东方龙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1月19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	1,914,532,733.57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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-728,951.34
2.本期利润	118,179,321.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	1,320,804,889.45
5.期末基金份额净值	0.6899

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	10.05%	1.04%	7.91%	0.93%	2.14%	0.11%

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2012年12月31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、投资副总监、基金管理部经理、投资决策委员会委员	2008-9-20	-	11年	清华大学MBA,CFA;具有基金从业资格,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,曾任东方精选证券投资基金基金经理助理,2006年8月2日至2006年12月29日、2007年8月14日至2010年9月15日担任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。2007年7月20日至2008年9月20日担任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。现任东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理、投资副总监、基金管理部经理、投资决策委员会委员。

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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所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

2012年4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,逢低增持业绩明确的蓝筹股以及有较快增速的成长股。

报告期内,本基金继续坚定持有银行、保险、商业贸易、地产、食品饮料等行业的龙头公司,减持了部分估值较高的小盘股,逢低增持业绩明确的蓝筹股以及有较快增速的成长股,对整体持仓的行业机构进行了调整。10月下旬,从风格比较角度出发,本基金减持了部分估值较高的小盘股,降低了仓位。11月下旬,本基金逢低增持了保险、券商、地产、煤炭、有色等行业的蓝筹股以及增长比较确定的成长股,逐步提高了仓位。12月下旬,随着市场的反弹,本基金对部分获利品种兑现了收益,降低了仓位。

总的看来,本基金行业把握较好,择时贡献了正收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2012年10月1日至12月31日,本基金净值增长率为10.05%,业绩比较基准收益率为 7.91%,高于业绩比较基准2.14%。

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1季度,我们认为中国经济的复苏有望延续下去。中国的内需增长稳健,汽车、地产、家电等行业都有不同程度的增长,零售的增长也令人满意;新的基建项目陆续开工,投资保持了较快的增速,并有望持续下去;但中国的出口前景一般,人民币币值坚挺不利于出口的复苏,而国外经济的疲弱更加剧了出口企业的困难。我们预计本轮始于2012年3季度的复苏的力度,要弱于以往。

虽然经济不会出现乐观的增长,但A股估值较低,并且国内流动性趋于好转,因此我们对2013年一季度的A股市场比较乐观,认为可以取得正收益。市场的机会主要在蓝筹股,那些缺乏投资价值的股票不会有太好的表现,并且这类公司未来仍有巨大的下跌空间。

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;有色、煤炭、铁路设备、节能环保、建筑建材等具有阶段性机会;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	966,254,930.60	72.83
	其中:股票	966,254,930.60	72.83
2	固定收益投资	96,046,300.00	7.24
	其中:债券	96,046,300.00	7.24
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	210,000,000.00	15.83
	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	50,141,646.22	3.78
6	其他各项资产	4,230,608.18	0.32
7	合计	1,326,673,485.00	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	-	-
B	采掘业	34,861,600.00	2.64
C	制造业	230,649,830.84	17.46
C0	食品、饮料	56,324,578.70	4.26
C1	纺织、服装、皮毛	20,429,477.70	1.55
C2	木材、家具	476,000.00	0.04
C3	造纸、印刷	15,601,938.90	1.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,494,700.00	0.72
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	20,886,754.72	1.58
C7	机械、设备、仪表	81,333,936.27	6.16
C8	医药、生物制品	26,102,444.55	1.98
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,448,629.28	1.17
E	建筑业	29,114,000.00	2.20
F	交通运输、仓储业	37,418,600.00	2.83
G	信息技术业	68,090,797.64	5.16
H	批发和零售贸易	84,461,701.36	6.39
I	金融、保险业	365,156,411.00	27.65
J	房地产业	71,030,000.00	5.38
K	社会服务业	28,717,360.48	2.17
L	传播与文化产业	1,306,000.00	0.10
M	综合类	-	-
	合计	966,254,930.60	73.16

