常委,兼任河北国控化工有限公司党委书记、董事长;河北卓城企业管理服务有限公司董事、总经理。

彭铭巧女士,董事,经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司深圳营业部交易员、研究员,特区时空杂志社编辑,国泰君安证券公司海口营业部研究员,海航集团有限公司证券业务部研究室经理,海航集团财务有限公司投资银行部理财主管;现任渤海国际信托有限公司投资部总经理。

田瑞璋先生,独立董事,大学本科。历任中国北方工业(集团)总公司副总经理,中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员(副部级),中国工商银行党委副书记、副行长,中央金融工委委员(副部级),工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长;现任中国扶贫开发协会常务副会长(中组部任命、副部级),中国金融学会常务理事、中国城市金融学会顾问、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。

金硕先生,独立董事,教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授,长春税务学院党委书记、院长,长春市政协委员,吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任;现任吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士,独立董事,经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长;现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事。

孙晔伟先生,董事,经济学博士。历任吉林省社会科学院助理研究员,东北证券股份有限公司投资银行部经理,东方基金管理有限责任公司督察长,新华基金管理有限公司总经理助理,安信证券股份有限公司基金公司筹备组副组长,安信基金管理有限责任公司副总经理;现任东方基金管理有限责任公司总经理,兼任东方汇智资产管理有限公司董事。

2.监事会成员

赵振兵先生,监事会主席,本科,高级经济师。历任河北华联商厦部门助理、副经理、副总经理,河北省商贸集团经营二公司副总经理,河北省工贸资产经营有限公司改革发展处副处长,河北省国有资产控股运营有限公司企业管理部副部长、资产运营部部长;现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁、河北省国控矿业开发投资有限公司董事。

杨晓燕女士,监事,哲学硕士,金融学研究生,高级经济师。曾任职北京银行等金融机构,19年金融、证券从业经历;现任本公司监察稽核部经理。

肖向辉先生,监事,本科。曾任职北京市化学工业研究院、中国工商银行总行;现在本公司登记清算部任职。

3.高级管理人员

孙晔伟先生,总经理,简历请参见董事介绍。

王兴宇先生,副总经理,美国宾西法尼亚印第安那大学工商管理硕士、美国依阿华大学法律学硕士;具有7年基金从业经历和5年保险从业经历,曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部经理、董事会秘书,先后任职于博时基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、益民基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司,曾任市场部经理。

刘鸿鹏先生,副总经理,吉林大学行政管理硕士,具有21年证券从业经历。曾先后任吉林物贸股份有限公司投资顾问,君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员,吉林省信托证券部筹建负责人,新华证券股份有限公司长春同志街营业部副经理、经理,东北证券股份有限公司杭州营业部经理、营销管理总部副经理、经理。2011年5月加盟本公司,曾任总经理助理兼市场总监和市场部经理。

李景岩先生,督察长,硕士研究生,中国注册会计师。具有16年证券从业经历,曾任东北证券股份有限公司延吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004年6月加盟本公司,曾任财务主管、财务部经理、财务负责人,综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。4.本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
吴长凤(女士)	2012年12月19日至今	中国科学院数学与系统科学研究院应用数学研究所理学博士,北京大学光华管理学院金融工程工作站博士后,11年证券从业经历。曾任嘉实基金管理有限公司风险管理部高级经理,中国人寿富兰克林资产管理公司产品设计业务主管。2009年6月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任指数与量化投资部经理,现任东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

孙晔伟先生,总经理,投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍。

于鑫先生,投资总监,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、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理,投资决策委员会副主任委员。清华大学IMBA,CFA,12年证券从业经历。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、东方精选混合型开放式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。

张岗先生,权益投资部总经理,东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方保本混合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,投资决策委员会委员。西北大学经济学博士,11年证券从业经历。曾任健桥证券股份有限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。

王丹丹女士,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、东方稳健回报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,投资决策委员会委员。中国人民银行研究生部金融学硕士,7年证券从业经历。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。

