

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:2012年8月25日
§ 1重要提示

基金管理人的董事、董事会秘书或高级管理人员对本报告所载资料的准确性、完整性、准确性承担个别及连带法律责任。本基金半年度报告已经全部二以上独立董事签字确认。

本报告经部分基金经理人根据本基金合同规定,于2012年8月17日核对了本报表中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证核对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运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金合同约定的基金托管人对基金合同规定的提供服务,并根据其提供的中值收益曲线和估值价格对公司旗下基金持有的银行间网定收益品种进行估值(估值基准日)或影响估值(估值基准日)。

根据基金合同的相关规定,结合本基金实际运作情况,本基金报告期末进行利润分配。

§ 2基金简介

2.1基金基本情况

基金名称 东方精选混合 代码 400003

交易代码 400003(前端) 400004(后端)

基金运作方式 灵活配置混合

基金合同生效日 2006年1月11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

报告期末基金份额总额 6,188,198,647.94份

基金合同存续期 不定期

2.2基金产品说明

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。

本基金的投资理念在于通过大类资产的分享中国经济的高速增长。

本基金的投资策略在于通过大类资产配置和自下而上的精选个股(包括债券)实现。

根据本基金的特性,选择行业指数作为本基金股票部分的业绩比较基准。

对于股票配置,作为一只开放式基金,资金仓位在60%~100%之间,完全取决于基金经理人对市场的判断。

对于债券配置,本基金管理人对债券市场进行分析,对基金资产的债券计价人有选择基金价值有利于基金行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

§ 3财务指标

3.1主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)

本期已实现收益 -145,550,214.12

本期利润 388,189,758.24

加权平均基金份额本期利润 0.0660

报告期末基金份额净值增长率 7.70%

3.1.2期间数据和指标

报告期(2012年6月30日)

本期可供基金份额利润额 0.3714

报告期末基金份额净值 6,015,431,427.03

报告期末基金份额净值增长率 0.9721

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,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益;

(2)期末可供分配利润:如果期末未分配利润的汇兑实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末可供分配利润的汇兑实现部分;如果期末未分配利润的汇兑实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为零;

(3)本基金所列数据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

金额单位:人民币元

报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)

份额净值增长率 -0.61%

份额净值增长率标准差 0.54%

业绩比较基准收益率 1.63%

业绩比较基准收益率标准差 0.68%

①-③ -3.73%

②-④ 0.66%

0.312% -0.12%

过去一个月 3.15% -0.62%

业绩比较基准收益率 1.63%

0.68% -1.52%

-0.06%

过去三个月 7.70% -0.96%

0.46% -0.84%

0.30% -0.12%

过去六个月 6.69% -0.93%

-10.12% -0.83%

3.43% -0.10%

过去一年 13.86% -1.29%

-6.89% -0.97%

20.75% -0.32%

过去三年 33.22% -1.70%

92.76% -1.21%

240.46% -0.49%

过去五年 1.38% -0.50%

92.76% -1.21%

4.94% -0.49%

过去十年 1.38% -0.50%

92.76% -1.21%

4.94% -0.49%

过去至今 1.38% -0.50%

92.76