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	1,900,000	86,051,000.00	6.52
2	600036	招商银行	4,600,000	63,250,000.00	4.79
3	600016	民生银行	5,300,000	41,658,000.00	3.15
4	601009	南京银行	4,050,000	37,260,000.00	2.82
5	600694	大商股份	1,010,000	35,622,700.00	2.70
6	000002	万 科A	3,000,000	30,360,000.00	2.30
7	600009	上海机场	1,960,000	24,421,600.00	1.85
8	601668	中国建筑	6,000,000	23,400,000.00	1.77
9	600048	保利地产	1,700,000	23,120,000.00	1.75
10	601628	中国人寿	1,000,000	21,400,000.00	1.62

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	46,001,300.00	3.48
	其中:政策性金融债	46,001,300.00	3.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,045,000.00	3.79
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	96,046,300.00	7.27

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	071203004	12中信CP004	500,000	50,045,000.00	3.79
2	120318	12进出18	360,000	36,010,800.00	2.73
3	120305	12进出05	50,000	5,002,000.00	0.38
4	120228	12国开28	50,000	4,988,500.00	0.38
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投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2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。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	2,266,841.97
3	应收股利	-
4	应收利息	792,819.23
5	应收申购款	170,946.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,230,608.18

5.8.4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。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	30,360,000.00	2.30	重大事项停牌

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	1,840,239,275.51
本报告期基金总申购份额	155,838,012.90
减:本报告期基金总赎回份额	81,544,554.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,914,532,733.57

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1月19日

东方精选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1月19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	5,833,901,786.27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和自下而上的精选个股(包括债券)、行业优化组成。	
业绩比较基准	根据本基金的特征,选择中信标普300成长指数作为本基金股票部分的业绩比较基准,选择中信标普全债指数作为债券及货币市场工具的比较基准。 对于权重配置,作为一只混合型基金,股票最低仓位为30%,最高为95%,一般情况下为60%,因此本基金的业绩比较基准为:本基金业绩比较基准=中信标普300成长指数*60% + 中信标普全债指数*40% 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,本基金可以变更业绩比较基准。	
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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-18,155,003.73
2.本期利润	434,265,800.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0727
4.期末基金资产净值	5,872,119,421.15
5.期末基金份额净值	1.0066

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	7.98%	1.00%	2.76%	0.78%	5.22%	0.22%

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

东方精选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

(2006年1月11日至2012年12月31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		
庞飒(先生)	本基金基金经理、总经理助理、投资总监、投资决策委员会副主任委员	2010-9-16	-	12年	浙江大学生命科学院理学硕士,12年证券从业经历。曾任申银万国证券研究所行业分析师,富国基金行业分析师,汇添富基金管理有限公司高级研究员、研究主管、基金经理、投资决策委员会委员及基金投资部副总监。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,现任总经理助理、投资总监、投资决策委员会副主任委员。
李骥(先生)	本基金基金经理、首席策略分析师、投资决策委员会委员	2010-2-12	-	11年	北京大学经济学博士,11年证券从业经历,曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部经理、现任首席策略分析师、投资决策委员会委员。

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、《东方精选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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所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

2012年4季度,自下而上精选个股,选择低估的品种买入,并调整持仓结构。

报告期内,随着投资者对经济见底复苏的逐步认知,A股市场下跌后快速反弹,沪深300指数上涨10%。报告期内,出于对经济已经见底的判断,本基金大幅增持了盈利可能好转的煤炭、券商、地产等周期性行业,增加了投资组合的弹性。在后来的反弹中,本基金增持的股票表现较好。白酒的塑化剂事件对本基金的净值造成了一定的负面影响。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2012年10月1日至12月31日,本基金净值增长率为7.98%,业绩比较基准收益率为2.76%,高于业绩比较基准5.22%。

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1季度,中国经济将进一步复苏。随着补库存活动的展开,经济活动有望小幅回升,并带来企业整体盈利的改善;基础设施建设,可能成为本轮复苏的亮点。

经济向好,全球流动性泛滥,估值较低,这几点的共同作用,有望推高A股。因此本基金将保持积极的操作,自上而下与自下而上相结合,调整持仓结构和品种,在控制风险的前提下追求收益。

