东方安心收益保本混合型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12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1月22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1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2013年10月1日起至12月31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	159,958,961.82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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	1,845,571.56
2.本期利润	1,480,289.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0089
4.期末基金资产净值	162,602,934.80
5.期末基金份额净值	1.0165

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

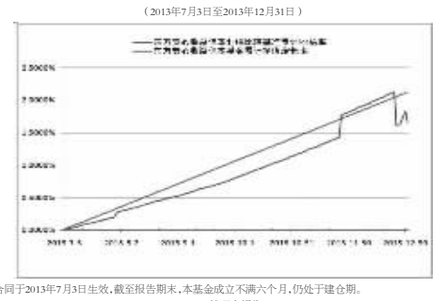
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.85%	0.09%	1.07%	0.01%	-0.22%	0.08%

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12月31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。
徐昀君 (先生)	本基金经理	2013-12-24	-	5年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,5年证券从业经历,曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资主办人,2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理,现任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,美国实际GDP增速、11月工业产出和新屋开工等数据均远超市场预期,进一步巩固了美国经济持续复苏的趋势。美联储12月17-18日货币会议正式启动QE缩减策略;国内方面,中央经济工作会议召开,会议继续明确了"稳增长"的政策基调。审计署也发布了《全国政府性债务审计结果》,结果表明地方政府性债务总量安全,系统性危机可控。宏观经济方面,基建与房地产投资增速走低,资金价格也在年末出现了又一波明显的上升。这给短期经济增长势头带来了负面压力。总体来看,国内增长动能正在部分地从"稳增长"政策转向外需。不过,目前外需尚无法完全对冲国内"稳增长"政策后撤所造成的影响,经济增速因而在短期内小幅减速。

四季度,债券市场依然延续三季度的调整局面。在资金面超预期紧张的推动下,所有期限、品种的债券收益率均不断创出新高。10年期国债一度达到4.7%左右,中低等级信用债收益率也普遍高于8%。

报告期内,本基金进行了大量的回业存款和逆回购操作,成功的规避了四季度的市场调整。同时在优选发债主体资质的前提下,购买了少量债券。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年10月1日至12月31日,本基金净值增长率为0.85%,业绩比较基准收益率为1.07%,低于业绩比较基准0.22%。

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2014年1季度,国际方面,美国等发达国家经济继续温和复苏的态势已日趋明朗,但复苏动能仍高度依赖于宽松的政策环境。美国 QE 退出可能对欧美经济复苏产生负面影响;国内方面,经济增长底线逐渐明确,明年经济下行风险降低。宏观经济将在国内外双方的带动下,步入温和复苏的通道。

未来一季度,本基金将继续以存款和逆回购为主,赚取稳定收益。等待市场明确钝化后,再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	29,645,000.00	18.10
	其中:债券	29,645,000.00	18.10
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	45,000,000.00	27.47
	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	88,696,645.41	54.14
6	其他资产	477,450.99	0.29
7	合计	163,819,096.40	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	29,645,000.00	18.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	29,645,000.00	18.23

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	124368	13郑交投	100,000	10,000,000.00	6.15
1	124401	13冀广网	100,000	10,000,000.00	6.15
3	124398	13株城发	100,000	9,645,000.00	5.93
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范围。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,550.96
2	应收证券清算款	5,561.11
3	应收股利	-
4	应收利息	469,338.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	477,450.99

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处于转股期的可转换债券。

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

本报告期期初基金份额总额	174,536,833.11
本报告期基金总申购份额	276,032.17
减:本报告期基金总赎回份额	14,853,903.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	159,958,961.82

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1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

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1月22日

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12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1月22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1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2013年10月1日起至12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	53,171,623.96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(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	1,541,847.45
2.本期利润	137,508.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0024
4.期末基金资产净值	74,360,172.71
5.期末基金份额净值	1.3985

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

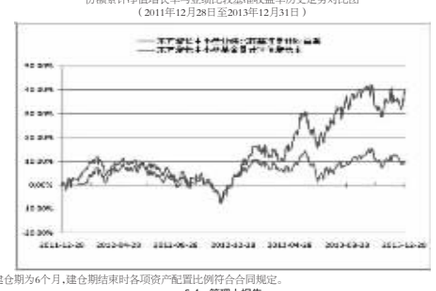
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.42%	1.32%	-1.58%	0.81%	2.00%	0.51%

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2013年12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	-	17年	对外经济贸易大学经济学硕士,17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。

