

信息披露 Disclosure

东方核心动力股票型开放式证券投资基金

2013 年度报告摘要

最终用户服务协议，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的有价证券进行估值和公允价值计量(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。

7.4.1.12 权证交易
本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易权证。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据本基金合同的相关规定，结合本基金实际情况，本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.1.13 债券交易
单位:人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
成交金额	1,396,369.30	1,396,369.30
占当期债券成交总额的比例	0.0001	0.0001

5.1 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
本报告期，东方核心动力股票型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)在运作过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

7.4.1.14 股指期货交易
单位:人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
成交金额	0	0
占当期股指期货成交总额的比例	0	0

7.1 资产负债表
单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
货币资金	7.4.7.1	17,344,677.35	13,883,483.70
交易性金融资产	7.4.7.2	149,366,390.90	49,425,263.36
应收利息	7.4.7.3	24,663.13	780,000.00
其他金融资产	7.4.7.2	116,117,682.24	125,621,801.50
其中:股票投资		114,011,293.24	119,782,969.70
基金投资		2,106,390.00	5,838,840.80
资产支持证券		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-	-
应收股利	7.4.7.5	8,432.60	74,821.52
其他资产		-	-
资产总计		134,929,962.08	140,489,714.95

7.4.1.15 应支付关联方的佣金
单位:人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期佣金	47,668.81	13,179.00
占当期佣金总额的比例	100.00%	100.00%

7.2 公允价值
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的公允价值变动损益	2,088,188.11	2,073,123.53
其中:支付销售机构的客户维护费	293,449.62	284,979.76

7.4.2 关联方关联交易
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
基金管理人	40,785.55	6,396.87
基金托管人	17,929.25	4,556.13

7.3 或有事项
截至2013年12月31日，本基金不存在任何或有事项。

7.4.2.1 基金管理人
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,088,188.11	2,073,123.53
其中:支付销售机构的客户维护费	293,449.62	284,979.76

7.4 关联方交易
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
基金管理人	40,785.55	6,396.87
基金托管人	17,929.25	4,556.13

7.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,483,041.44	3,503,066.66

3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

项目	2013年	2012年	2011年
3.1.1 期间数据和指标			
本期已实现收益	8,908,119.82	-17,210,428.92	-19,255,871.05
本期利润	11,881,922.48	9,219,503.35	-46,429,401.94
加权平均基金份额本期利润	0.0677	0.0498	-0.2305
本期基金份额净值增长率	7.68%	6.83%	-24.39%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1866	-0.2400	-0.2719
期末可供分配利润	123,894,576.72	139,209,548.78	140,126,999.76

7.4.2.3 基金销售费
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,483,041.44	3,503,066.66

3.2 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
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		14,633,365.32	12,447,174.05
1.利息收入		14,140.47	328,367.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	62,046.18	43,968.87
2.投资收益		82,117.29	255,862.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,815.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		12,264,716.42	-14,318,045.92
其中:股票投资收益	7.4.7.12	10,410,908.34	-16,158,554.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	47,586.94	153,946.43
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.15	1,803,221.14	1,686,561.84
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.16	2,213,802.66	26,429,932.27
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	7.4.7.17	15,482.77	6,920.45
减:二、费用		3,453,242.84	3,227,670.70
1.管理人报酬	2,088,188.10	2,070,123.53	-
2.托管费	348,031.44	345,026.66	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	619,132.28	409,467.09
5.利息支出		-	712.78
6.其他费用	7.4.7.19	397,891.02	402,346.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35

7.4.2.4 基金管理人
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,483,041.44	3,503,066.66

3.3 基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		14,633,365.32	12,447,174.05
1.利息收入		14,140.47	328,367.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	62,046.18	43,968.87
2.投资收益		82,117.29	255,862.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,815.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		12,264,716.42	-14,318,045.92
其中:股票投资收益	7.4.7.12	10,410,908.34	-16,158,554.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	47,586.94	153,946.43
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.15	1,803,221.14	1,686,561.84
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.16	2,213,802.66	26,429,932.27
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	15,482.77	6,920.45
减:二、费用		3,453,242.84	3,227,670.70
1.管理人报酬	2,088,188.10	2,070,123.53	-
2.托管费	348,031.44	345,026.66	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	619,132.28	409,467.09
5.利息支出		-	712.78
6.其他费用	7.4.7.19	397,891.02	402,346.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35

7.4.2.5 基金管理人
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,483,041.44	3,503,066.66

3.4 基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		14,633,365.32	12,447,174.05
1.利息收入		14,140.47	328,367.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	62,046.18	43,968.87
2.投资收益		82,117.29	255,862.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,815.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		12,264,716.42	-14,318,045.92
其中:股票投资收益	7.4.7.12	10,410,908.34	-16,158,554.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	47,586.94	153,946.43
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.15	1,803,221.14	1,686,561.84
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	2,213,802.66	26,429,932.27
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	15,482.77	6,920.45
减:二、费用		3,453,242.84	3,227,670.70
1.管理人报酬	2,088,188.10	2,070,123.53	-
2.托管费	348,031.44	345,026.66	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	619,132.28	409,467.09
5.利息支出		-	712.78
6.其他费用	7.4.7.19	397,891.02	402,346.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35

7.4.2.6 基金管理人
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,483,041.44	3,503,066.66

3.5 基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		14,633,365.32	12,447,174.05
1.利息收入		14,140.47	328,367.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	62,046.18	43,968.87
2.投资收益		82,117.29	255,862.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,815.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		12,264,716.42	-14,318,045.92
其中:股票投资收益	7.4.7.12	10,410,908.34	-16,158,554.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	47,586.94	153,946.43
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.15	1,803,221.14	1,686,561.84
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	2,213,802.66	26,429,932.27
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	15,482.77	6,920.45
减:二、费用		3,453,242.84	3,227,670.70
1.管理人报酬	2,088,188.10	2,070,123.53	-
2.托管费	348,031.44	345,026.66	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	619,132.28	409,467.09
5.利息支出		-	712.78
6.其他费用	7.4.7.19	397,891.02	402,346.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,181,922.48	9,219,503.35

7.4.2.7 基金管理人
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,483,041.44	3,503,066.66

3.6 基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		14,633,365.32	12,447,174.05
1.利息收入		14,140.47	328,367.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	62,046.18	43,968.87
2.投资收益		82,117.29	255,862.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,815.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		12,264,716.42	-14,318,045.92
其中:股票投资收益	7.4.7.12	10,410,908.34	-16,158,554.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	47,586.94	153,946.43
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.15	1,803,221.14	1,686,5