

东方精选混合型开放式证券投资基金

2009 年半年度报告（正文）

2009 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇〇九年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

一、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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度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。

二、基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

三、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。

四、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。

五、本报告中财务资料未经审计。

六、本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6	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.....	33
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8	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.....	34

7.9	投资组合报告附注	34
8	基金份额持有人信息	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	35
9	开放式基金份额变动	35
10	重大事件揭示	36
10.1	基金份额持有人大会决议	36
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	36
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4	基金投资策略的改变	36
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	36
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	36
10.8	其他重大事件	38
11	影响投资者决策的其他重要信息	39
12	备查文件目录	39
12.1	备查文件目录	39
12.2	存放地点	40
12.3	查阅方式	40

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方精选混合型开放式证券投资基金
基金简称	东方精选混合
交易代码	400003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年1月11日
报告期末基金份额总额	8,690,910,826.88份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究中国经济高速增长的根本动力，重点投资于高速成长的优质上市公司，努力使基金份额持有人最大限度的分享中国经济的高速增长。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的大类资产配置和自下而上的精选个股、行业优化组成。在大类资产配置环节，本基金在综合宏观因素分析、资本市场、品种分析的基础上，应用本基金管理人的大盘趋势预测模型，结合本基金资产配置限制，制定最优的资产配置策略。
业绩比较基准	根据本基金的特征，选择中信标普300成长指数作为本基金股票部分的业绩比较基准，选择中信标普全债指数作为债券及货币市场工具的比较基准。 对于权重配置，作为一只混合型基金，股票最低仓位为30%，最高为95%，一般情况下为60%，因此本基金的业绩比较基准为：本基金业绩比较基准= 中信标普300成长指数*60% + 中信标普全债指数*40% 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，本基金可以变更业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种，其风险收益特征介于单纯的股票型基金、单纯的债券型基金与单纯的货币市场基金之间，同时其股票组合

	部分的风险收益特征也介于完全成长型股票组合与完全价值型股票组合之间。
--	------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕日	辛洁
	联系电话	010-66295888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	xinjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578	95568
传真		010-66578700	010-58560794
注册地址		北京市西城区金融大街 28 号 盈泰商务中心 2 号楼 16 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号 盈泰商务中心 2 号楼 16 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100140	100031
法定代表人		李维雄	董文标

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.orient-fund.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	东方基金管理有限责任公司
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

3 主要财务指标和基金净值表现

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	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
---------------	----------------------------------

本期已实现收益	-452,928,262.13
本期利润	2,848,004,229.36
加权平均基金份额本期利润	0.3277
本期加权平均净值利润率	45.29%
本期基金份额净值增长率	60.70%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
期末可供分配利润	1,520,269,567.52
期末可供分配基金份额利润	0.1749
期末基金资产净值	7,419,902,224.24
期末基金份额净值	0.8538
3.1.3 累计期末指标	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
基金份额累计净值增长率	280.47%

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期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	10.61%	0.80%	8.79%	0.81%	1.82%	-0.01%
过去三个月	22.64%	1.30%	15.72%	1.00%	6.92%	0.30%
过去六个月	60.70%	1.72%	41.92%	1.24%	18.78%	0.48%
过去一年	20.39%	2.23%	12.97%	1.58%	7.42%	0.65%
过去三年	147.63%	2.08%	63.36%	1.45%	84.27%	0.63%
自基金合同生效至今	280.47%	1.98%	107.02%	1.39%	173.45%	0.59%

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

东方精选混合型开放式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2006 年 1 月 11 日至 2009 年 6 月 30 日）



注：①根据《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票 30%~95%、债券 0%~65%、货币市场工具 5%~70%，基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。本报告期内，本基金严格执行了《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》的相关规定。

②本基金基金合同于 2006 年 1 月 11 日生效，截止 2009 年 6 月 30 日，本基金基金合同生效不满四年。

③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。

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

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司。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（证监基金字【2004】80 号）于 2004 年 6 月 11 日成立，是《中华人民共和国证券投资基金法》施行后成立的第一家基金管理公司。本公司注册资本 1 亿元人民币。本公司股东为东北证券有限责任公司，持有股份 46%；上海城投控股股份有限公司，持有股份 18%；中辉国华实业（集团）有限公司，持有股份 18%；河北省国有资产控股运营有限公司，持有股份 18%。截止 2009 年 6 月 30 日，本公司管理六只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精

