东方强化收益债券型证券投资基金

【2014】第三季度报告

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:2014年10月27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2014年10月23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2014年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	东方强化收益债券
基金主代码	400016
交易代码	400016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月9日
报告期末基金份额总额	199,994,439.21份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,追求稳定的当期收益和长期增值,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金采用"中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%"作为投资业绩比较基准。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	3,033,625.74
2.本期利润	6,511,741.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0330
4.期末基金资产净值	214,398,373.86
5.期末基金份额净值	1.0720

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	3.17%	0.11%	1.91%	0.11%	1.26%	0.00%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

东方强化收益债券型证券投资基金
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
(2012年10月9日至2014年9月30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		
徐昀君(先生)	本基金基金经理	2014-3-7	-	6年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,6年证券从业经历,曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理,2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理。现任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利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分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《东方强化收益债券型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 公平交易专项说明

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。

本报告期内,未出现涉及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

三季度,在部分经济数据企稳的影响下,市场曾经一度普遍预期经济正在触底甚至即将反弹,债券市场也因此经历了一波小幅调整。但是在9月份,公布的数据大幅低于市场预期,市场开始对宏观经济的未来陷入悲观,央行也立即出台货币宽松政策,债券收益率随即平坦化下行。

报告期内,本基金适当拉长了组合久期,并增加了较高收益债券的比例,提高了组合的静态收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2014年7月1日至9月30日,本基金净值增长率为3.17%,业绩比较基准收益率为1.91%,高于业绩比较基准1.26%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来,在经济不断下行的环境下,政府陆续推出了包括放松房贷在内的多种稳增长政策,显示了政府保增长的决心。展望四季度,在整体经济依然低迷的情况下,预计政府将推出更多托底政策,直至经济出现复苏曙光。在此背景下,宽松的货币政策料将持续,债券市场的慢牛行情还将延续。

未来一季度,本基金将继续维持现有组合,以获得稳定的票息收入并适度拉长组合久期,提高组合收益。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	415,647,562.64	90.81
	其中:债券	415,647,562.64	90.81
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,003,186.36	3.28
7	其他资产	27,066,041.18	5.91
8	合计	457,716,790.18	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	31,713,563.20	14.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,524,200.00	4.91
	其中:政策性金融债	10,524,200.00	4.91
4	企业债券	221,694,006.54	103.40
5	企业短期融资券	25,342,000.00	11.82
6	中期票据	115,458,000.00	53.85
7	可转债	10,915,792.90	5.09
8	其他	-	-
9	合计	415,647,562.64	193.87

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1282394	12新奥MTN1	200,000	20,200,000.00	9.42
2	1282463	12郑路桥MTN1	200,000	20,132,000.00	9.39
3	1382294	13京热力MTN1	200,000	19,688,000.00	9.18
4	124504	11惠投债	170,000	17,816,000.00	8.31
5	122542	12阿信诚	170,060	17,108,036.00	7.98

5.6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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2根据基金合同的规定,本基金可以参与新股申购、增发股票申购、要约收购类股票投资、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)以及权证等中国证监会允许基金投资的其它权益类金融工具。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的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	57,604.03
2	应收证券清算款	14,020,220.91
3	应收股利	-
4	应收利息	12,957,542.96
5	应收申购款	5,467.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,206.14
8	其他	-
9	合计	27,066,041.18

5.11.4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	113001	中行转债	6,208,422.00	2.90
2	113003	重工转债	957,880.00	0.45

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	192,232,131.03
报告期期间基金总申购份额	19,245,496.05
减:报告期期间基金总赎回份额	11,483,187.87
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	199,994,439.21

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未持有过本基金份额。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

一、《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方强化收益债券型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