行业配置方面,继续看好业绩增长明确的食品饮料、银行、商业贸易、旅游等行业,积极关注盈利预期改善的非银金融、建筑建材、煤炭、有色等周期性行业,并加强对医药、环保等行业的关注。

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	4,702,721,530.06	79.41
	其中:股票	4,702,721,530.06	79.41
2	固定收益投资	539,145,000.00	9.10
	其中:债券	539,145,000.00	9.10
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	160,000,760.00	2.70
	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	433,360,865.35	7.32
6	其他各项资产	86,501,185.95	1.46
7	合计	5,921,729,341.36	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	-	-
B	采掘业	97,392,000.00	1.66
C	制造业	1,122,691,658.94	19.12
C0	食品、饮料	590,251,201.80	10.05
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	22,296,800.00	0.38
C3	造纸、印刷	18,885,175.75	0.32
C4	石油、化学、塑胶、塑料	201,192,199.23	3.43
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	290,066,282.16	4.94
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	71,759,378.08	1.22
E	建筑业	587,047,462.21	10.00
F	交通运输、仓储业	318,073,205.61	5.42
G	信息技术业	64,071,444.70	1.09
H	批发和零售贸易	451,649,641.97	7.69
I	金融、保险业	1,063,080,897.00	18.10
J	房地产业	575,445,346.11	9.80
K	社会服务业	319,021,378.94	5.43
L	传播与文化产业	32,489,116.50	0.55
M	综合类	-	-
	合计	4,702,721,530.06	80.09

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	000568	泸州老窖	11,889,017	420,871,201.80	7.17
2	601668	中国建筑	98,000,000	382,200,000.00	6.51
3	600694	大商股份	9,383,347	330,950,648.69	5.64
4	601166	兴业银行	16,000,000	267,040,000.00	4.55
5	600066	宇通客车	10,279,870	259,052,724.00	4.41
6	601318	中国平安	5,000,000	226,450,000.00	3.86
7	600048	保利地产	16,000,000	217,600,000.00	3.71
8	000002	万 科A	20,009,980	202,500,997.60	3.45
9	600030	中信证券	15,000,000	200,400,000.00	3.41
10	601628	中国人寿	8,809,855	188,530,897.00	3.21

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	497,630,000.00	8.47
	其中:政策性金融债	497,630,000.00	8.47
4	企业债券	31,470,000.00	0.54
5	企业短期融资券	10,045,000.00	0.17
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	539,145,000.00	9.18

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	120218	12国开18	2,000,000	200,080,000.00	3.41
2	120405	12农发05	1,000,000	100,050,000.00	1.70
3	120409	12农发09	1,000,000	99,510,000.00	1.69
4	120309	12进出09	1,000,000	97,990,000.00	1.67
5	112059	11联化债	300,000	31,470,000.00	0.54

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投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2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。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,250,000.00
2	应收证券清算款	50,036,268.28
3	应收股利	-
4	应收利息	12,997,283.60
5	应收申购款	21,217,634.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,501,185.95

5.8.4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。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	202,500,997.60	3.45	因筹划重大事项停牌

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	1,071,077,445.05
本报告期基金总申购份额	1,555,471,297.37
减:本报告期基金总赎回份额	1,648,322,652.12
本报告期期末基金份额总额	978,226,090.30

7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2013年1月4日发布了《关于东方精选混合型基金基金经理变更的公告》,增聘于鑫先生、呼振翼先生为本基金基金经理,与庞飒先生共同管理本基金,李骥先生不再担任本基金基金经理。

本基金管理人已分别通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站对上述基金经理变更情况履行了信息披露义务。

8 备查文件目录

8.1备查文件目录

一、《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方精选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、基金份额净值及其他临时公告

8.2存放地点:

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

8.3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1月19日

东方金账簿货币市场证券投资基金

【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1月19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	978,226,090.30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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	10,745,102.86
2.本期利润	10,745,102.86
3.期末基金资产净值	978,226,090.30

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