选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长股票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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
付勇（先生）	本基金基金经理、本公司副总经理、投资决策委员会主任委员	2006-1-11	-	10 余年	北京大学金融学博士，会计学硕士，数学学士。曾在中国建设银行总行、华龙证券有限责任公司、东北证券有限责任公司工作；2004 年加盟东方基金管理有限公司，曾任发展规划部经理、投资总监助理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、总经理助理；现任本公司副总经理，公司投资决策委员会主任委员；2008 年 6 月 3 日起担任东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理。
王瑞（先生）	本基金基金经理助理	2009-5-13	-	6 年	北京大学理学硕士，6 年证券从业经历。曾在中国林科院等科研机构从事研究工作。2000 年 11 月起，先后就职于华泰证券有限责任公司、民生证券有限责任公司，任行业研究员。2007 年 4 月加盟东方基金管理有限公司，任研究员；2009 年 5 月起任本基金基金经理助理。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本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、《东方精选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。本基金无重大违法、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

本报告期内本基金运作符合公平交易制度，未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截至本报告期末，本公司管理的混合型开放式证券投资基金共有两只：本基金和东方龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方龙基金”）。本基金上半年度净值增长率高于东方龙基金 36.98%。现将业绩差异的原因说明如下：

（1）两只基金基金仓位不同导致了业绩差异。2009 年上半年度，截至 2009 年 6 月 30 日，本基金股票资产占基金净值比例为 92.55%，东方龙基金股票资产占基金净值比例为 37.21%，差距较大，而 2009 年二季度对市场具有代表意义的沪深 300 指数收益率为 26.27%；

（2）前十大重仓股不同导致了业绩差异。2009 年上半年度，截至 2009 年 6 月 30 日，本基金前十大重仓股对基金净值影响为 14.29%，东方龙基金前十大重仓股对基金净值影响为 7.50%。

项目	本基金指标值（%）	公平指标值（%）
上半年份额净值增长率	60.70	23.72
同期业绩比较基准增长率	41.92	50.35

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009 年上半年，沪深 A 股市场展开了强劲反弹，沪深 300 指数涨幅达到 26.27%，市场前期巨幅下跌所积累的做多动能得到了报复性的宣泄。我们认为，投资者对经济危机见底的预期以及市场估值水平明显偏低需要修正应该是反弹的初期动因，而经济基本面的回升则在随后的行情发展中扮演了主要角色。虽然一季度时市场还有一定程度的犹疑和反复，但在政府的巨额投资计划和一连串区域、行业振兴措施刺激下，国内各项宏观经济指标逐渐开始改善。到二季度时，经济复苏的趋势基本得到确认，市场也随之一路上扬，各板块普涨，行情几乎有些逼空意味。

上半年本基金净值增长率 60.70%，业绩比较基准收益率为 41.92%，超越业绩比较基准 18.78%，在银河证券分类体系的 72 只混合偏股型基金中名列第 5。

在经济危机的打击下，年初证券市场走势疲弱，但我们相信有利因素将逐渐增多，市场走出低

迷将是大概率事件，因而采取了较为积极的投资策略，保持了较高仓位的权益类资产，在行业配置基本均衡的同时，精选个股进行重仓，取得了较好的收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们总体上认为国内经济的复苏趋势将延续。中央政府力保经济增速的方针十分明确，强调将坚持积极的财政政策和适度宽松的货币政策。在此背景下，信贷增速虽可能下降但流动性依然充裕，政府主导的投资计划将继续推进，而且，政府还可能出台政策引导民间投资的积极性，下半年全社会固定资产投资增速仍将维持高位，未来国内居民消费增速也将稳中有升。另外，随着欧美国家经济见底，我国的对外贸易也将止跌并有所恢复。我们相信，年内各项经济指标将继续好转，GDP 年度保 8% 的目标有望完成。

下半年的行情我们认为依然可以谨慎看好。其一，宏观经济形势仍然是左右市场情绪的阶段性关键因素，而投资者对此仍抱有乐观预期；其二，中报业绩在预期之内，市场整体动态估值水平处于上升过程之中；其三，股市扩容、大小非减持等因素短期内尚未上升为市场担忧的焦点。不过，虽然我们对年内经济回升持乐观态度，但我们同时认为，未来国内经济复苏的持续性有赖于经济增长模式的转变，而这种转变是难以一蹴而就的，我们对未来经济复苏水平低于预期从而打击市场情绪的可能性保持警惕。

