东方保本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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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	东方保本混合
基金主代码	400013
交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月14日
报告期末基金份额总额	708,207,630.49份
投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,在保本周期到期时,为保本周期内认购并持有到期的基金份额提供保本金额安全保证的基础上,力求基金资产的稳定增值。
投资策略	在大类资产配置方面,本基金运用CPPI固定比例投资组合保险机制,来动态分配基金资产在收益资产和保本资产上的投资比例。 在保本资产投资方面,以追求本金安全为目的。即通过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本周期的债券等低风险固定收益类证券,并规避利率、再投资等风险,以确保保本资产的稳定收益。 在收益资产投资方面,以追求收益为目的。即采用积极投资方式,把握市场时机,挖掘市场热点,精选个股,获取稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。 本基金为保本混合型基金产品,力争在保本周期到期日保障保本金额的安全。在目前国内金融市场环境下,银行定期存款可以近似理解为保本定息产品。本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准,能够帮助投资者界定本基金的风险收益特征,并反映投资目标。 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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在与托管人协商一致,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,不需要召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金保证人	中国邮政集团公司

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	9,949,738.26
2.本期利润	13,219,226.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0180
4.期末基金资产净值	757,118,170.65
5.期末基金份额净值	1.069

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	1.71%	0.07%	1.07%	0.00%	0.64%	0.07%

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

东方保本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4月14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		
张岗(先生)	本基金基金经理、研究部经理、投资决策委员会委员	2011-4-14	-	11年	西北大学经济管理学院经济学博士,11年证券从业经验。历任健桥证券股份公司行业公司部经理,天治基金管理有限公司研究员、天治财富增长混合型证券投资基金基金经理(2006年3月-2007年4月),投资副总监,投资决策委员会委员,建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、研究部经理、投资决策委员会委员。
杨林耘(女士)	本基金基金经理	2011-4-14	-	19年	北京大学经济学院金融硕士。19年金融、证券从业经历。曾先后在武汉融利期货任首席交易员和高级分析师,在泰康人寿保险资产管理公司任高级项目经理,在中国对外经济贸易信托有限公司任融资业务部总经理助理、交易部总经理助理、证券业务部高级投资经理。2008年11月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方稳健回报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、《东方保本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,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,债券市场延续三季度继续调整,债券收益率普遍上行,唯高票息的信用债收益率下行而取得较好收益。本季度的最后一个月股票市场转好,受此影响,可转债成为本季表现最好的债券资产。通货膨胀指数CPI在本季度创出全年低点后小幅回升,工业品指数PPI下滑的速度也明显放缓,代表经济先行指标的采购经理人指数PMI连续3个月站在50%以上,国内经济呈现出底部回暖的迹象。本季度央行继续实施稳健的货币政策,主要通过逆回购动态调整市场资金,除了10月底和12月底的两次节日季节性因素外,大部分时间市场资金处于紧平衡状态。

报告期内,基于经济短期企稳回暖,本基金减持部分债资产的仓位,适当增持可转债和股票资产,以提高整体组合的收益。

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1.71%,业绩比较基准收益率为1.07%,高于业绩比较基准0.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计未来一个阶段,利率债以波段行情为主,有交易性投资机会。信用债将面临结构性调整的局面,原来齐涨齐跌的局面不再,本基金投资时将更加注重债券所处的行业特征和个券资质的选择。受经济和股市的回暖,可转债的投资机会大于风险。基于大盘逐渐回暖,本基金还将重点关注收益资产的投资。对于权益类资产,我们将坚持采取至下而上的策略,重点研究、精选个股,在控制风险的前提下寻找投资机会。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承"诚信是基、回报为金"的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

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	权益投资	21,394,512.30	2.64
	其中:股票	21,394,512.30	2.64
2	固定收益投资	640,071,765.60	78.87
	其中:债券	640,071,765.60	78.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	130,000,555.00	16.02
	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	5,428,717.50	0.67
6	其他各项资产	14,627,101.01	1.80
7	合计	811,522,651.41	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	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
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	-	-
E	建筑业	4,067,322.00	0.54
F	交通运输、仓储业	2,964,198.00	0.39
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	14,362,992.30	1.90
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	21,394,512.30	2.83