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
2014年10月27日

东方央视财经50指数增强型证券投资基金

【2014】第三季度报告

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10月27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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方央视财经50指数
基金主代码	400018
交易代码	400018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月19日
报告期末基金份额总额	39,529,911.72份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对央视财经50指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值,分享中国经济的持续、稳定增长的成果。
投资策略	本基金将追求对股票的充分投资,股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于央视财经50指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的80%。本基金采用"指数化被动投资为主、主动性增强投资为辅"的投资策略来构建股票投资组合,指数化投资部分运用被动投资策略,采用全复制的方法,对成份股及备选成份股进行配置。主动性增强部分主要采取定量分析与定性分析相结合的方法,对央视财经50指数成份股进行权重优化,适度投资于优选的非成份股上市公司股票。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:央视财经50指数收益率×95%+ 银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-710,236.82
2.本期利润	4,937,025.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0996
4.期末基金资产净值	38,188,150.09
5.期末基金份额净值	0.9661

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本基金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。

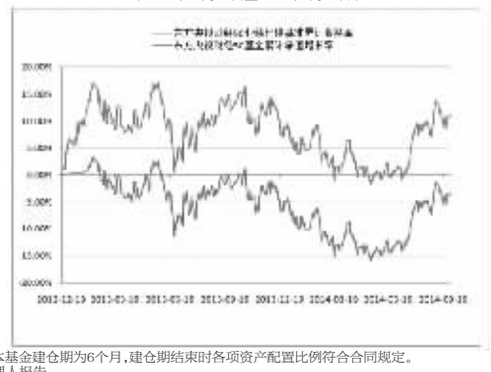
3.2 基金净值表现

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	10.82%	0.86%	10.02%	0.88%	0.80%	-0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

东方央视财经50指数增强型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月19日至2014年9月30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		
吴长凤(女士)	本基金基金经理	2012-12-19	-	12年	中国科学院数学与系统科学研究院应用数学研究所理学博士,北京大学光华管理学院金融工程工作站博士后,12年证券从业经历,曾任嘉实基金管理有限公司风险管理部高级经理,中国人寿富兰克林资产管理公司产品设计业务主管。2009年6月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任金融工程部经理,现任东方央视财经50指数增强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分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《东方央视财经50指数增强型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 公平交易专项说明

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。

本报告期内,未出现涉及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

2014年3季度,市场整体行情单边上扬,上证综指涨幅为15.40%,同期央视财经50指数涨幅为10.55%,本基金净值增长率为10.82%,超越业绩比较基准。成份股分红以及个股调整贡献了超额收益。

3季度,重要经济指标显示中国经济发展还很疲弱,内需不振,企业生产经营活动动力不足。8月份规模以上工业增加值同比增长6.9%,相比7月份下降2.1%,工业企业主营收入和利润总额增速双双大幅下滑,连续两个月明显回落,绝大多数行业景气程度都比较低,超出市场人士的普遍预期。官方中国制造业PMI指数和汇丰PMI指数最近3个月在50%荣枯线上波动,但单项指标显示社会需求依然没有明显起色;8月份进出口同比增速进一步下滑,尤其是进口额同比下降。

反映中观行业景气度的大宗商品价格上涨乏力,有色金属、钢铁、化工品价格整体持续低迷;动力煤价格连续持平,上涨动力不足;水泥价格旺季上调,但下游商品房销售回暖缓慢,百城价格指数显示房价仍在全面下降。生产资料价格通缩的局势还在持续,生活资料价格仍然温和上升。

3季度市场上涨的主要动力源于一系列政策的引导,在赚钱效应的刺激下,提高了投资者的风险偏好,风险溢价降低,增量资金进入场内,推动了本次中级反弹行情。

报告期内,投资组合满足基金合同的规定。本基金为指数增强型基金,在投资管理过程中,基本上围绕着标的指数成份股及其权重,运用定量投资策略,在有限偏离的基础上,进行个股投资和调整。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2014年7月1日至9月30日,本基金净值增长率为10.82%,业绩比较基准收益率为10.02%,高于业绩比较基准0.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮上涨行情始于沪港通的启动,随后各地房地产政策相继放松,中央连续进行货币投放,并调降正回购利率,在前期定向降准等一系列微刺激的基础上,进一步引导社会融资成本下降。5000亿元的常备借贷便利,更是维持了市场流动性的宽松。

近期政府出台的《中国人民银行 中国银行业监督管理委员会关于进一步做好住房金融服务工作的通知》,以及《关于加强地方政府性债务管理的意见》,不仅意在刺激住房市场的潜在需求,开辟房地产市场的融资渠道,同时还是降低社会融资成本的又一有力措施,为社会资金的合理配置提供保障。