呼振翼先生,东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员。对外经济贸易大学金融学硕士,17年期货和证券从业经历。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。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系

三、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:蒋超良

成立时间:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13号

组织形式:股份有限公司

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:《关于核准中国农业银行证券投资基金托管人资格的批复》,中国证监会证监基字【1998】23号

联系电话:010-63201510

传真:010-63201816

联系人:李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"'金牌理财'TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

(二)主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

(三)基金托管业务经营情况

截止2013年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共188只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金。

(四)基金托管人的内部控制制度

1.内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3.内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1.电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2.书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3.书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

四、相关服务机构

(一)直销机构:

名称:东方基金管理有限责任公司

住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人:崔伟

办公地址:北京市西城区锦什坊街28号3层

联系人:张婷

电话:010-66295921

传真:010-66578690

网站:www.orient-fund.com或www.df5888.com

(二)代销机构:

1.北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:闫冰竹

联系人:谢小华

电话:010-66223587

传真:010-66226045

客户服务电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

2.东莞银行股份有限公司

注册地址:东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址:东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人:廖玉林

联系人:陈幸

电话:0769-22119061

传真:0769-22117730

客户服务电话:4001196228(全国)、96228(广东省内)

网址:www.dongguanbank.cn

3.交通银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路188号

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:牛锡明

客户服务电话:95559或拨打各城市营业网点咨询电话

网址:www.95559.com.cn

4.中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心

法定代表人:王洪章

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

5.中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:蒋超良

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

6.中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号

法定代表人:李国华

联系人:王硕

传真:010-68858117

客户服务电话:95580

网址:www.psbc.com

7.中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:常振明

客户服务电话:95558

网址:bank.ecitic.com

8.安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人:牛冠兴

联系人:陈剑虹

电话:0755-82558305

传真:0755-82558355

客户服务电话:4008001001

网址:www.essence.com.cn

9.长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

客户服务电话:95579或4008-888-999

网址:www.95579.com

10.东北证券股份有限公司

住址:长春市自由大路1138号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

联系人:潘锴

电话:0431-85096709

客户服务电话:4006000686

网址:www.nesc.cn

11.东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

法定代表人:朱科敏

联系人:梁旭

电话:0519-50586660

传真:0519-88157761

客户服务电话:400-888-8588

网址:www.longone.com.cn

12.东莞证券有限责任公司

注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼

办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:张运勇

联系人:乔芳

电话:0769-22100155

客户服务电话:961130(省内直拨,省外请加拨区号0769)

网址:www.dgzq.com.cn

13.方正证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人:雷杰

联系人:郭军瑞

电　话:0731-85832503

传　真:0731-85832214

客户服务电话:95571

网址:www.foundersc.com

14.光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号3楼

法定代表人:袁长清(代行)

联系人:李芳芳

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务电话:95525

网址:www.ebscn.com

15.广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广州市天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42、43、44楼