一切的开始都意味着结束，唯有忠诚会永远继续。短短的上半年很快就过去了，下半年的考验又接踵而至。回首本基金成立以来三年多的运作，往事并不如烟，有欢乐，也有痛苦，有成绩，也有不足。截止 2009 年 6 月 30 日，本基金基金合同生效以来的累计净值增长率为 280.47%，在所有可比基金中名列前茅。然而，在为我们的持有人带来回报的同时，我们也深深的知道：我们的成就，只因一路有你。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会公告【2008】38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本公司成立估值委员会，成员由总经理、副总经理、督察长、基金经理和金融工程部、交易部、登记清算部、监察稽核部部门经理或部门指定人员组成，上述人员均具备相关领域专业知识，两年以上基金行业工作经历，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规，具备较强的专业胜任能力。职责分工分别如下：

总经理、副总经理、督察长：参与估值小组的日常工作，主要负责决议基金投资组合中“长期停牌”等没有市价的股票所属行业和重估方法；基金经理：参与估值小组的日常工作，对采纳的估值方法和估值模型等发表意见和建议。交易部：提请估值委员会就相关估值事宜召开会议，并将适

用重估方法的股票明细提供给金融工程部；金融工程部：负责制定估值模型、假设及参数、确定参考行业指数并采集行业指数，据其计算估值公允价；登记清算部：负责估值事宜的内外部协调，依据金融工程部提供的公允价格对投资品种进行估值，计算基金资产净值及基金份额净值，并按照监管部门要求作好相关信息披露工作。监察稽核部：对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改。

在估值程序中，基金经理参与估值小组对相关停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

除基金经理外，参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截止本报告期末，本公司没有已签约的与估值有关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

中国民生银行根据《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》和《东方精选混合型开放式证券投资基金托管协议》，托管东方精选混合型开放式证券投资基金（以下简称东方精选基金）。

本半年度，中国民生银行在东方精选基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本半年度，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——东方基金管理有限责任公司在东方精选基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本半年度，基金管理人——东方基金管理有限责任公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由东方精选基金管理人——东方基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、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真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方精选混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.6.1	186,998,251.36	122,627,620.65
结算备付金		3,503,539.79	2,676,166.12
存出保证金		2,500,000.00	2,500,000.00
交易性金融资产	6.4.6.2	7,222,728,450.40	4,571,108,465.92
其中：股票投资		6,903,003,450.40	4,374,888,465.92
债券投资		319,725,000.00	196,220,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.6.3	-	-
应收证券清算款		26,377,540.74	3,890,874.03
应收利息	6.4.6.4	9,420,129.13	2,292,103.95
应收股利		502,186.07	-
应收申购款		6,356,553.86	937,701.27
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,458,386,651.35	4,706,032,931.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		23,268,014.48	4,557,709.11
应付管理人报酬		8,872,106.38	6,193,570.37
应付托管费		1,478,684.38	1,032,261.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.5	3,013,404.22	2,136,903.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	1,852,217.65	1,360,432.06
负债合计		38,484,427.11	15,280,876.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.7	3,190,932,282.87	3,241,560,105.21
未分配利润	6.4.6.8	4,228,969,941.37	1,449,191,950.02
所有者权益合计		7,419,902,224.24	4,690,752,055.23
负债和所有者权益总计		7,458,386,651.35	4,706,032,931.94

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8538 元，基金份额总额 8,690,910,826.88 份。

6.2 利润表

会计主体：东方精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 - 2008 年 6 月 30 日
一、收入		2,913,634,522.89	-4,819,461,039.51
1. 利息收入		5,979,336.37	9,887,060.81
其中：存款利息收入	6.4.6.9	702,045.95	2,275,721.42
债券利息收入		5,277,290.42	7,611,339.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-394,209,037.33	-225,766,232.54
其中：股票投资收益	6.4.6.10	-437,431,500.35	-274,153,084.57
债券投资收益		-	-556,274.32
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-14,350,520.31