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	601398	工商银行	3,460,962	14,362,992.30	1.90
2	601618	中国中冶	1,799,700	4,067,322.00	0.54
3	601111	中国国航	494,033	2,964,198.00	0.39
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	109,339,000.00	14.44
	其中:政策性金融债	109,339,000.00	14.44
4	企业债券	401,565,997.00	53.04
5	企业短期融资券	55,151,000.00	7.28
6	中期票据	-	-
7	可转债	74,015,768.60	9.78
8	其他	-	-
9	合计	640,071,765.60	84.54

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	112029	11软控债	600,000	60,000,000.00	7.92
1	122074	11士兰微	600,000	60,000,000.00	7.92
3	110015	石化转债	523,770	53,901,170.70	7.12
4	090401	09农发01	500,000	49,280,000.00	6.51
5	1180117	11陕东岭债	300,000	30,255,000.00	4.00

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有权证。

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、处罚的情形。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	463,379.03
3	应收股利	-
4	应收利息	13,857,524.10
5	应收申购款	56,197.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,627,101.01

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	53,901,170.70	7.12
2	110017	中海转债	5,729,899.60	0.76
3	113003	重工转债	4,304,188.20	0.57
4	110018	国电转债	2,943,283.20	0.39
5	110019	恒丰转债	1,035,364.40	0.14

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	601618	中国中冶	4,067,322.00	0.54	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	758,002,146.82
本报告期基金总申购份额	2,557,727.41
减:本报告期基金总赎回份额	52,352,243.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	708,207,630.49

7 备查文件目录

7.1备查文件目录

一、《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方保本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1月19日

东方策略成长股票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	东方策略成长股票	
基金主代码	400007	
交易代码	400007(前端)	400008(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年6月3日	
报告期末基金份额总额	62,868,991.52份	
投资目标	本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司,分享国民经济快速发展带来的成长性收益,追求管理资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金通过分析宏观经济发展战略,确定基金重点投资的行业,自上而下配置资产,自下而上精选证券。 本基金从重点投资的行业中寻找成长性公司,通过成长风险值控制成长风险,以合理的价格投资于优秀公司和/或相对价值低估的其他公司;通过组合投资有效分散风险,谋求基金资产长期稳定的增长。	
业绩比较基准	本基金的股票业绩比较基准是中信标普300指数;债券业绩比较基准是中信标普全债指数。 本基金的业绩比较基准为:中信标普300指数收益率70%+中信标普全债指数收益率×30%	
	随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适合本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。	
风险收益特征	本基金属于成长型股票基金,为证券投资基金中的高风险品种。长期平均的风险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	-75,841.74
2.本期利润	7,791,204.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.1230
4.期末基金资产净值	86,752,847.75
5.期末基金份额净值	1.3799

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

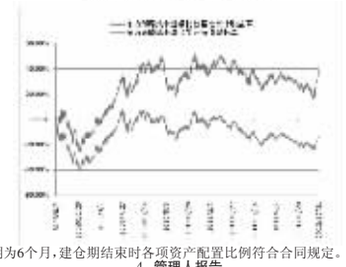
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.85%	1.07%	7.17%	0.88%	2.68%	0.19%

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

东方策略成长股票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

(2008年6月3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	2008-6-3	-	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,曾任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理,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;2006年8月2日至2006年12月29日,2008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;2008年9月20日至今担任东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理。现任投资副总监、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、《东方策略成长股票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,本基金的投资以估值低、业绩优良、成长确定的绩优公司为主,增持业绩拐点和高增长公司,适当增加组合的弹性。

10月下旬,本基金出于对风险的规避,降低了仓位,减持了部分相对估值较高的公司。11月下旬,本基金开始增加对保险、煤炭、小盘股的投入,逐步提高了仓位。同时,本基金对部分业绩处于底部且面临拐点的周期类公司也进行了建仓。12月下旬,本基金在市场反弹过程中降低了仓位,在一些品种上实现了收益。

