东方利群混合型发起式证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月21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2014年4月15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2014年1月1日起至3月31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	394,429,815.23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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	3,697,944.96
2.本期利润	3,351,750.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	394,055,054.55
5.期末基金份额净值	0.9990

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

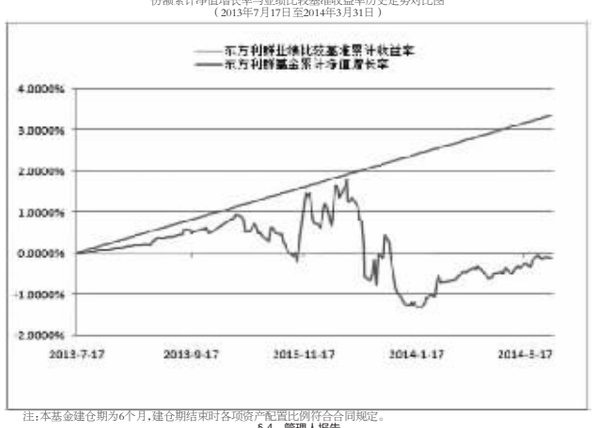
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.54%	0.15%	1.17%	0.02%	-1.71%	0.13%

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2014年3月31日)



注: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		
于鑫(先生)	本基金基金经理、总经理助理、投资决策委员会副主任委员	2013-7-17	-	13年	清华大学MBA,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、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、投资决策委员会副主任委员、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。
朱晓栋(先生)	本基金基金经理	2013-7-17	-	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。

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《证券从业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对投资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公平交易专项说明

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运作分析

报告期内,市场风格在短期内出现了剧烈波动,从1月的成长股上涨到2月的主题投资,再到3月的蓝筹股估值修复行情,市场经历了宽幅震荡的走势。

在报告期内,本基金以低风险投资为主,在流动性改善的背景之下,配置了较高比例的短期融资券;由于市场波动性加大以及申购摊薄,本基金的权益仓位出现了较大幅度的下降;从业绩表现来看,由于1月蓝筹股的下跌,本基金出现了一定程度的净值损失,导致本基金在报告期内未实现绝对收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

2014年1月1日至3月31日,本基金净值增长率为-0.54%,业绩比较基准收益率为1.17%,低于业绩比较基准1.71%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2014年一季度的经济运行的状况来看,债务风险、产能过剩、人口红利下降,以及政府主动的调结构行为,导致经济基本面面临较大的下行压力;但从近期政府的表态来看,决策层对经济下行还是有底限的;展望2季度,市场面临的仍然是一个震荡的经济环境,市场较难出现趋势性机会;而政府调控思路的转变以及各项改革措施的推进将在资本市场中得到体现,相关的受益标的将是未来较结构性行业的主要方向。

对于前期涨幅较大的板块与个股,随着进入新一轮业绩验证期,以及IPO发行量的增加,其估值将面临一定压力,需要甄选优质标的;而在改革的推进过程中,传统行业将迎来变革机遇,我们将积极在传统行业中寻找投资机会。

本基金将立足于基本面,兼顾业绩成长与估值的合理性,寻找符合本基金绝对回报策略的标的,争取为投资者创造持续稳定的投资回报。

§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	13,442,288.24	3.30
	其中:股票	13,442,288.24	3.30
2	固定收益投资	372,828,400.00	91.56
	其中:债券	372,828,400.00	91.56
	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	5,000,000.00	1.23
	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	8,544,364.47	2.10
7	其他资产	7,361,380.27	1.81
8	合计	407,176,432.98	100.00

5.2报告期末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	-	-
C	制造业	342,600.00	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	261,900.00	0.07
F	批发和零售业	547,200.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	383,000.00	0.10
K	房地产业	10,985,588.24	2.79
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	922,000.00	0.23
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,442,288.24	3.41