股利收益	6. 4. 6. 11	43, 222, 463. 02	63, 293, 646. 66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 6. 12	3, 300, 932, 491. 49	-4, 606, 447, 159. 53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 6. 13	931, 732. 36	2, 865, 291. 75
二、费用（以“-”号填列）		-65, 630, 293. 53	-108, 279, 072. 56
1. 管理人报酬		-46, 342, 568. 43	-69, 969, 893. 15
2. 托管费		-7, 723, 761. 44	-11, 661, 648. 83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 6. 14	-11, 360, 225. 34	-26, 193, 219. 48
5. 利息支出		-	-326, 426. 05
其中：卖出回购金融资产支出		-	-326, 426. 05
6. 其他费用	6. 4. 6. 15	-203, 738. 32	-127, 885. 05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2, 848, 004, 229. 36	-4, 927, 740, 112. 07
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 848, 004, 229. 36	-4, 927, 740, 112. 07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方精选混合型开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3, 241, 560, 105. 21	1, 449, 191, 950. 02	4, 690, 752, 055. 23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2, 848, 004, 229. 36	2, 848, 004, 229. 36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-50, 627, 822. 34	-68, 226, 238. 01	-118, 854, 060. 35
其中：1. 基金申购款	428, 203, 448. 19	393, 850, 331. 20	822, 053, 779. 39
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-478, 831, 270. 53	-462, 076, 569. 21	-940, 907, 839. 74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,190,932,282.87	4,228,969,941.37	7,419,902,224.24
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 - 2008 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,333,109,106.17	7,849,384,290.84	11,182,493,397.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,927,740,112.07	-4,927,740,112.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	21,232,421.91	203,585,940.38	224,818,362.29
其中：1. 基金申购款	813,516,831.45	1,736,052,420.30	2,549,569,251.75
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-792,284,409.54	-1,532,466,479.92	-2,324,750,889.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,354,341,528.08	3,125,230,119.15	6,479,571,647.23

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

本基金根据 2005 年 9 月 7 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2005】153 号）和《关于募集东方精选混合型开放式证券投资基金的确认函》（基金部函【2006】4 号）的核准，进行募集。本基金合同于 2006 年 1 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 345,758,456.53 份基金单位，本基金为混合型开放式基金。本基金的基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》、《东方精选混合型开放式证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照中国财政部 2006 年颁布的《企业会计准则》（以下简称“新会计准则”）及应用指南、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》（以下简称“指引”）、中

国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和半年度报告（试行）》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号——会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合新会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期本基金会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表保持一致。

6.4.5 税项

（1）印花税

对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据自 2007 年 5 月 30 日起至 2008 年 4 月 23 日按 3‰ 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由现行 3‰ 调整为 1‰。从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让方按千分之一的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

（2）营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入，继续免征营业税和企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。根据国务院第 502 号令《国务院关于修改〈对储蓄存款利息所得征收个人所得税的实施办法〉的决定》，储蓄存款在 2007 年 8 月 15 日后孳生的利息所得，按照 5% 的比例税率征收个人所得税。根据财税【2008】132 号《财政部 国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，储蓄存款在 2008 年 10 月 9 日后（含 10 月 9 日）孳生的利息所得，暂免征收个人所得税。根据《财政部国家税务总局关于股息红利个人

所得税有关政策的通知》（财税【2005】102 号）和《财政部国家税务总局关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》（财税【2005】107 号）的规定，自 2005 年 6 月 13 日起对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	186,998,251.36
定期存款	-
其他存款	-
合计	186,998,251.36

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		6,963,757,745.04	6,903,003,450.40	-60,754,294.64
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	319,597,640.00	319,725,000.00	127,360.00
	合计	319,597,640.00	319,725,000.00	127,360.00
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,283,355,385.04	7,222,728,450.40	-60,626,934.64

6.4.6.3 买入返售金融资产

6.4.6.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.6.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	31,985.46

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,103.58
应收债券利息	9,386,271.23
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	453.86
其他	315.00
合计	9,420,129.13

6.4.6.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,013,179.22
银行间市场应付交易费用	225.00
合计	3,013,404.22

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00
应付赎回费	79,280.36
预提费用	272,937.29
合计	1,852,217.65

注：预提费用包括按日计提的审计费和信息披露费等。

6.4.6.7 实收基金

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,828,792,620.43	3,241,560,105.21
本期申购	1,166,264,181.42	428,203,448.19
本期赎回	-1,304,145,974.97	-478,831,270.53
本期末	8,690,910,826.88	3,190,932,282.87

