东方金账簿货币市场证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:2013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2013年7月12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	1,304,570,038.40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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	15,975,009.92
2.本期利润	15,975,009.92
3.期末基金资产净值	1,304,570,038.40

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9647%	0.0049%	0.0873%	0.0000%	0.8775%	0.0049%

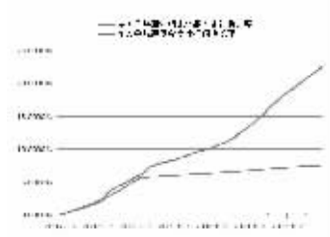
注:本基金每日分配收益,按月结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方金账簿货币市场证券投资基金

累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006年8月2日至2013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		
王丹丹(女士)	本基金基金经理、投资决策委员会委员	2010-9-16	-	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、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。

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、《东方金账簿货币市场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2季度,日本通过扩大量化宽松规模、欧元区和印度等国家通过降息来刺激经济增长,而美国房地产市场明显恢复,失业率进一步下降,美联储在6月的议息会议上宣布将在2013年晚些时候逐步减少购债规模,引起全球股市下跌,对新兴市场的股市和债市冲击尤其强烈。国内方面,经济数据持续低于市场预期,PPI同比降幅持续扩大,CPI同比增速反弹乏力,为遏制日益突出的跨境贸易套利,外管局于5月初宣布20号文,最终引发了6月份资金面紧张的全面升级,出口增速也大幅下降。

二季度债市波动率大幅上升。总体来讲,经济基本面偏弱,对债市形成有利的影响,也是促使收益率上升后回调的驱动力。而促使收益率上升的因素主要是4月份的债市监管风暴和6月份资金面空前紧张引发部分机构去杠杆的行为,也由于基本面疲弱,央行在两次市场动荡时及时出面传递积极信号,因此,收益率在短期内呈现大起大落的变化。整个二季度来看,收益率曲线呈现短端上行的平坦化走势,中长端收益率虽然也有起伏,但由于基本面的利好因素,整体回落至季度初的水平。

报告期内,本基金规模在5月份创历史新高,为应对6月份通常带来的资金面紧张,将50%以上的资产安排在6月份到期,取得了较好的再投资收益,组合剩余期限提高,偏离度受债市下跌影响有所下降。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为0.9647%,业绩比较基准收益率为0.0873%,高于业绩比较基准0.8775%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年三季度,国内经济有利的因素在于房地产销售、投资的平稳对经济形成支撑,不利的因素在于欧洲债务问题有所反复、美联储减少购债规模进程的不确定性,总体来看,在无政策引导和刺激的情况下,经济增长依然面临向下的压力。而资金面由于离岸市场人民币贬值预期走强,资金趋势性流出新兴市场的影响,整体较上半年有所趋紧。由于经济走弱,信用风险的暴露将会增加,我们继续把组合流动性管理放在首位,调整持券结构,进一步提高组合的信用等级,并维持久期的合理稳定。

诚信是基,回报为金",我们珍惜持有人的每一份利益,用我们的专业知识、勤恳态度,谋求长期、稳定的回报。

§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	固定收益投资	720,168,108.36	54.77
	其中:债券	720,168,108.36	54.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	420,001,510.00	31.94
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	130,501,152.43	9.92
4	其他各项资产	44,273,172.62	3.37
5	合计	1,314,943,943.41	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	8.29	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,999,877.50	0.38
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	144
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	146
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.62	0.38
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.83	-
2	30天(含)—60天	13.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	11.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	9.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	39.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.00	0.38

5.4报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,645,906.49	9.17
	其中:政策性金融债	119,645,906.49	9.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	600,522,201.87	46.03
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	720,168,108.36	55.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	49,921,239.16	3.83

5.5报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	041365003	13中城建CP001	500,000	50,001,166.95	3.83
2	041359045	13京热力CP001	500,000	50,000,278.14	3.83
3	110402	11农发02	500,000	49,921,239.16	3.83
4	041351018	13华海药业CP001	300,000	30,079,954.55	2.31
5	041359002	13苏豪CP001	300,000	30,061,374.69	2.30
6	041359033	13苏豪CP002	300,000	30,057,403.33	2.30
7	041351019	13连云港CP001	300,000	30,057,092.37	2.30
8	041358006	13华谊兄弟CP001	300,000	30,048,944.68	2.30
9	041362013	13天士力集CP001	300,000	30,040,758.96	2.30
10	041369018	13京粮CP001	300,000	30,017,980.23	2.30