影响市场走势的核心因素是投资者预期,投资者预期受各种经济金融指标、各项调控政策,以及市场走势本身的影响,预期的变化又影响着市场价格走势。社会融资成本的降低最终能否带动国内需求,促进企业生产经营活动的积极性,提高企业生产经营效益,从而激发整个经济发展的活力,将是对市场预期的验证,同时又形成新的市场预期。因此,面对着预期结果的不确定性,未来市场整体震荡的概率较大,但不乏出现以主题、概念为主的结构性行情。

§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	36,038,709.89	93.42
	其中:股票	36,038,709.89	93.42
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,505,060.85	6.49
7	其他资产	31,907.01	0.08
8	合计	38,575,677.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资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	采矿业	542,888.40	1.42
C	制造业	20,911,558.81	54.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	499,154.40	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,556,327.65	9.31
J	金融业	6,958,280.83	18.22
K	房地产业	1,290,799.80	3.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,505,543.28	3.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	110,422.72	0.29
S	综合	663,734.00	1.74
	合计	36,038,709.89	94.37

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	600887	伊利股份	77,361	2,003,649.90	5.25
2	600016	民生银行	299,316	1,867,731.84	4.89
3	601318	中国平安	41,417	1,712,178.78	4.48
4	600406	国电南瑞	89,535	1,533,734.55	4.02
5	002415	海康威视	73,993	1,425,845.11	3.73
6	000002	万 科A	140,610	1,290,799.80	3.38
7	000651	格力电器	43,218	1,198,435.14	3.14
8	002241	歌尔声学	42,000	1,157,100.00	3.03
9	002230	科大讯飞	36,075	1,129,147.50	2.96
10	002008	大族激光	56,000	1,094,800.00	2.87

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,116.37
2	应收证券清算款	10,894.67
3	应收股利	-
4	应收利息	601.88
5	应收申购款	692.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	12,601.78
8	其他	-
9	合计	31,907.01

5.11.4 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债券。

5.11.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	55,776,776.45
报告期期间基金总申购份额	578,903.52
减:报告期期间基金总赎回份额	16,825,768.25
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	39,529,911.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未持有过本基金份额。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内,受本基金所跟踪的标的指数的表现及持有人赎回等影响,本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况,基金管理人已持续关注并将采取适当措施。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、《东方央视财经50指数增强型证券投资基金基金合同》

二、《东方央视财经50指数增强型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

9.2 存放地点

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

9.3 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
2014年10月27日

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

【2014】第三季度报告

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:2014年10月27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2014年10月23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2014年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	东方增长中小盘混合
基金主代码	400015
交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月28日
报告期末基金份额总额	63,764,957.25份
投资目标	通过积极主动的投资管理,精选受益于经济转型下产业结构调整方向的、具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,努力把握市场趋势,积极进行适当范围内的大类资产配置调整,在严格控制风险的前提下,谋求本基金资产的长期资本增值。
投资策略	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
业绩比较基准	本基金采用"中证700指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%"作为投资业绩比较基准。 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比较基准的股票指数或债券指数时,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,无需召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金为混合型基金,股票部分主要投资于具有高成长潜力的中小市值上市公司股票,属于证券投资基金中预期风险和预期收益为中高风险等级的品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	2,853,078.27
2.本期利润	10,828,583.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.1632
4.期末基金资产净值	107,616,935.62
5.期末基金份额净值	1.6877

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	11.92%	0.89%	13.34%	0.55%	-1.42%	0.34%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

东方增长中小盘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12月28日至2014年9月30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		
呼振翼(先生)	本基金基金经理、投资决策委员会委员	2011-12-28	-	18年	对外经济贸易大学经济学硕士,18年证券从业经历,曾任高斯达期货公司投资经理,金鹏期货公司投资经理,海南证券研究员、期财证券研究员、投资理财部经理,民生证券研究员、行业组组长。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部研究员、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理。现任投资决策委员会委员、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合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分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《东方增长