注：申购包含红利再投资、基金转换转入的份额；赎回包含基金转换转出的份额。

6.4.6.8 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1, 998, 544, 882. 85	-549, 352, 932. 83	1, 449, 191, 950. 02
本期利润	-452, 928, 262. 13	3, 300, 932, 491. 49	2, 848, 004, 229. 36
本期基金份额交易产生的变动数	-25, 347, 053. 20	-42, 879, 184. 81	-68, 226, 238. 01
其中：基金申购款	201, 999, 300. 24	191, 851, 030. 96	393, 850, 331. 20
基金赎回款	-227, 346, 353. 44	-234, 730, 215. 77	-462, 076, 569. 21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1, 520, 269, 567. 52	2, 708, 700, 373. 85	4, 228, 969, 941. 37

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	634, 983. 49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	36, 657. 11
其他	30, 405. 35
合计	702, 045. 95

注：“其他”包括保证金存款利息收入、基金申购款利息收入。

6.4.6.10 股票投资收益

6.4.6.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3, 835, 206, 860. 06
卖出股票成本总额	-4, 272, 638, 360. 41
买卖股票差价收入	-437, 431, 500. 35

6.4.6.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	43, 222, 463. 02
基金投资产生的股利收益	-
合计	43, 222, 463. 02

6.4.6.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
1. 交易性金融资产	3,300,932,491.49
——股票投资	3,304,687,531.49
——债券投资	-3,755,040.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,300,932,491.49

6.4.6.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
基金赎回费收入	893,491.70
基金转换费收入	38,240.66
合计	931,732.36

注：基金赎回费收入包含基金转换费收入。

6.4.6.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
交易所市场交易费用	11,359,450.34
银行间市场交易费用	775.00
合计	11,360,225.34

6.4.6.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	6,301.03
债券账户维护费	9,000.00
合计	203,738.32

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

本基金本报告期末未发生需要说明的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、代销机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国民生银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东北证券股份有限公司	1,694,024,522.28	23.10%	-	-

6.4.9.1.2 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单元进行权证交易。

6.4.9.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2009年1月1日 - 2009年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券股份有限公司	1,410,354.13	23.02%	854,517.86	28.36%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的管理费	46,342,568.43	69,969,893.15
其中：当期已支付	37,470,462.05	61,016,817.61
期末未支付	8,872,106.38	8,953,075.54

注：①计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法为：每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数。

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送上月基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的托管费	7,723,761.44	11,661,648.83
其中：当期已支付	6,245,077.06	10,169,469.60
期末未支付	1,478,684.38	1,492,179.23

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法为：每日应计提

的基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送上月基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日 - 2009年6月30日	2008年1月1日 - 2008年6月30日
期初持有的基金份额	46,302,424.23	46,302,424.23
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	46,000,000.00	-
期末持有的基金份额	302,424.23	46,302,424.23
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.38%

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金对外公告的费率标准收取相应的手续费。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2009年1月1日 - 2009年6月30日		2008年1月1日 - 2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	186,998,251.36	634,983.49	154,331,442.14	2,086,771.14

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.11 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内未持有因认购/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、金融工程部和监察稽核部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.12.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变

现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，能够及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动，引起基金的财务状况和现金流量发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

2009 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	186,998,251.36	-	-	-	186,998,251.36
结算备付金	3,503,539.79	-	-	-	3,503,539.79
存出保证金	1,000,000.00	-	-	1,500,000.00	2,500,000.00
交易性金融资产	319,725,000.00	-	-	6,903,003,450.40	7,222,728,450.40
其中：股票投资	-	-	-	6,903,003,450.40	6,903,003,450.40
债券投资	319,725,000.00	-	-	-	319,725,000.00
应收证券清算款	-	-	-	26,377,540.74	26,377,540.74
应收利息	-	-	-	9,420,129.13	9,420,129.13
应收股利	-	-	-	502,186.07	502,186.07
应收申购款	6,356,553.86	-	-	-	6,356,553.86
资产总计	517,583,345.01	-	-	6,940,803,306.34	7,458,386,651.35
负债：					

应付赎回款	-	-	-	23,268,014.48	23,268,014.48
应付管理人报酬	-	-	-	8,872,106.38	8,872,106.38
应付托管费	-	-	-	1,478,684.38	1,478,684.38
应付交易费用	-	-	-	3,013,404.22	3,013,404.22
其他负债	-	-	-	1,852,217.65	1,852,217.65
负债合计	-	-	-	38,484,427.11	38,484,427.11
利率敏感度缺口	517,583,345.01	-	-	6,902,318,879.23	7,419,902,224.24

