

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

[2012]第四季度报告

基金管理人:东方基金管理有限公司
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:2013年1月19日

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2013年1月16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。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012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:55,925,665.24份

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，积极进行投资范围内的大类资产配置调整，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期资本增值。

本基金将主要上下的大类资产配置与自上而下的个股选择相结合的投资策略。

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评价标准时，本基金可以适时调整业绩比较基准。如果指数编制机构停止指数编制服务或变更指数名称，本基金可以依据实际情况调整指数，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。

本基金的申购赎回费用由基金申购人承担，高于成长潜力

的中证上市公司的股票，属于股票基金的预期风险和

预期收益均为高风险级别的品种，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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -894,609.48

2.本期利润 575,636.59

3.加权平均基金份额本期利润 0.0097

4.期末基金份额净值 58,468,201.65

5.期末基金份额余额 1,0455

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本基金份额净值增长率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2012年12月31日)

注:本基金仓位为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

对外经济贸易大学金融学

硕士，17年期货和证券从业

经历，历任高斯达期货公

司投资经理，金鹏基金管理

投资经理，海南证券研究

员，湘财证券研究所，投资

理财部研究员，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，曾任研究员，东

方策略组股票型开放式

证券投资基金基金经理助理。

注: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证券从业年限是指截至报告期末从业人员从事证券业的工作年限。

4.2报告期内本基金运作合规情况说明

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《证券投资基金公平交易行为指导意见》2011年修

订版，制定、健全基金投资管理有关规章制度，对公平交易制度、公平交易原则、公平交易执行机

制、公平交易定价机制、公平交易流程、公平交易监控和评估机制、公平交易报告、公平交易分析报

告、公平交易异常行为的处理规定。

基金管理人严格执行公平交易制度，建立公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易机会。

对于买卖公开竞价形成的关联交易，基金管理人执行集中交易制度，对于债券一级市场申购、

数量、基金资产按照行价优先、比例分配的原则对交易对象进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则对交易对象进行分配。

基金管理人定期对不同投资组合之间的同向交易价差、反向交易情况进行异常交易情况进

行分析，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。

4.4报告期内本基金的投资者利益保护说明

本基金在报告期内不存在不公平对待和利益输送的异币交易行为。

基金管理人管理的投资者组合与交易对手方公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成

交较高的单边交易量超过该股票当日成交量5%的情况。

4.5管理人对公平交易制度的执行情况的专项说明

4.5.1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《证券投资基金公平交易行为指导意见》2011年修

订版，制定、健全基金投资管理有关规章制度，对公平交易制度、公平交易原则、公平交易执行机

制、公平交易定价机制、公平交易流程、公平交易监控和评估机制、公平交易报告、公平交易分析报

告、公平交易异常行为的处理规定。

基金管理人严格执行公平交易制度，建立公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易机会。

对于买卖公开竞价形成的关联交易，基金管理人执行集中交易制度，对于债券一级市场申购、

数量、基金资产按照行价优先、比例分配的原则对交易对象进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、

价格优先的原则对交易对象进行分配。

基金管理人定期对不同投资组合之间的同向交易价差、反向交易情况进行异常交易情况进

行分析，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。

4.6报告期内本基金的投资者利益保护说明

本基金在报告期内不存在不公平对待和利益输送的异币交易行为。

基金管理人管理的投资者组合与交易对手方公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成

交较高的单边交易量超过该股票当日成交量5%的情况。

4.7管理人对公平交易制度的执行情况的专项说明

4.7.1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《证券投资基金公平交易行为指导意见》2011年修

订版，制定、健全基金投资管理有关规章制度，对公平交易制度、公平交易原则、公平交易执行机

制、公平交易定价机制、公平交易流程、公平交易监控和评估机制、公平交易报告、公平交易分析报

告、公平交易异常行为的处理规定。

基金管理人严格执行公平交易制度，建立公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易机会。

对于买卖公开竞价形成的关联交易，基金管理人执行集中交易制度，对于债券一级市场申购、

数量、基金资产按照行价优先、比例分配的原则对交易对象进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、

价格优先的原则对交易对象进行分配。

基金管理人定期对不同投资组合之间的同向交易价差、反向交易情况进行异常交易情况进

行分析，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。

4.8报告期内本基金的投资者利益保护说明

本基金在报告期内不存在不公平对待和利益输送的异币交易行为。

基金管理人管理的投资者组合与交易对手方公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成

交较高的单边交易量超过该股票当日成交量5%的情况。

4.9管理人对公平交易制度的执行情况的专项说明

4.9.1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《证券投资基金公平交易行为指导意见》2011年修

订版，制定、健全基金投资管理有关规章制度，对公平交易制度、公平交易原则、公平交易执行机

制、公平交易定价机制、公平交易流程、公平交易监控和评估机制、公平交易报告、公平交易分析报

告、公平交易异常行为的处理规定。

基金管理人严格执行公平交易制度，建立公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易机会。

对于买卖公开竞价形成的关联交易，基金管理人执行集中交易制度，对于债券一级市场申购、

数量、基金资产按照行价优先、比例分配的原则对交易对象进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、

价格优先的原则对交易对象进行分配。

基金管理人定期对不同投资组合之间的同向交易价差、反向交易情况进行异常交易情况进

行分析，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。

4.10报告期内本基金的投资者利益保护说明

本基金在报告期内不存在不公平对待和利益输送的异币交易行为。

基金管理人管理的投资者组合与交易对手方公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成

交较高的单边交易量超过该股票当日成交量5%的情况。

4.11管理人对公平交易制度的执行情况的专项说明

4.11.1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《证券投资基金公平交易行为指导意见》2011年修

订版，制定、健全基金投资管理有关规章制度，对公平交易制度、公平交易原则、公平交易执行机

制、公平交易定价机制、公平交易流程、公平交易监控和评估机制、公平交易报告、公平交易分析报

告、公平交易异常行为的处理规定。

基金管理人严格执行公平交易制度，建立公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易机会。

对于买卖公开竞价形成的关联交易，基金管理人执行集中交易制度，对于债券一级市场申购、

数量、基金资产按照行价优先、比例分配的原则对交易对象进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、

价格优先的原则对交易对象进行分配。

基金管理人定期对不同投资组合之间的同向交易价差、反向交易情况进行异常交易情况进

行分析，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。

4.12报告期内本基金的投资者利益保护说明

本基金在报告期内不存在不公平对待和利益输送的异币交易行为。

基金管理人管理的投资者组合与交易对手方公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成

交较高的单边交易量超过该股票当日成交量5%的情况。

4.13管理人对公平交易制度的执行情况的专项说明

4.13.1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《证券投资基金公平交易行为指导意见》2011年修

订版，制定、健全基金投资管理有关规章制度，对公平交易制度、公平交易原则、公平交易执行机

制、公平交易定价机制、公平交易流程、公平交易监控和评估机制、公平交易报告、公平交易分析报

告、公平交易异常行为的处理规定。

基金管理人严格执行公平交易制度，建立公平交易制度，确保各投资组合享有公平的交易机会。

对于买卖公开竞价形成的关联交易，基金管理人执行集中交易制度，对于债券一级市场申购、

数量、基金资产按照行价优先、比例分配的原则对交易对象进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、

价格优先的原则对交易对象进行分配。

基金管理人定期对不同