

东方利群混合型发起式证券投资基金

[2013] 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人对本基金定期报告所载资料根据有关法律法规的规定，履行了监督职责，对报告的内容有真实的了解和全面的掌握。

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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方利群混合
基金代码	400022
交易代码	400022
基金运作方式	契约型开放式发起式
基金经理办公日	2013年7月17日
报告期末基金份额总额	76,170,759.44份

基金的业绩比较基准为同期人民币定期存款基准利率(税后)。

基金净值为每份额资产净值，其期间收益率及风险水平高于货币型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

基金管理人:东方基金管理有限责任公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 1,069,317.87

2.本期利润 -9,197.94

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0001

4.期末基金份额净值 76,508,231.59

1.0044

注: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 准备收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.16% 0.32% 1.20% 0.02% -1.36% 0.30%

3.2.2基金份额生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方利群混合型发起式证券投资基金的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

(2013年7月1日至2013年12月31日)

注:本基金合同于2013年7月17日生效，截至报告期末，本基金成立不满六个月，仍处于建仓期。

§ 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 任职日期 离任日期 说明

于鑫(先生) 本基金基金经理、总经理助理、投资决策委员会委员 2013-7-17 - 12年

本基金报告期内因个人原因辞去基金经理职务。

朱晓伟(先生) 本基金基金经理 2013-7-17 - 4年

本基金报告期内因个人原因辞去基金经理职务。

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上公告之日。

(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循信守承诺的情况

基金管理人已根据法律法规及《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金监督管理办法》及其各项实施细则、《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，诚实守信、勤勉尽责的管理运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人制定了投资决策的内部控制体系和研究的方法论，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合研究平台在得到投资决策平台的授权后，可以自行决策并报备。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则对各投资组合获得公平的交易机会。

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.4报告期内本基金的投票决策和业绩表现说明

4.4.1报告期内本基金投票决策和运作分析

报告期内，在三季报业绩不理想的情况下，以及IPO重启等因素，对市场我们仍保留着一定谨慎，因此本基金目前净值约50%左右的仓位水平。但市场整体的下跌还是对基金净值造成了一些负面影响，因此在报告期末基金完成一定的收益。

4.4.2报告期内本基金的业绩表现

本基金报告期内，未发现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的5%的情况。

4.5管理人对报告期公平交易情况的专项说明

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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.6管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.6.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.7管理人对报告期公平交易情况的专项说明

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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.8管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.8.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.9管理人对报告期公平交易情况的专项说明

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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.10管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.10.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.11管理人对报告期公平交易情况的专项说明

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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.12管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.12.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.13管理人对报告期公平交易情况的专项说明

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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.14管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.14.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.15管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.15.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现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的5%的情况。

4.16管理人对报告期公平交易情况的专项说明

4.16.1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《东方基金管理有限公司公平交易管理制度》。

基金管理人定期对不同投资组合之间进行同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对同向交易价差是否超出行业公认的合理范围进行分配。

本基金报告期内未发现不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单