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	10次
报告期内偏离度的最高值	0.2555%
报告期内偏离度的最低值	-0.3598%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1768%

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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

5.8.2本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	20,734,693.42
3	应收利息	10,170,056.25
4	应收申购款	13,368,422.95
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	44,273,172.62

§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	1,326,866,925.72
本报告期基金总申购份额	1,622,331,920.68
减:本报告期基金总赎回份额	1,644,628,808.00
本报告期期末基金份额总额	1,304,570,038.40

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

一、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》

二、《东方金账簿货币市场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

7.2存放地点:

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

7.3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
2013年7月18日

东方龙混合型开放式证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:2013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2013年7月12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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方龙混合
基金主代码	400001
交易代码	400001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年11月25日
报告期末基金份额总额	1,774,601,092.53份
投资目标	分享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、稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股(包括债券)选择组成。本基金将资产配置、基金风格管理和个股选择都建立在全面、深入而有效的研究的基础上。研究贯穿于基金投资管理的每一个环节。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是中信标普300风格指数,具体包括中信标普300成长指数和中信标普300价值指数,本基金债券部分的业绩比较基准为中信标普全债指数。 本基金整体业绩比较基准=中信标普300成长指数*30%+中信标普300价值指数*45%+中信标普全债指数*25%。 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,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	4,414,526.41
2.本期利润	-40,228,938.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0213
4.期末基金资产净值	1,160,184,699.48
5.期末基金份额净值	0.6538

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

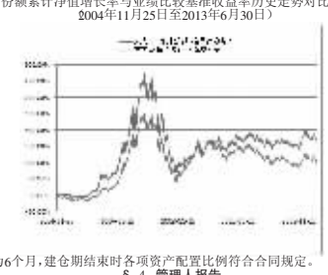
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.90%	0.93%	-8.28%	1.07%	4.38%	-0.14%

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

(2004年11月25日至2013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、投资总监、基金管理部经理、投资决策委员会副主任委员	2008-9-20	-	12年	清华大学IMBA,CFA,12年证券从业经历。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,曾任投资副总监、投资决策委员会委员、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。现任投资决策委员会副主任委员、投资总监、基金管理部经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、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。

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、《东方龙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 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年二季度,本基金继续投资于估值低、业绩优良、成长确定的绩优公司,适当进行波段操作。

报告期内,本基金的持仓以银行、保险、商业贸易、地产、食品饮料等行业的龙头公司为主,少量增持了有较快增速的成长股。4月中下旬,由于对大盘可能反弹的判断,本基金增加了仓位。5月下旬,通过对宏观数据的分析,本基金逐渐降低了仓位。6月下旬,在市场快速下跌的过程中,本基金增持了地产等蓝筹股,提高了仓位。

总的看来,2013年二季度,本基金在仓位控制方面做的较好,但重仓行业表现欠佳,影响了基金的业绩。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为-3.90%,业绩比较基准收益率为-8.28%,高于业绩比较基准4.38%。

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2013年三季度,我们认为中国经济的增速可能继续下滑。由于全球经济的不景气以及人民币升值的影响,出口增速疲弱;制造业投资和基础设施投资的表现不会好;由于就业尚可,政府不会出手刺激经济。

虽然经济不会出现乐观的增长,但A股估值较低,因此我们认为未来市场下跌空间有限,市场已处于历史大底区间。

从行业层面上,继续看好金融服务、商业贸易、房地产、汽车等低估值、成长确定的行业;铁路设备、节能环保、新兴产业等具有阶段性机会;白酒、医药、服装等防御类品种可以逢低买入。