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

电话:020-87555888

传真:020-87555305

客户服务电话:95575

网址:www.gf.com.cn

16.国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人:万建华

联系人:吴倩

电话:021-38676767

传真:021-38670767

客户服务电话:95521

网址:www.gtja.com

17.国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

联系人:齐晓燕

电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

18.国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路178号

办公地址:安徽省合肥市寿春路178号

法定代表人:蔡咏

联系人:祝丽萍

电话:0551-2257012

传真:0551-2272100

客户服务电话:95578

网址:www.gyzq.com.cn

19.海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市黄浦区广东路689号

法定代表人:王开国

联系人:李笑鸣

电话:021-23219275

传真:021-23219100

客户服务电话:021-95553、400-8888-001或拨打各城市营业网点咨询电话

网址:www.htsec.com

20.恒泰长财证券有限责任公司

注册地址:长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段

办公地址:长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段

法定代表人:赵培武

联系人:曲志诚

电话:0431-82945299

传真:0431-82946531

客户服务电话:0431-82951765

网址:www.cczq.net

21.恒泰证券股份有限公司

注册地址:内蒙古呼和浩特新城区新华东街111号

办公地址:内蒙古呼和浩特新城区新华东街111号

法定代表人:庞介民

联系人:孙伟

电　话:0471-4972042

传　真:0471-4961259

客户服务电话:0471-4961259

网　址:www.cnht.com.cn

22.华安证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人:李工

联系人:钱欢

电话:0551-5161666

传真:0551-5161600

网址:www.hazq.com

23.华福证券有限责任公司

注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

电话:0591-87383623

传真:0591-87383610

客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)

网址:www.hfzq.com.cn

24.华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市中山东路90号

办公地址:南京市中山东路90号

法定代表人:吴万善

联系人:程高峰

电话:025-84457777

传真:025-84579763

客户服务电话:95577

网址:www.htsc.com.cn

25.江海证券有限公司

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:张宇宏

电话:0451-82336863

传真:0451-82287211

客户服务电话:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

26.齐鲁证券有限公司

注册地址:济南市经七路86号

办公地址:济南市经七路86号23层

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

电话:0531-68889155

传真:0531-68889752

客户服务电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

27.山西证券股份有限公司

注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:侯巍

联系人:郭熠

电话:0351-8686659

传真:0351-8686619

客户服务电话:400-666-1618

网址:www.i618.com.cn

28.申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:储晓明

联系人:李清怡

电话:021-54041654

传真:021-54033888

客户服务电话:95523或4008895523

网址:www.sywg.com

29.五矿证券有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼

办公地址:深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼

法定代表人:张永衡

联系人:高克南

电话:0755-82545707

传真:0591-87383610

客户服务电话:40018-40028

网址:www.wkzq.com.cn

30.招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:林迎生

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636

客户服务电话:95565、4008888111

网址:www.newone.com.cn

31.中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈有安

联系人:田薇

电话:010-66568888

传真:010-66568990

客户服务电话:400-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn

32.中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:权唐

电话:010-85130588

传真:010-65182261

客户服务电话:400-8888-108

网址:www.csc108.com

33.中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)

法定代表人:杨宝林

联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客户服务电话:95548

网址:www.zxwt.com.cn

34.中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人:沈强

联系人:姚锋

电话:0571-86087713

传真:0571-85783771

客户服务电话:0571-95548

网址:www.bigsun.com.cn

35.中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京朝阳区亮马桥路48号

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-60838888

传真:010-60833799

客户服务电话:各地营业部咨询电话

网址:www.ecitic.com

(三)份额登记机构

名称:东方基金管理有限责任公司

住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人:崔伟

联系人:张婷

电话:010-66295879

传真:010-66578680

网址:www.orient-fund.com或www.df5888.com

(四)律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

联系人:吕红

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:吕红　黎明

(五)会计师事务所和经办注册会计师

名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层

办公地址:北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层

法定代表人:朱建弟

联系人:朱锦梅

电话:010-68286868

传真:010-88210608

经办注册会计师:朱锦梅、魏星

五、基金名称和基金类型

(一)本基金名称:东方央视财经50指数增强型证券投资基金

(二)本基金类型:指数增强型

基金运作方式:契约型开放式

六、基金的投资目标和投资方向

(一)投资目标

本基金为股票型指数增强基金,在对央视财经50指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长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0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增长,分享中国经济的持续、稳定增长的成果。

(二)投资理念

本基金认为,中国经济持续稳定的增长为中国证券市场的发展奠定了坚实的基础。本基金的投资管理遵循指数化的投资理念,可以获取指数所代表市场的平均收益,并通过充分的分散化投资实现非系统风险的有效降低和流动性的提高,为投资者谋求利益最大化。本基金以央视财经50指数为标的指数,在对其进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,在控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下争取较高的投资收益。

(三)投资范围

本基金的投资范围为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(包含中小板、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、资产支持证券以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)。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中央视财经50指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的80%,货币市场工具、债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占基金资产比例为5%-10%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,所投资的权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