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9.85%,业绩比较基准收益率为7.17%,高于业绩比较基准2.68%。

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,我们认为中国经济有望继续复苏。从已公布的数据看,可以确定中国经济在2012年3季度已经见底。企业盈利的逐步改善将带来库存的增加,这个补库存的行为将推动中国经济的进一步复苏。投资和消费都会表现良好,但出口存在较大的不确定性。

经济的复苏结合市场整体的低估,将有助于资本市场的表现。低估的权重股有望继续保持强势,部分周期性行业也会出现价值回归。但业绩不佳、没有特色的公司将不会有太好的表现,并且未来仍有较大的下跌空间。

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;煤炭、有色、建筑建材等具有阶段性机会;白酒、医药、服装等有望补涨。

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	66,838,345.28	76.12
	其中:股票	66,838,345.28	76.12
2	固定收益投资	4,001,200.00	4.56
	其中:债券	4,001,200.00	4.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	12,500,000.00	14.24
	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	3,659,048.50	4.17
6	其他各项资产	809,640.76	0.92
7	合计	87,808,234.54	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	1,944,895.00	2.24
C	制造业	16,269,173.00	18.75
C0	食品、饮料	4,640,508.00	5.35
C1	纺织、服装、皮毛	1,251,470.00	1.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,019,940.00	1.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	769,230.00	0.89
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,219,490.00	1.41
C7	机械、设备、仪表	5,591,130.00	6.44
C8	医药、生物制品	1,777,405.00	2.05
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,255,000.00	1.45
E	建筑业	1,733,560.00	2.00
F	交通运输、仓储业	2,778,300.00	3.20
G	信息技术业	4,281,962.28	4.94
H	批发和零售贸易	6,126,145.00	7.06
I	金融、保险业	24,854,630.00	28.65
J	房地产业	5,648,880.00	6.51
K	社会服务业	1,867,440.00	2.15
L	传播与文化产业	78,360.00	0.09
M	综合类	-	-
	合计	66,838,345.28	77.04

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	137,000	6,204,730.00	7.15
2	600036	招商银行	280,000	3,850,000.00	4.44
3	600016	民生银行	470,000	3,694,200.00	4.26
4	601009	南京银行	350,000	3,220,000.00	3.71
5	600694	大商股份	71,000	2,504,170.00	2.89
6	000002	万 科A	234,000	2,368,080.00	2.73
7	000858	五 粮 液	79,000	2,230,170.00	2.57
8	600009	上海机场	155,000	1,931,300.00	2.23
9	600048	保利地产	138,000	1,876,800.00	2.16
10	601169	北京银行	190,000	1,767,000.00	2.04

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	4,001,200.00	4.61
	其中:政策性金融债	4,001,200.00	4.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,001,200.00	4.61

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	40,000	4,001,200.00	4.61
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
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、处罚的情形。

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	500,000.00
2	应收证券清算款	204,933.89
3	应收股利	-
4	应收利息	35,231.87
5	应收申购款	69,475.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	809,640.76

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	2,368,080.00	2.73	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	63,711,883.27
本报告期基金总申购份额	2,441,179.73
减:本报告期基金总赎回份额	3,284,071.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,868,991.52

7 备查文件目录

7.1备查文件目录

一、《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方策略成长股票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1月19日

东方核心动力股票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	东方核心动力股票	
基金主代码	400011	
交易代码	400011(前端)	400012(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年6月24日	
报告期末基金份额总额	178,974,705.51份	
投资目标	坚持长期投资理念,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,追求资本的长期稳定增值。	
投资策略	根据对宏观经济运行周期的研判,确定股票、债券、现金等资产的配置比例,并根据不同资产类别的收益情况进行动态调整。	
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,或者是市场上出现更加合适用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在与托管人协商一致、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。	
	长期平均的风险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	

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	-5,646,470.13
2.本期利润	6,515,050.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0362
4.期末基金资产净值	139,209,548.78
5.期末基金份额净值	0.7778

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