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

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	000002	万 科A	360,000	2,912,400.00	0.74
2	000926	福星股份	280,000	1,943,200.00	0.49
3	600266	北京城建	150,000	1,458,000.00	0.37
4	000918	嘉凯城	500,000	1,275,000.00	0.32
5	000069	华侨城A	200,000	922,000.00	0.23
6	600240	华业地产	150,000	685,500.00	0.17
7	000024	招商地产	31,484	593,788.24	0.15
8	600208	新湖中宝	200,000	592,000.00	0.15
9	600376	首开股份	100,000	490,000.00	0.12
10	000402	金 融 街	90,000	454,500.00	0.12

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,029,400.00	5.34
	其中:政策性金融债	21,029,400.00	5.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	351,799,000.00	89.28
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	372,828,400.00	94.61

5.5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	041351059	13康美CP002	500,000	50,460,000.00	12.81
2	041366013	13淮南矿业CP002	400,000	40,176,000.00	10.20
3	041356037	13滨建投CP001	400,000	40,156,000.00	10.19
4	041459007	14国电集CP001	400,000	40,060,000.00	10.17
5	041353080	13宁交建CP001	300,000	30,222,000.00	7.67

5.6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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,453.46
2	应收证券清算款	1,832.29
3	应收股利	-
4	应收利息	7,339,222.57
5	应收申购款	1,871.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,361,380.27

5.11.4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可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	76,170,759.44
报告期期间基金总申购份额	362,774,433.41
减:报告期期间基金总赎回份额	44,515,377.62
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	394,429,815.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,001,250.00	2.54%	10,001,250.00	2.54%	自合同生效之日起不少于3年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,250.00	2.54%	10,001,250.00	2.54%	

§8 备查文件目录

9.1备查文件目录

一、《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》

二、《东方利群混合型发起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

9.2存放地点:

上述各查文本存放在基金管理人办公场所。

9.3查阅方式

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
2014年4月21日

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月21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2014年4月15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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	400015
交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月28日
报告期末基金份额总额	74,998,284.84份
投资目标	通过积极主动的投资管理,精选受益于经济转型下产业结构调整方向的、具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票;努力把握市场趋势,积极进行适当范围内的大类资产配置调整,在严格控制风险的前提下,谋求本基金资产的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
业绩比较基准	本基金采用"中证700指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%"作为投资业绩比较基准。 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数或债券指数时,本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金为混合型基金,股票部分主要投资于具有高成长潜力的中小市值上市公司股票,属于证券投资基金中预期风险和预期收益为中高风险等级的品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	2,146,456.04
2.本期利润	-2,533,211.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0452
4.期末基金资产净值	104,080,719.43
5.期末基金份额净值	1.3878

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	-0.77%	1.24%	-0.99%	0.83%	0.22%	0.41%

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

(2011年12月28日至2014年3月31日)

注: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		
呼振翼(先生)	本基金基金经理、投资决策委员会委员	2011-12-28	-	18年	对外经济贸易大学经济学硕士,18年证券从业经历,曾任高斯达期货公司投资经理,金鹏期货公司投资经理,海闻证券研究员,湘财证券研究员,投资理财部经理,民生证券研究员,行业组组长。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部研究员、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理,现任投资决策委员会委员、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理。

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《证券从业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对投资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。

4.3公平交易专项说明

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运作分析

报告期内,本基金持仓变化不大,以军工类公司、信息服务、医药、技术升级类等成长类公司为主。

从业绩表现看,前两个月取得较好的收益,并减持了部分品种,重仓股变化不大。在三月以成长风格为主的公司普遍下跌下,收益回落,但是整体看,符合我们的想法。

4.5报告期内基金的业绩表现

2014年1月1日至3月31日,本基金净值增长率为-0.77%,业绩比较基准收益率为-0.99%,高于业绩比较基准0.22%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在这个阶段我觉得主要考虑两个问题:长期的想法、短期对于低估值与成长的对待。

以3年左右的时间看,过去两年的新行业成长股,仍是最大概率的变化行业,未来的主要机会也在于此。如何看待半年左右的中短期呢?从这个位置向后看,哪些是给我们带来巨大回报的呢?回到过去两年或者五年的角度看,那些带来长期回报的公司,他们的逻辑是否变化,或者在未来这样的逻辑哪些行业将得到复制?而在目前这个位置上,向后看相对长一点的时间,哪些行业的变化更大一些,数据更有逻辑性呢?

