东方策略成长股票型开放式证券投资基金

2014 第二季度 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7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月14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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方策略成长股票	
基金主代码	400007	
交易代码	400007(前端)	400008(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年6月3日	
报告期末基金份额总额	44,911,738.39份	
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/或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300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300指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30% 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3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	

§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4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	361,241.64
2.本期利润	2,578,543.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0547
4.期末基金资产净值	61,158,262.11
5.期末基金份额净值	1.3617

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

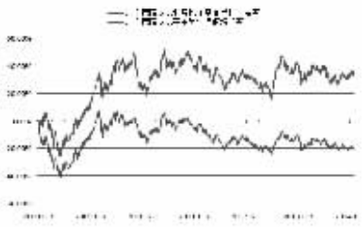
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.23%	0.60%	1.48%	0.60%	2.75%	0.00%

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

东方策略成长股票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

(2008年6月3日至2014年6月30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、投资决策委员会委员	2008-6-3	-	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。

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管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《东方策略成长股票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

2014年二季度,本基金继续持有估值低、业绩优良、成长确定的绩优公司,适当调整持仓结构,保持较低的仓位。

报告期内,本基金的持仓依然以保险、地产、食品饮料、银行等低估值行业的龙头公司为主,但减持了部分银行、地产、保险行业的股票,增持了一些估值合理的小盘股。五月份,本基金逐步降低了仓位,市场下跌后,本基金又小幅提升了股票仓位。

本季度,本基金业绩表现尚可,收益好于沪深300指数。

4.5报告期内基金的业绩表现

2014年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为4.23%,业绩比较基准收益率为1.48%,高于业绩比较基准2.75%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为二季度将是今年经济最困难的时候,中国经济下半年会逐渐好起来。资金成本已开始下行,政府稳增长的措施也在不断推进,经济有望见底回升。可能的风险是商品住宅的销售下滑幅度超过预期。

就证券市场而言,市场可能先跌后涨。资金供给的不足叠加中报的不达预期,市场可能先下跌;当经济数据好转后,低估值的股票会有积极的表现。

从行业层面上,目前许多低估值的行业,如金融服务、房地产、汽车、零售、家电、石化、医药、食品饮料等已具备了很好的投资价值,能够有绝对收益,是本基金投资的重点;本基金将逐步提升仓位,力争为基金持有人实现绝对收益。

§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	42,281,426.52	68.62
	其中:股票	42,281,426.52	68.62
2	固定收益投资	13,448,112.00	21.83
	其中:债券	13,448,112.00	21.83
	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	3,200,000.00	5.19
	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	1,055,096.11	1.71
7	其他资产	1,631,449.57	2.65
8	合计	61,616,084.20	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	851,000.00	1.39
C	制造业	13,791,083.60	22.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,554,830.00	4.18
F	批发和零售业	2,128,977.12	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,094,577.80	1.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	687,790.00	1.12
J	金融业	10,409,180.00	17.02
K	房地产业	8,913,050.00	14.57
L	租赁和商务服务业	1,097,400.00	1.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	750,650.00	1.23
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	2,888.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	42,281,426.52	69.13

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	601318	中国平安	95,000	3,737,300.00	6.11
2	601668	中国建筑	900,000	2,538,000.00	4.15
3	601166	兴业银行	230,000	2,306,900.00	3.77
4	600036	招商银行	180,000	1,843,200.00	3.01
5	000858	五粮液	100,000	1,793,000.00	2.93
6	000001	平安银行	150,000	1,486,500.00	2.43
7	600240	华业地产	290,000	1,415,200.00	2.31
8	000002	万科A	170,000	1,405,900.00	2.30
9	000423	东阿阿胶	40,000	1,332,800.00	2.18
10	000718	苏宁环球	270,000	1,217,700.00	1.99

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	3,000,600.00	4.91
	其中:政策性金融债	3,000,600.00	4.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,119,000.00	16.55
6	中期票据	-	-
7	可转债	328,512.00	0.54
8	其他	-	-
9	合计	13,448,112.00	21.99