2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	122,627,620.65	-	-	-	122,627,620.65
结算备付金	2,676,166.12	-	-	-	2,676,166.12
存出保证金	1,000,000.00	-	-	1,500,000.00	2,500,000.00
交易性金融资产	196,220,000.00	-	-	4,374,888,465.92	4,571,108,465.92
其中：股票投资		-	-	4,374,888,465.92	4,374,888,465.92
债券投资	196,220,000.00	-	-	-	196,220,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,890,874.03	3,890,874.03
应收利息	-	-	-	2,292,103.95	2,292,103.95
应收申购款	937,701.27	-	-	-	937,701.27
资产总计	323,461,488.04	-	-	4,382,571,443.90	4,706,032,931.94
负债：					
应付赎回款	-	-	-	4,557,709.11	4,557,709.11
应付管理人报酬	-	-	-	6,193,570.37	6,193,570.37
应付托管费	-	-	-	1,032,261.75	1,032,261.75
应付交易费用	-	-	-	2,136,903.42	2,136,903.42
其他负债	-	-	-	1,360,432.06	1,360,432.06
负债合计	-	-	-	15,280,876.71	15,280,876.71
利率敏感度缺口	323,461,488.04	-	-	4,367,290,567.19	4,690,752,055.23

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	-202,010.00	-346,400.00
	市场利率下调 0.25%	202,420.00	347,600.00

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	6,903,003,450.40	93.03	4,374,888,465.92	93.27
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,903,003,450.40	93.03	4,374,888,465.92	93.27

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析：

假设	①根据期末时点本基金股票资产组合相对于基准中股票指数的 Beta 系数计算基金资产变动；②Beta 系数以市场过去 100 个交易日的的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步；③假定本基金的业绩比较基准中股票指数变动 5%，计算本基金资产净值变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：千元）	
		本期末	上年度末(2008 年 12 月 31 日)
	基金业绩比较基准上涨 5%	269,418.33	173,447.37
	基金业绩比较基准下跌 5%	-269,418.33	-173,447.37

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,903,003,450.40	92.55
	其中：股票	6,903,003,450.40	92.55

2	固定收益投资	319,725,000.00	4.29
	其中：债券	319,725,000.00	4.29
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	190,501,791.15	2.55
6	其他资产	45,156,409.80	0.61
7	合计	7,458,386,651.35	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采掘业	563,044,123.50	7.59
3	制造业	4,486,296,716.63	60.46
4	食品、饮料	863,297,641.97	11.63
5	纺织、服装、皮毛	182,033,272.86	2.45
6	木材、家具	-	-
7	造纸、印刷	87,959,171.58	1.19
8	石油、化学、塑胶、塑料	959,914,286.19	12.94
9	电子	40,188,400.00	0.54
10	金属、非金属	1,403,546,471.94	18.92
11	机械、设备、仪表	557,139,486.92	7.51
12	医药、生物制品	392,217,985.17	5.28
13	其他制造业	-	-
14	电力、煤气及水的生产和供应业	111,817,300.14	1.51
15	建筑业	89,372,584.20	1.20
16	交通运输、仓储业	92,131,909.23	1.24
17	信息技术业	393,136,834.42	5.30
18	批发和零售贸易	120,374,003.50	1.62
19	金融、保险业	296,775,997.81	4.00
20	房地产业	347,500,584.99	4.68
21	社会服务业	91,285,295.76	1.23
22	传播与文化产业	186,069,514.59	2.51
23	综合类	125,198,585.63	1.69
24	合计	6,903,003,450.40	93.03