在目前阶段,对于低估值行业可能的巨大变化因素来自于自身改革,而非行业因素。单纯从基本面来看,目前的多数低估值行业中期机会缺乏基本面的支持,比如至少要看到数据的拐点,或者预期拐点。从目前多数低估值行业来说,他们的问题主要在于搞清楚中长期逻辑的清晰性。之后他们低估值才会有大回报的机会;成长行业中长期逻辑目前看是顺的,而目前的困境在于两年的涨幅,这需要时间的消化,风险在于公司本身经营的能力。

大的操作思路上,精选和增长的策略主要还是以成长行业为中心,等待关注的成长股,然后关注季报和全年预期;1-2个月内的预判看,对于个人风格最大的风险就是大型股涨幅较小;可比的情况看,如果糟糕的话,可能类似于2012年四季度的情况,那时候大型股幅度小,成长股受冲击;从最终结果上,还是看个股基本面情况;从长期看,行业公司基本面好的都还是牛股。

预计转型和新的行业这两块仍是市场主要关注点。我们关注的行业仍将主要集中在医药、科技、以及除了酒以外的消费品。主题上关注军工、国企改革。

§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	65,615,448.24	62.69
	其中:股票	65,615,448.24	62.69
2	固定收益投资	24,607,600.00	23.51
	其中:债券	24,607,600.00	23.51
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,824,065.86	13.21
7	其他资产	617,180.44	0.59
8	合计	104,664,294.54	100.00

5.2报告期末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	952,500.00	0.92
C	制造业	34,309,661.29	32.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,309,600.00	2.22
E	建筑业	5,787,000.00	5.56
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,230,100.00	13.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,565,986.95	1.50
L	租赁和商务服务业	3,827,500.00	3.68
M	科学研究和技术服务业	1,572,300.00	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,060,800.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	65,615,448.24	63.04

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

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	600570	恒生电子	280,000	6,011,600.00	5.78
2	300024	机器人	128,821	5,887,119.70	5.66
3	300124	汇川技术	70,000	4,972,100.00	4.78
4	002375	亚厦股份	200,000	4,884,000.00	4.69
5	300170	汉得信息	240,000	4,872,000.00	4.68
6	002421	达实智能	150,000	3,346,500.00	3.22
7	000915	山大华特	110,000	2,985,400.00	2.87
8	300298	三诺生物	40,000	2,600,000.00	2.50
9	601888	中国国旅	70,000	2,327,500.00	2.24
10	300252	金信诺	122,786	2,318,199.68	2.23

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,994,500.00	4.80
	其中:政策性金融债	4,994,500.00	4.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,042,500.00	9.65
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,570,600.00	9.20
8	其他	-	-
9	合计	24,607,600.00	23.64

5.5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	041358056	13獐子岛CP001	50,000	5,040,000.00	4.84
2	041456004	14美克CP001	50,000	5,002,500.00	4.81
3	130236	13国开36	50,000	4,994,500.00	4.80
4	113003	重工转债	40,000	4,186,400.00	4.02
5	110023	民生转债	30,000	2,655,300.00	2.55

5.6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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	108,239.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	369,981.35
5	应收申购款	138,959.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	617,180.44

5.11.4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(%)
1	113003	重工转债	4,186,400.00	4.02
2	110023	民生转债	2,655,300.00	2.55
3	110020	南山转债	1,797,600.00	1.73
4	125089	深机转债	931,300.00	0.89

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600570	恒生电子	6,011,600.00	5.78	控股股东筹划重大战略事宜停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	53,171,623.96
报告期期间基金总申购份额	38,005,790.38
减:报告期期间基金总赎回份额	16,179,129.50
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	74,998,284.84

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

一、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金托管协议》

三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程

四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

8.2存放地点:

上述各查文本存放在基金管理人办公场所。

8.3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
2014年4月21日

东方央视财经50指数增强型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月21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2014年4月15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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方央视财经50指数
基金主代码	400018
交易代码	400018