

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：二〇一三年三月二十七日

## § 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、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、准确和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺以其诚信勤勉、尽责尽责地代表基金份额持有人利益，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及其更新。

立信会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本基金报告自2012年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

	东方保本混合型开放式证券投资基金
基金简称	东方保本混合型开放式证券投资基金
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	2012年1月4日
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
报告期末基金资产总额	708,207,630.49元
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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，在保本周期到期时实现保本。

本基金在本期认购并持有到期的基金份额提供本金安全保障的基础上，力求基金资产的稳定增值。

在各类资产配置方面，本基金运用CPU处理器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节或等于本基金的剩余期限等低风险固定收益类证券，并规避利率、再投资等风险。

在收益资产投资方面，以追求收益为目标，即通过积极投资方式，把握市场时机、挖掘市场热点，获取稳定的资本增值。

本基金通过定期存款或协议存款等方式使本基金的业绩比较基准化。

本基金在定期存款或协议存款到期后，将根据资金的使用安排，选择继续持有定期存款或协议存款，或者卖出定期存款或协议存款，将资金投资于货币市场基金，或者买入在托管人协商一致，指明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，属于证券投资基金管理中的低风险品种。

2.3基金管理人和基金托管人

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

名称：姓名：张晓伟

信息披露负责人：联系电话：010-68858888

电子邮箱：xwp@orient-fund.com

客户服务电话：010-66578785/400-628-5888

传真：010-66578700

2.4信息披露方式

本基金公告披露的管理人互联网网址：<http://www.orient-fund.com>

基金年度报告备置地点：本基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年4月14日至基金合同生效日(至2011年12月31日)
本期已实现收益	40,411,626.26	17,465,410.49
本期利润	60,636,824.59	13,511,520.54
加权平均基金份额本期利润	0.0695	0.0010
本期基金份额净值增长率	6.38%	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0596	0.0025
期末基金净值增长率	757,118,170.65	1,132,942,608.62
期末基金份额净值	1,069	1,003

注：①本期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，本期利润为本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润即期末实际可用于分红的利润，即正数表示盈利，负数表示亏损。

③本基金所列示指标均不包括任何持有人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 份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方保本混合型开放式证券投资基金



3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东方保本混合型开放式证券投资基金



3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方保本混合型开放式证券投资基金



注：本基金合同于2011年4月14日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日2011年4月14日起至报告期截止日2012年12月31日未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）经中国证监会批准设立于2004年5月11日成立，是中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规规定的基金。

本公司股东为东北证券股份有限公司，持有股份46%，中航国华实业集团有限公司，持有股份18%，渤海国际信托有限公司，持有股份18%；截至2012年12月31日，本公司管理十只开放式证券投资基金，分别为东方保本混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力股票型开放式证券投资基金、东方保本混合型开放式证券投资基金、东方增强收益债券型证券投资基金、东方外汇优化指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理，或基金经理助理的简历

姓名 职务 在任基金 任期从 年 月 日 至 离任日期 在任基金 任期从 年 月 日 至 离任日期 说明

张园 (先生) 本基金 基金 经理、研究 部经 理、投 资决策委 员会委 员会委员 2011-04-14 - 11年 北京大学经济学硕士，1999年就职于经济日报，后在健桥网络公司工作，历任财务科长、财务部副经理、财务部经理。2006年3月至今就职于本公司，担任基金经理助理，负责公司旗下基金的日常投资管理工作。

杨林耘(女士) 本基金 基金 经理 2011-04-14 - 19年 北京大学金融学硕士，1999年就职于经济日报，后在中航材集团有限公司工作，历任财务科长、财务部副经理、财务部经理。2008年1月加盟本公司，担任基金经理助理，负责公司旗下基金的日常投资管理工作。

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证券从业的定义从行业协会、证券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的说明

本基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及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用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法律法规的规定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平交易制度按照《证券投资基金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公司公平交易制度。

基金管理人建立了内部公平交易体系和相关的研究方法，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、投资决策和实施决策方面享有平等的机会。

基金管理人实行公平交易制度，建立公平的交易分配机制，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所的公平交易政策；对于债券一级市场申购，非公开发行股票申购等投资活动在交易前独立确立各投资组合的交易价格和数量，基金管理人根据各投资组合分别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得到公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合之间同时间段内的交易价格、交易时间、反向交易情况、异常交易情况进行分析，对异常交易行为进行处理。

4.3.2 公平交易的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金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公司公平交易制度。

基金管理人建立了内部公平交易体系和相关的研究方法，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、投资决策和实施决策方面享有平等的机会。

基金管理人实行公平交易制度，建立公平的交易分配机制，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所的公平交易政策；对于债券一级市场申购，非公开发行股票申购等投资活动在交易前独立确立各投资组合的交易价格和数量，基金管理人根据各投资组合分别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得到公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合之间同时间段内的交易价格、交易时间、反向交易情况、异常交易情况进行分析，对异常交易行为进行处理。

4.3.3 公平交易的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金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公司公平交易制度。

基金管理人建立了内部公平交易体系和相关的研究方法，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、投资决策和实施决策方面享有平等的机会。

基金管理人实行公平交易制度，建立公平的交易分配机制，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所的公平交易政策；对于债券一级市场申购，非公开发行股票申购等投资活动在交易前独立确立各投资组合的交易价格和数量，基金管理人根据各投资组合分别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得到公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合之间同时间段内的交易价格、交易时间、反向交易情况、异常交易情况进行分析，对异常交易行为进行处理。

4.3.4 公平交易的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金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公司公平交易制度。

基金管理人建立了内部公平交易体系和相关的研究方法，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、投资决策和实施决策方面享有平等的机会。

基金管理人实行公平交易制度，建立公平的交易分配机制，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所的公平交易政策；对于债券一级市场申购，非公开发行股票申购等投资活动在交易前独立确立各投资组合的交易价格和数量，基金管理人根据各投资组合分别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得到公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合之间同时间段内的交易价格、交易时间、反向交易情况、异常交易情况进行分析，对异常交易行为进行处理。

4.3.5 公平交易的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金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公司公平交易制度。

基金管理人建立了内部公平交易体系和相关的研究方法，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、投资决策和实施决策方面享有平等的机会。

基金管理人实行公平交易制度，建立公平的交易分配机制，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所的公平交易政策；对于债券一级市场申购，非公开发行股票申购等投资活动在交易前独立确立各投资组合的交易价格和数量，基金管理人根据各投资组合分别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得到公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合之间同时间段内的交易价格、交易时间、反向交易情况、异常交易情况进行分析，对异常交易行为进行处理。

4.3.6 公平交易的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金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公司公平交易制度。