七、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金采用自上而下的两层资产配置策略,首先确定基金资产在股票、现金和其它金融工具之间的配置比例,之后在对央视财经50指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,确定各股票资产的配置比例。在股票、现金和其他金融工具的大类资产配置方面,本基金将追求对股票的充分投资,股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于央视财经50指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的80%。

基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在发生巨额申购赎回、成份股大比例分红等情况下,管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后,及时将股票配置比例调整至合理水平。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内,年跟踪误差控制在7.75%以内。

2、股票投资策略

本基金采用"指数化被动投资为主、主动性增强投资为辅"的投资策略来构建股票投资组合,指数化投资部分运用被动投资策略,采用全复制的方法,对成份股及备选成份股进行配置。主动性增强投资部分依托本公司投研团队的研究成果构建增强股票组合,争取获得超额收益。

(1)指数化被动投资策略

指数化被动投资策略采取完全复制法进行投资,即按照央视财经50指数的成份股组成及权重构建股票投资组合,并根据央视财经50指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规和《基金合同》中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以力争实现本基金对央视财经50指数的有效跟踪。根据标的指数的编制原则与方法,本基金的股票投资组合的调整主要分为定期调整和临时调整。

①定期调整

根据央视财经50指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

②临时调整

当指数编制方法发生变更时,基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时进行投资组合调整;当指数成份股将临时调整时,基金管理人将预测指数成份股调整方案,并判断指数成份股调整对投资组合的影响,在此基础上确定组合调整策略;当上市公司发生股本变化、增发、配股、分红等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;根据法律法规的规定,成份股在央视财经50指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金投资组合中该成份股的权重同指数一致。

在建仓或投资组合调整过程中遇到基准指数成份股停牌、流动性不足、受法规限制本基金不得买入某成份股或其他市场因素使得本基金无法根据指数权重配置某成份股时,本基金将首选与该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代;若成份股中缺乏符合要求的替代品种,本基金将在成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

(2)主动性增强投资策略

①成份股增强策略

对于成份股,本基金主要采用多因子量化增强策略。主要方法为选取价值、成长、盈利、市场特征四大类因子,建立Alpha多因子模型。四大类因子各由一系列单因子组成,其中价值因子主要是指成份股的绝对和相对估值水平,包括市盈率、市净率、市销率、EV/EBITDA等指标;成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的历史增长和预测增长;盈利因子主要包括上市公司毛利率、净利润率、净资产收益率等指标的绝对和相对水平;市场特征因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票的规模因子以及其他风格因子。上述因子能够综合反映股票市场的诸多驱动因素,能够寻找较好的投资机会。

通过上述的多因子量化增强策略,本基金对央视财经50指数成份股进行综合评分,并根据评分结果,在严格控制跟踪误差的前提下,对央视财经50指数成份股进行权重优化,作为指数增强投资中的参考。

②非成份股增强策略

对于非成份股的选择,本基金主要采取定量分析与定性分析相结合的方法。其中定性分析主要是结合投研团队的研究成果,深入分析上市公司的资源优势、技术优势、品牌优势、渠道优势、运营管理优势,以及上市公司的核心竞争力作出分析,并对其未来的发展作出前瞻性的判断;定量分析主要是依托量化团队的分析结果,应用多因子量化增强策略。在此基础上适度投资于上述优选的非成份股上市公司股票,以期达到增强收益的目的。本基金还可投资预期将纳入指数的个股,以及新股发行、增发或配股在内的具有重大投资机会的股票,以增强基金的投资收益。

(3)精细化管理策略

①现金管理策略

由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,主要用于支付潜在赎回金额、计提管理费和托管费等各类费用、支付交易费用、应对上市公司配股和增发等行为。

为有效控制现金留存的影响,基金管理人将采用积极的现金头寸管理手段,合理的控制现金头寸。根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判,结合标的指数走势和成份股流动性进行合理的现金留存,最大限度降低现金的持有比例,降低现金拖累的影响。