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	041356045	13湘冶江CP003	100,000	10,119,000.00	16.55
2	130236	13国开36	30,000	3,000,600.00	4.91
3	110023	民生转债	3,540	328,512.00	0.54
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,904.43
2	应收证券清算款	1,201,243.06
3	应收股利	-
4	应收利息	400,542.87
5	应收申购款	11,759.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,631,449.57

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	110023	民生转债	328,512.00	0.54

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存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	47,427,472.10
报告期间基金总申购份额	3,180,146.87
减:报告期期间基金总赎回份额	5,695,880.58
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	44,911,738.39

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,001,722.50
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,001,722.50
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	20.04

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、《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方策略成长股票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:

上述备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7月18日

东方精选混合型开放式证券投资基金

2014 第二季度 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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月14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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方精选混合	
基金主代码	400003	
交易代码	400003(前端)	400004(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年1月11日	
报告期末基金份额总额	4,305,038,224.18份	
投资目标	深入研究中国经济高速增长的根本动力,重点投资于高速成长的优质上市公司,努力使基金份额持有人最大限度的分享中国经济的高速增长。	
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的大类资产配置和自下而上的精选个股(包括债券)、行业优化组成。	
业绩比较基准	根据本基金的特征,选择中信标普300成长指数作为本基金股票部分的业绩比较基准,选择中信标普全债指数作为债券及货币市场工具的比较基准。 对于权重配置,作为一只混合型基金,股票最低仓位为30%,最高为95%,一般情况下为60%,因此本基金的业绩比较基准为:本基金业绩比较基准=中信标普300成长指数*60% + 中信标普全债指数*40% 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,本基金可以变更业绩比较基准。	
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。	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	

§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4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-25,181,829.05
2.本期利润	413,023,335.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0929
4.期末基金资产净值	4,666,775,983.35
5.期末基金份额净值	1.0840

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本基金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

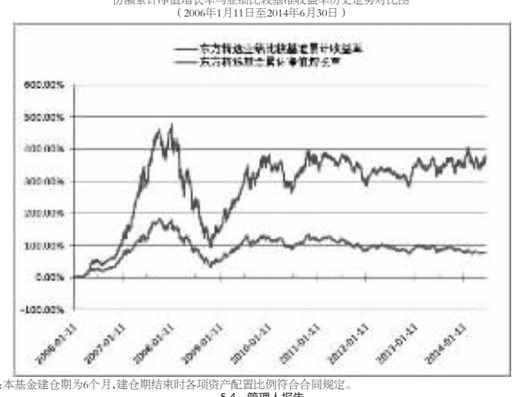
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.38%	1.03%	1.38%	0.53%	8.00%	0.50%

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

东方精选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

(2006年1月11日至2014年6月30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	2013-1-4	-	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的说明

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、《东方精选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,主要以军工类公司和信息服务、医药,技术升级类等成长类公司为主。

从业绩表现看,本基金在前两个季度取得较好的收益,减持了部分涨幅较大品种,重仓股变化不大,收益4%。整体来说,该业绩表现符合我们的想法。

4.5报告期内基金的业绩表现

2014年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为9.38%,业绩比较基准收益率为1.38%,高于业绩比较基准8.00%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济仍处在不温不火的状态中,转型和增长的方向看,增长的尺度可能性在加大,但主体方向仍是转型。市场方面,上半年投资机会好的仍是转型公司,具体的主要集中在主题类,因业绩因素不明显,即使在成长类公司中,分化也很大,所以着重关注行业趋势。无论是军工还是信息安全,整体上更多的是行业格局发生变化,当然这种格局可以有未来3年左右增长的预期,但短期业绩多数不具备持续增长能力。其中业绩增长明确而且速度快的相关标的是值得投资的。而传统产业目前基本面还在等待,地产来自于理论界和实业的声音使我们看到的现象更多的是分歧:有人看好,有人看坏。作为股市上的投资者,我们并不需要对未来结果做一个准确的预测,但可以做一个非负的判断:目前地产的基本面至少不是上行的,还需要时间,不必把自己陷入到一个非好即坏的纠结中去,对于传统行业投资者,等待和观察也许是更好的方式。