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

报告期内,本基金以信息服务、医药、技术升级类等成长类公司为主,以及军工类公司。仓位维持在70%左右。

从投资品种看,业绩增长突出的公司为主,4季度基金净值上涨0.4%,战胜多数指数,在期间,医药和军工贡献较大。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年10月1日至12月31日,本基金净值增长率为0.42%,业绩比较基准收益率为-1.58%,高于业绩比较基准2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年一季度,我们认为大的宏观背景上,难有大的变化,稳定是主要的宏观词,周期行业盈利有见底可能,但长期的行业盈利趋势很难看到。

预计转型和新的行业仍是市场主要关注点,我们仍将主要集中在医药,科技,除了酒以外的消费品,主题上关注军工,国企改革。整体市场看,市场在为未来的牛市做准备,市场离牛市并不远了,这两年的成长行业依然是未来牛市的主要机会,他们是未来牛市新的五朵金花,但2014年看,我们持相对谨慎的看法,周期类行业盈利上的趋势机会很难看到,这压制了市场的上升空间,而成长类公司在经历两年的上涨后,积累了巨大的涨幅,有部分公司业绩匹配需要确认,因此我们认为2014年会是继续分化的一年,不仅仅是行业的分化,更是公司的分化,好公司,业绩超预期的公司仍会是市场的首选。主题类机会是2014年值得关注的机会,我们相对看好军工,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	56,597,441.88	73.99
	其中:股票	56,597,441.88	73.99
2	固定收益投资	14,688,160.00	19.20
	其中:债券	14,688,160.00	19.20
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,500,000.00	1.96
	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	3,415,265.28	4.46
6	其他资产	296,730.95	0.39
7	合计	76,497,598.11	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	37,624,054.12	50.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,236,000.00	1.66
E	建筑业	2,064,000.00	2.78
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	8,919,400.00	11.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,301,787.76	3.10
L	租赁和商务服务业	2,443,000.00	3.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,731,000.00	2.33
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	278,200.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	56,597,441.88	76.11

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	5,840,800.00	7.85
2	300124	汇川技术	70,000	4,094,300.00	5.51
3	300024	机器人	77,824	3,790,028.80	5.10
4	000915	山大华特	110,000	3,378,100.00	4.54
5	600690	青岛海尔	149,974	2,924,493.00	3.93
6	300298	三诺生物	40,000	2,754,400.00	3.70
7	601888	中国国旅	70,000	2,443,000.00	3.29
8	600372	中航电子	99,925	2,384,210.50	3.21
9	300170	汉得信息	150,000	2,283,000.00	3.07
10	300252	金信诺	122,786	2,212,603.72	2.98

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	4,965,500.00	6.68
	其中:政策性金融债	4,965,500.00	6.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,722,660.00	13.08
8	其他	-	-
9	合计	14,688,160.00	19.75

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	130236	13国开36	50,000	4,965,500.00	6.68
2	113003	重工转债	30,000	3,495,900.00	4.70
3	110023	民生转债	30,000	2,895,900.00	3.89
4	113001	中行转债	20,000	1,926,600.00	2.59
5	128002	东华转债	10,000	1,404,260.00	1.89

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范围。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	123,136.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	109,368.19
5	应收申购款	64,226.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	296,730.95

5.10.4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	3,495,900.00	4.70
2	113001	中行转债	1,926,600.00	2.59
3	110023	民生转债	2,895,900.00	3.89

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

§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	60,349,024.20
本报告期基金总申购份额	12,175,754.52
减:本报告期基金总赎回份额	19,353,154.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	53,171,623.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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1月22日

东方央视财经50指数增强型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12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1月22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1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2013年10月1日起至12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
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月19日
报告期末基金份额总额	60,236,938.95份
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值,分享中国经济的持续、稳定增长的成果。
投资策略	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%。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;主动性增强部分主要采取定量分析与定性分析相结合的方法,对央视财经50指数成份股进行权重优化,适度投资于优选的非成份股上市公司股票。
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% 。
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。
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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-411,350.50
2.本期利润	-1,106,148.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0177
4.期末基金资产净值	57,638,319.88
5.期末基金份额净值	0.9569

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

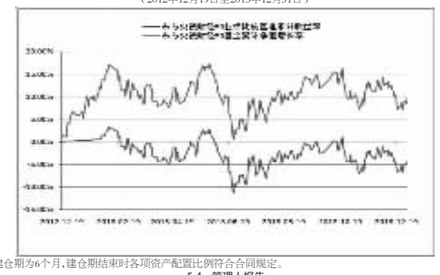
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.95%	1.09%	-2.51%	1.09%	0.56%	0.00%

3.2.2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

东方央视财经50指数增强型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年12月19日至2013年12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		
吴长凤 (女士)	本基金基金经理	2012-12-19	-	11年	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。

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 管理人对报告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、《东方央视财经50指数增强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