②跟踪误差控制与管理

本基金对标的指数的跟踪目标是:力争控制本基金的净值增长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0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。每日对基金组合与业绩比较基准的收益率偏离度进行跟踪,每月末、季度末定期分析基金跟踪误差变化情况及其原因,并根据跟踪误差的来源和其可控制性,有针对性的进行管理和控制。

3、债券投资策略

本基金债券投资为在降低跟踪误差与控制流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的,在考虑流动性风险的前提下,构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择,同时着重考虑基金的流动性管理需要进行配置。

4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型,深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化,寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎投资,追求较稳定的当期收益。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:央视财经50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

由于本基金为增强型指数基金,在对央视财经50指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,在控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下争取较高的投资收益。因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果央视财经50指数被停止编制及发布,或央视财经50指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致央视财经50指数不宜继续作为本基金的标的指数及业绩比较基准或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,履行适当程序后变更本基金的标的指数和业绩比较基准,并于变更前2个工作日在指定媒体上予以公告,而无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

十、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本投资组合报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2013年9月30日(财务数据未经审计)。

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	59,689,054.85	92.27
	其中:股票	59,689,054.85	92.27
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,966,456.14	7.68
6	其他各项资产	32,029.52	0.05
7	合计	64,687,540.51	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)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的股票。

(2)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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,855,086.00	2.89
C	制造业	30,882,307.46	48.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,499,595.00	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	249,750.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,956,392.39	10.84
J	金融业	12,312,841.00	19.19
K	房地产业	2,559,139.00	3.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,263,935.00	3.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	61,320.00	0.10
S	综合	1,048,689.00	1.63
	合计	59,689,054.85	93.04

3 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

(1)期末指数投资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(%)
1	600016	民生银行	497,200	4,753,232.00	7.41
2	600887	伊利股份	83,300	3,721,844.00	5.80
3	002415	海康威视	136,200	3,595,680.00	5.60
4	600406	国电南瑞	235,893	3,408,653.85	5.31
5	601601	中国太保	180,300	3,167,871.00	4.94
6	000002	万　科A	280,300	2,559,139.00	3.99
7	000333	美的集团	54,781	2,368,730.44	3.69
8	300070	碧水源	54,200	2,205,940.00	3.44
9	600111	包钢稀土	76,600	2,160,120.00	3.37
10	600315	上海家化	48,300	2,096,703.00	3.27

(2)期末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的股票。

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 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。

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。

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。

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。

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。

10 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,182.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,075.84
5	应收申购款	7,770.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,029.52

(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)报告期末指数投资和积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

①期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

②期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金净值表现

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
2012.12.19-2012.12.31	0.14%	0.01%	6.66%	0.91%	-6.52%	-0.90%
2013.1.1-2013.6.30	-9.07%	1.10%	-3.58%	1.29%	-5.49%	-0.19%
2013.7.1-2013.9.30	7.17%	1.23%	9.29%	1.21%	-2.12%	0.02%

(二)自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:①根据《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合比例为:投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中央视财经50指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的80%,货币市场工具、债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占基金资产比例为5%-10%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,投资的权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。

②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。本基金合同生效日为2012年12月19日,截至报告日2013年9月30日,基金合同生效未满一年。

③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。

十二、费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、《基金合同》生效后与基金相关的标的指数使用许可费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、《基金合同》生效后与基金相关的标的指数使用许可费

本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。指数使用许可费费的计算方法如下:

一般计提方式为:

H=E×0.05%÷当年天数

其中:H为每日应付的指数使用许可费;

E为前一日的基金资产净值;

本基金合同生效之日所在季度,指数使用许可费按实际计提金额收取。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起,指数使用许可费收取下限为每季度5万元,即不足5万元时按照5万元收取。基金管理人可根据指数许可使用协议和基金份额持有人的利益,对上述计提方式进行合理变更并公告。