展望下半年,对市场方面的判断偏谨慎,传统行业缺乏机会,新兴行业涨幅过大,需要去伪存真。主题思路可维持市场活跃,但不会形成全面的市场机会,策略上,我们在三季度会保持对市场谨慎的态度。长期看,上涨的机会中还是来自于新兴产业的机会更多,他们的行业基本面更好,但这个机会的合力还需要时间积累。时间上,今年临到明年初,孕育着全面的机会,大的投资方向还是以信息服务,消费,高端制造为核心。

§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	4,098,645,983.88	86.41
	其中:股票	4,098,645,983.88	86.41
2	固定收益投资	541,460,750.00	11.42
	其中:债券	541,460,750.00	11.42
	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	73,127,709.41	1.54
7	其他资产	29,946,631.48	0.63
8	合计	4,743,181,074.77	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	24,580,356.20	0.53
C	制造业	2,214,244,070.71	47.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	127,600,464.24	2.73
E	建筑业	413,322,542.64	8.86
F	批发和零售业	943,519.20	0.02
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	843,850,712.27	18.08
J	金融业	65,570,880.78	1.41
K	房地产业	105,189,495.60	2.25
L	租赁和商务服务业	193,533,708.08	4.15
M	科学研究和技术服务业	103,819,634.16	2.22
N	水利、环境和公共设施管理业	567,600.00	0.01
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	5,423,000.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	4,098,645,983.88	87.83

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	15,292,529	449,600,352.60	9.63
2	300024	机器人	13,967,680	410,649,792.00	8.80
3	300170	汉得信息	23,186,339	299,103,773.10	6.41
4	002375	亚厦股份	12,686,617	286,210,079.52	6.13
5	300124	汇川技术	7,094,698	221,354,577.60	4.74
6	000915	山大华特	7,884,230	210,666,625.60	4.51
7	600372	中航电子	8,834,787	200,284,621.29	4.29
8	601888	中国国旅	5,825,427	192,472,108.08	4.12
9	600276	恒瑞医药	5,719,723	189,666,014.68	4.06
10	300252	金信诺	5,487,236	149,966,159.88	3.21

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	416,544,750.00	8.93
	其中:政策性金融债	416,544,750.00	8.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	124,916,000.00	2.68
8	其他	-	-
9	合计	541,460,750.00	11.60

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	113003	重工转债	1,100,000	124,916,000.00	2.68
2	140437	14农发37	1,000,000	99,870,000.00	2.14
3	120309	12进出09	1,000,000	97,190,000.00	2.08
4	140204	14国开04	515,000	51,731,750.00	1.11
5	140430	14农发30	500,000	50,175,000.00	1.08

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,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,026,655.05
2	应收证券清算款	19,799,137.56
3	应收股利	-
4	应收利息	7,759,955.09
5	应收申购款	360,883.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,946,631.48

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	124,916,000.00	2.68

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存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,679,659,770.03
报告期期间基金总申购份额	70,062,948.77
减:报告期期间基金总赎回份额	444,684,494.62
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	4,305,038,224.18

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	302,424.23
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	302,424.23
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.01

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、《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方精选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

8.2存放地点:

上述备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7月18日

东方金账簿货币市场证券投资基金

2014 第二季度 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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月14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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方金账簿货币
基金主代码	400005
交易代码	400005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月2日
报告期末基金份额总额	1,310,683,845.69份
投资目标	在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金以价值分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,把握宏观经济走向与微观经济脉搏,通过以剩余期限为核心的资产配置,充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行税后活期利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	23,672,200.99
2.本期利润	23,672,200.99
3.