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
1	000959	首钢股份	115,000,000	692,300,000.00	9.33
2	600688	S 上石化	82,182,297	684,578,534.01	9.23
3	000568	泸州老窖	14,599,769	419,013,370.30	5.65
4	600519	贵州茅台	942,289	139,468,194.89	1.88
5	600790	轻纺城	17,412,877	125,198,585.63	1.69
6	000402	金 融 街	8,813,680	121,276,236.80	1.63
7	600511	国药股份	6,781,634	120,374,003.50	1.62
8	600276	恒瑞医药	3,412,550	119,132,120.50	1.61
9	000063	中兴通讯	4,239,563	119,131,720.30	1.61
10	000983	西山煤电	3,951,716	118,156,308.40	1.59
11	000002	万 科 A	9,114,257	116,206,776.75	1.57
12	000869	张 裕 A	2,063,536	116,177,076.80	1.57
13	000651	格力电器	5,558,184	116,166,045.60	1.57
14	600900	长江电力	8,114,463	111,817,300.14	1.51
15	600048	保利地产	3,944,696	110,017,571.44	1.48
16	600036	招商银行	4,699,963	105,326,170.83	1.42
17	600880	博瑞传播	4,890,705	103,634,038.95	1.40
18	000898	鞍钢股份	7,779,948	102,617,514.12	1.38
19	600557	康缘药业	7,041,248	101,886,858.56	1.37
20	000933	神火股份	5,054,542	101,090,840.00	1.36
21	600066	宇通客车	8,175,383	100,230,195.58	1.35
22	000858	五 粮 液	5,017,926	99,003,679.98	1.33
23	600585	海螺水泥	2,339,909	98,603,765.26	1.33
24	601318	中国平安	1,939,940	95,949,432.40	1.29
25	600271	航天信息	6,035,866	95,909,910.74	1.29
26	601398	工商银行	17,619,999	95,500,394.58	1.29
27	600690	青岛海尔	7,189,784	95,336,535.84	1.28
28	600439	瑞贝卡	11,854,716	93,770,803.56	1.26
29	600888	新疆众和	7,239,176	92,951,019.84	1.25
30	600028	中国石化	8,710,082	92,849,474.12	1.25
31	601006	大秦铁路	8,699,897	92,131,909.23	1.24
32	600054	黄山旅游	5,773,896	91,285,295.76	1.23
33	600547	山东黄金	1,514,216	91,004,381.60	1.23
34	600718	东软集团	5,000,000	89,650,000.00	1.21
35	000895	双汇发展	2,489,870	89,635,320.00	1.21

36	600970	中材国际	3,058,610	89,372,584.20	1.20
37	600182	S 佳通	12,520,105	88,642,343.40	1.19
38	600588	用友软件	4,657,462	88,445,203.38	1.19
39	000423	东阿阿胶	4,929,879	88,442,029.26	1.19
40	002029	七 匹 狼	5,749,998	88,262,469.30	1.19
41	600308	华泰股份	8,189,867	87,959,171.58	1.19
42	600801	华新水泥	3,667,836	87,918,028.92	1.18
43	600019	宝钢股份	12,376,082	87,127,617.28	1.17
44	600596	新安股份	2,284,621	84,485,284.58	1.14
45	000401	冀东水泥	6,090,000	84,042,000.00	1.13
46	002022	科华生物	4,485,473	82,756,976.85	1.12
47	600831	广电网络	10,487,974	82,435,475.64	1.11
48	600761	安徽合力	8,063,466	82,166,718.54	1.11
49	600497	驰宏锌锗	4,089,929	80,939,694.91	1.09
50	600660	福耀玻璃	9,626,812	79,036,126.52	1.07
51	600123	兰花科创	2,239,961	79,003,424.47	1.06
52	000825	太钢不锈	10,280,000	78,950,400.00	1.06
53	600089	特变电工	4,244,877	76,577,581.08	1.03
54	600299	蓝星新材	6,479,824	74,712,370.72	1.01
55	600031	三一重工	1,729,914	49,769,625.78	0.67
56	000068	赛格三星	8,680,000	40,188,400.00	0.54
57	000527	美的电器	2,579,915	36,892,784.50	0.50
58	600871	S 仪化	4,019,847	27,495,753.48	0.37

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	328,472,980.01	7.00
2	002029	七 匹 狼	137,274,173.59	2.93
3	600690	青岛海尔	124,015,257.01	2.64
4	000527	美的电器	106,628,684.31	2.27
5	600718	东软集团	100,094,536.62	2.13
6	600439	瑞贝卡	94,138,103.06	2.01
7	000898	鞍钢股份	94,055,368.34	2.01
8	600308	XD 华泰股	92,789,315.34	1.98
9	600054	黄山旅游	89,933,649.88	1.92
10	600269	赣粤高速	88,714,651.62	1.89

11	601398	工商银行	87,055,565.85	1.86
12	600790	轻纺城	86,629,177.71	1.85
13	600031	三一重工	86,505,411.92	1.84
14	000895	双汇发展	82,832,935.70	1.77
15	600801	华新水泥	81,206,736.63	1.73
16	600123	兰花科创	80,972,444.25	1.73
17	601318	中国平安	79,168,383.13	1.69
18	000825	太钢不锈	78,641,470.27	1.68
19	600497	驰宏锌锗	77,677,714.34	1.66
20	600631	百联股份	77,149,072.77	1.64

