

## 东方龙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:东方基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2014年1月22日

## §1 重要提示

基金管理人的董事及董事会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。

基金托管人和报告编制部门的高级管理人员根据法律法规规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现

和投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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请仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效后6个月内基金净值增长率必须达到80%以上，否则基金合同将不生效。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

## §2 基金产品概况

本基金名称 东方龙混合

基金代码 400001

交易代码 400001

基金合同生效日 2000年11月25日

报告期末基金份额总额 1,973,13,329.81份

投资目标 分析中国经济和资本市场的高速增长，努力为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本回报。

投资策略 本基金的投资策略以中长期投资为主，投资于股票、债券、货币市场工具等金融资产，其中股票投资比例为30%~80%，债券投资比例为20%~70%，货币市场工具投资比例为0~10%。

业绩比较基准 本基金整体业绩基准=中长期国债+30%+中长期普300

估值方法 本基金的估值方法与股票型基金的估值方法一致。

如果今后法律法规发生变化，或者更有权的，更能体现市场特征的业绩基准被采用，基金管理人可以调整基金的业绩基准，报中国证监会备案后，本基金的业绩基准将按新的业绩基准进行调整。

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股票型基金和债券型基金之间，同时其长期平均收益预期将高于货币型基金和债券型基金。

基金管理人 东方基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

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 -12,735,074.22

2.本期利润 -35,647,397.89

3.加权平均基金份额本期利润 0.0181

4.期末基金份额净值 1,331,679,773.33

5.期末基金份额净值 0.6747

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.所列财务指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用影响实际收益水平将低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1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

3.2.2本基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

东方龙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

(2013年10月1日至2013年12月31日)

3.3报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601318 中信国安 2,300,000 95,979,000 7.21

2 000002 万科A 9,500,000 76,285,000 5.73

3 600036 招商银行 4,500,000 49,005,000 3.68

4 600016 民生银行 4,800,000 37,056,000 2.78

5 600266 北京城建 3,802,420 36,807,425.60 2.76

6 600383 金地集团 5,000,000 33,400,000 2.51

7 600019 贵州茅台 190,000 24,392,200 1.83

8 601601 中国人寿 1,300,000 24,089,000 1.81

9 600048 万科企业 2,600,000 21,450,000 1.61

10 000918 贵阳银行 7,690,749 21,380,282.22 1.61

3.4报告期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 国家债券 - - -

2 中行票据 - - -

3 金融债券 - - -

4 企业债券 - - -

5 其他债券 - - -

6 合计 113,000 58,980,000 4.43

3.5报告期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 601326 中国平安 620,000 61,572,200 4.62

2 300312 三联虹普 600,000 392,120 3.16

3 113006 平安银行 300,000 29,448,000 2.21

4 110221 民生银行 48,670 4,698,115.10 0.35

5 110023 中国人寿 11,000 1,000 0.03

6 合计 28,162,347.44

3.6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 131036 13国债36 620,000 61,160,000 4.64

2 130312 13国开12 600,000 58,980,000 4.43

3 113006 平安银行 392,120 32,054,870 2.31

4 110221 11国债21 300,000 29,448,000 2.21

5 110023 民生银行 48,670 4,698,115.10 0.35

6 合计 196,753,185.10 14.77

3.7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 601326 中国平安 620,000 61,572,200 4.62

2 300312 三联虹普 600,000 394,988.98 3.16

3 600036 招商银行 4,500,000 49,005,000 3.68

4 601318 中信国安 1,000 1,822,941.50 0.13

5 600002 万科A 732,566.92 0.54

6 合计 28,162,347.44

3.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 500ETF 1,000 1,000 0.01

2 000002 500ETF 1,000 1,000 0.01

3 000003 500ETF 1,000 1,000 0.01

4 000004 500ETF 1,000 1,000 0.01

5 000005 500ETF 1,000 1,000 0.01

6 合计 6,000 6,000 0.06

3.9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基金投资明细

序号 基金代码 基金名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 500ETF 1,000 1,000 0.01

2 000002 500ETF 1,000 1,000 0.01

3 000003 500ETF 1,000 1,000 0.01

4 000004 500ETF 1,000 1,000 0.01

5 000005 500ETF 1,000 1,000 0.01

6 合计 6,000 6,000 0.06

3.10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 601326 中国平安 620,000 61,572,200 4.62

2 300312 三联虹普 600,000 394,988.98 3.16

3 600036 招商银行 4,500,000 49,005,000 3.68

4 601318 中信国安 1,000 1,822,941.50 0.13

5 600002 万科A 732,566.92 0.54

6 合计 28,162,347.44

3.11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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 500ETF 1,000 1,000 0.01

2 000002 500ETF 1,000 1,000 0.01

3 000003 500ETF 1,000 1,000 0.01

4 000004 500ETF 1,000 1,000 0.01

5 000005 500ETF 1,000 1,000 0.01

6 合计 6,000 6,000 0.06

3.12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基金投资明细

序号 基金代码 基金名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 500ETF 1,000 1,000 0.01

2 000002 500ETF 1,000 1,000 0.01

3 000003 500ETF 1,000 1,000 0.01

4 000004 500ETF 1,000 1,000 0.01

5 000005 500ETF 1,000 1,000 0.01

6 合计 6,000 6,000 0.06

3.13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 601326 中国平安 620,000 61,572,200 4.62

2 300312 三联虹普 600,000 394,988.98 3.16

3 600036 招商银行 4,500,000 49,005,000 3.68

4 601318 中信国安 1,000 1,822,941.50 0.13

5 600002 万科A 732,566.92 0.54

6 合计 28,162,347.44

3.14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权证投资明细