基金管理人可根据指数许可使用协议和基金份额持有人的利益,对上述计提方式进行合理变更并公告。

指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令,基金托管人复核后于次季初20个工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

上述"一、基金费用的种类中第4-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金合同生效后运作前产生的相关费用由管理人垫付,运作后由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于次日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(五)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(六)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十三、对招募说明书更新部分的说明

东方央视财经50指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)(2013年第2号)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新,主要内容如下:

(一)在"重要提示"中,更新了"招募说明书有关财务数据的截止日期"及"其他内容的截止日期"。

(二)在"二、释义"部分,对释义的相关内容进行了更新。

(三)在"三、基金管理人"部分,对基金管理人的相关内容进行了更新。

(四)在"四、基金托管人"部分,对基金托管人的相关内容进行了更新。

(五)在"五、相关服务机构"部分,更新了代销机构、份额登记机构的信息。

(六)在"七、基金份额的申购与赎回"部分,更新了"申购和赎回场所"、"基金转换"、"定期定额投资计划"等内容,并说明了开通定期定额投资和基金转换业务的代销机构。

(七)在"八、基金的投资"部分,更新了"基金投资组合报告"的内容,截止日期更新为2013年9月30日,该部分内容均按有关规定编制,并经本基金托管人复核,但未经审计。

(八)在"九、基金的业绩"部分,更新了"基金净值表现"和"自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图",该部分内容均按照有关规定编制,并经本基金托管人复核,但相关财务数据未经审计。

(九)在"二十、对基金份额持有人的服务"部分,更新了具体服务内容。

(十)在"二十一、其他应披露事项"部分,更新了从本基金基金合同生效日2013年6月19日至本次《招募说明书(更新)》截止日2013年12月19日之间的信息披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录东方基金管理有限责任公司网站www.orient-fund.com。

东方基金管理有限责任公司

2014年1月30日

东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2014年1月30日

1.公告基本信息

基金名称	东方精选混合型开放式证券投资基金	
基金简称	东方精选混合	
基金主代码	400003	
基金交易代码	400003(前端)	400004(后端)
基金管理人名称	东方基金管理有限责任公司	
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等	
基金经理变更类型	解聘基金经理	
共同管理本基金的其他基金经理姓名	呼振翼	
离任基金经理姓名	于鑫、朱晓栋	

2.离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	于鑫
离任原因	工作需要
离任日期	2014年1月30日
转任本公司其他工作岗位的说明	总经理助理,继续担任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
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是
离任基金经理姓名	朱晓栋
离任原因	工作需要
离任日期	2014年1月30日
转任本公司其他工作岗位的说明	东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理,继续担任东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

3.其他需要提示的事项

上述事项已按规定报中国证监会北京监管局备案。

特此公告。

东方基金管理有限责任公司

2014年1月30日

东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2014年1月30日

1.公告基本信息

基金名称	东方安心收益保本混合型证券投资基金
基金简称	东方安心收益保本
基金主代码	400020
基金管理人名称	东方基金管理有限责任公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等
基金经理变更类型	增聘基金经理
新任基金经理姓名	朱晓栋
共同管理本基金的其他基金经理姓名	张岗、王丹丹、姚航

2.新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	朱晓栋			
任职日期	2014年1月30日			
证券从业年限	5年			
证券投资管理从业年限	5年			
过往从业经历	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			
其中:管理过公募基金的名称及期间	基金主代码	基金名称	任职日期	离任日期
	400003	东方精选混合型开放式证券投资基金	2013年1月23日	2014年1月30日
	400022	东方利群混合型发起式证券投资基金	2013年7月17日	—
是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否			
是否已取得基金从业资格	是			
取得的其他相关从业资格	无			
国籍	中国			
学历、学位	硕士研究生			
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是			

3.其他需要提示的事项

上述事项已按规定报中国证监会北京监管局备案。

特此公告。

东方基金管理有限责任公司

2014年1月30日