§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	826,427,778.94	70.92
	其中:股票	826,427,778.94	70.92
2	固定收益投资	45,898,346.50	3.94
	其中:债券	45,898,346.50	3.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	245,300,000.00	21.05
	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	38,200,344.60	3.28
6	其他各项资产	9,471,714.93	0.81
7	合计	1,165,298,184.97	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	456,400.00	0.04
B	采矿业	14,288,500.00	1.23
C	制造业	229,189,498.89	19.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	54,768,302.43	4.72
F	批发和零售业	59,887,400.00	5.16
G	交通运输、仓储和邮政业	38,820,000.00	3.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,354,666.40	2.19
J	金融业	235,055,908.27	20.26
K	房地产业	133,606,092.87	11.52
L	租赁和商务服务业	3,504,000.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	6,240,000.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	14,679,010.08	1.27
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	10,578,000.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	826,427,778.94	71.23

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	2,000,000	69,520,000.00	5.99
2	000002	万 科A	5,000,000	49,250,000.00	4.25
3	600519	贵州茅台	209,913	40,380,963.81	3.48
4	600036	招商银行	3,400,000	39,440,000.00	3.40
5	600016	民生银行	4,499,911	38,564,237.27	3.32
6	600383	金地集团	5,500,000	37,730,000.00	3.25
7	600009	上海机场	3,150,000	37,548,000.00	3.24
8	601601	中国太保	1,570,000	25,010,100.00	2.16
9	601668	中国建筑	7,489,909	24,492,002.43	2.11
10	600048	保利地产	2,200,000	21,802,000.00	1.88

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	40,839,100.00	3.52
	其中:政策性金融债	40,839,100.00	3.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,059,246.50	0.44
8	其他	-	-
9	合计	45,898,346.50	3.96

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	120318	12进出18	360,000	35,841,600.00	3.09
2	110023	民生转债	48,670	5,059,246.50	0.44
3	120228	12国开28	50,000	4,997,500.00	0.43
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投资组合报告附注

5.9.1本基金所持有的中国平安(601318)于2013年5月22日对外公告了被处罚的事宜。中国平安保险(集团)股份有限公司董事会于2013年5月21日发布了《中国平安保险(集团)股份有限公司关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》,公告称,中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安证券有限责任公司收到中国证券监督管理委员会《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

本基金所持有的贵州茅台(600519)于2013年2月23日对外公告了被处罚的事宜。贵州茅台酒股份有限公司控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》(黔价处〔2013〕1号)。该决定书认为:贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。为此,根据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚,限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万元人民币上交国库。

本基金决策依据及投资程序:

1)研究部对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

2)投资决策委员会定期召开会议,讨论形成本基金的资产配置比例指导意见。

3)基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

5)投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资中国平安主要基于以下原因:

在基本面上,中国平安具备如下优势:国内保险密度与保险深度仍然处于较低水平,未来随着居民收入增加与保险意识增强,保险行业发展空间广阔;中国平安为市场化程度、管理水平、团队建设均处于行业领先地位的综合型保险集团,竞争优势突出;同时随着平安银行的整合完成,公司已经具备成长为中国优秀金融控股集团的条件,潜力巨大;相关处罚不影响公司的核心竞争力,同时也有利于公司改善其治理结构;与同行业公司比较,公司估值优势也比较突出。本基金在这一投资过程中严格遵守了上述投资程序。

本基金投资贵州茅台主要基于以下原因:

基本面方面,国内居民收入持续增长与消费结构的升级,是国内中高端白酒行业市场容量不断扩大的主要动力之一;贵州茅台是白酒行业第一品牌,竞争优势明显,相关处罚不影响公司的核心竞争力,同时也有利于公司改善其治理结构;与同行业公司比较,公司估值优势也比较突出。本基金在这一投资过程中严格遵守了上述投资程序。

除上述情况外,本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。

5.9.2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备选股票库之外的股票。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	319,440.67
2	应收证券清算款	6,699,657.11
3	应收股利	940,249.82
4	应收利息	1,372,401.26
5	应收申购款	139,966.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,471,714.93

5.9.4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。

5.9.5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

本报告期期初基金份额总额	2,015,727,283.84
本报告期基金总申购份额	203,129,560.38
减:本报告期基金总赎回份额	444,255,751.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,774,601,092.53

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

一、《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方龙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

7.2存放地点:

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

7.3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,投资者还可在本基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2013年7月18日

东方精选混合型开放式证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:2013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2013年7月12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	5,048,607,267.46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