

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25日

S 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。
本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、净资产值和投资组合报告，没有发现本报告存在虚假记载、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。投资人投资于基金，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。

本报告中财务数据未经审计。

报告日期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

S 2 基金产品概况

基金简称 东方核心动力股票型开放式证券投资基金

基金主代码 400011

交易代码 400011(前端) 400012(后端)

基金运作方式 灵活配置型

基金合同生效日 2009年9月24日

报告期末基金份额总额 181,283,802.63份

投资目标 坚持长期价值投资，以全球视野考察中国经济、行业以及个股的成长前景，通过“核心+卫星”投资策略，把握中国经济崛起中的投资机遇，在控制投资风险的前提下，追求资金的长期稳健增值。

投资策略 根据对宏观经济运行周期的研判，确定股票、债券等资产的配置比例，并根据不同资产类别的收益情况动态调整。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
如果以后法律法规发生变化，或者更有权威的、更能为市场普遍接受的业绩基准被提出，或者市场上出现了更加适用于本基金的业绩基准的指数时，本基金将作为与管人协商一致后，报中国证监会备案后变更业绩比较基准及时公告。

风险收益特征 本基金属于股票型基金，为证券投资基金中的高风险品种。

长期平均的风向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 中国银行股份有限公司

S 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(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -4,150,133.52

2.本期利润 -5,341,571.70

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0292

4.期末基金份额净值 134,386,682.41

5.期末基金份额净值 0.7413

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.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

阶段 净值增长率 净值增长率 准确率(%) 准确率(%)

① ② ③ ④

过去三个月 -3.78% 1.09% -5.48% 0.95%

-1.70% 1.07% -0.14%

3.2.2 本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期(2009年6月2日至2012年9月30日)

阶段 净值增长率 净值增长率 准确率(%) 准确率(%)

① ② ③ ④

过去三个月 -3.78% 1.09% -5.48% 0.95%

-1.70% 1.07% -0.14%

3.3 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

报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

阶段 净值增长率 净值增长率 准确率(%) 准确率(%)

① ② ③ ④

过去三个月 -3.78% 1.09% -5.48% 0.95%

-1.70% 1.07% -0.14%

3.4 基金合同生效以来基金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图

2009年6月2日至2012年9月30日

— 本基金净值 — 同业平均净值 — 基金份额净值

— 东方核心动力净值 — 同业平均净值

— 东方核心