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000800	一汽轿车	449,297,101.82	9.58
2	600635	大众公用	249,100,330.71	5.31
3	000527	美的电器	139,583,741.04	2.98
4	600312	平高电气	122,299,793.52	2.61
5	600166	福田汽车	118,127,577.26	2.52
6	600005	武钢股份	115,180,048.36	2.46
7	600328	兰太实业	114,206,858.22	2.43
8	600806	昆明机床	112,173,999.53	2.39
9	600686	金龙汽车	111,749,119.57	2.38
10	600690	青岛海尔	108,782,193.71	2.32
11	000629	攀钢钢钒	107,399,684.26	2.29
12	000024	招商地产	98,482,015.15	2.10
13	600000	浦发银行	96,334,989.67	2.05
14	600631	百联股份	94,397,864.83	2.01
15	600547	山东黄金	93,984,512.41	2.00
16	000488	晨鸣纸业	90,832,303.22	1.94
17	002029	七匹狼	85,967,288.25	1.83
18	600269	赣粤高速	85,214,721.30	1.82
19	000951	中国重汽	84,809,622.83	1.81
20	000970	中科三环	82,781,641.19	1.76

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,498,076,304.18
卖出股票的收入（成交）总额	3,835,206,860.06

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	319,725,000.00	4.31
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	319,725,000.00	4.31

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801106	08 央票 106	2,000,000	193,440,000.00	2.61
2	0801114	08 央行票据 114	500,000	48,660,000.00	0.66
3	0801110	08 央票 110	500,000	48,480,000.00	0.65
4	0801112	08 央行票据 112	300,000	29,145,000.00	0.39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金所持有的中兴通讯（000063）于 2008 年 10 月 7 日对外公告了被处罚的事宜。财政部驻深圳市财政监察专员办事处向中兴通讯送达了《行政处罚决定书》（财驻深监【2008】119 号），对中兴通讯行政处罚人民币 16 万元整，及要求公司补缴企业所得税人民币 380 万元。中兴通讯已在报告期内缴纳上述行政处罚款和企业所得税补缴款。

决策依据及投资程序：

(1) 研究部对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、金融工程部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金经过研究认为中兴通讯具有投资价值，在投资过程中严格遵守了上述投资程序。

除上述情况外，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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,500,000.00
2	应收证券清算款	26,377,540.74

3	应收股利	502,186.07
4	应收利息	9,420,129.13
5	应收申购款	6,356,553.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,156,409.80

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
365,191	23,798.26	39,256,343.30	0.45%	8,651,654,483.58	99.55%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	292,218.87	0.00%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年1月11日）基金份额总额	345,758,456.53
报告期期初基金份额总额	8,828,792,620.43
报告期期间基金总申购份额	1,166,264,181.42
报告期期间基金总赎回份额	1,304,145,974.97
报告期期间基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	8,690,910,826.88

注：基金总申购份额含红利再投、基金转换转入的份额，基金总赎回份额含基金转换转出的份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经本公司董事会决议并经中国证券监督管理委员会核准，吕日先生自 2009 年 2 月 11 日起担任本公司督察长，孙晔伟先生不再担任公司督察长职务；根据股东提案、并经本公司股东会 2009 年 3 月 13 日决议，聘任邱建武先生担任本公司第二届董事会非独立董事，石运兴先生不再担任本公司非独立董事；2009 年 3 月 13 日本公司董事会批准了程红女士的辞职申请，同意程红女士辞去公司总经理职务，决定由公司董事长李维雄先生代为履行公司总经理职务，上述事项已经中国证券监督管理委员会核准；经本公司董事会决议并经中国证券监督管理委员会核准，单宇先生自 2009 年 8 月 11 日起担任本公司总经理。

本公司已分别于 2009 年 2 月 12 日、2009 年 3 月 28 日、2009 年 8 月 18 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站披露了上述高级管理人员变更的相关情况，并在本基金及本公司管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述董事变更情况。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券股份有限公司	2	1,694,024,522.28	23.10%	-	-
中信证券股份有限公司	1	1,076,447,462.04	14.68%	-	-

申银万国证券股份有限	1	1,053,970,804.50	14.37%	-	-
中银国际证券有限责任	1	1,010,397,386.86	13.78%	-	-
中国国际金融有限公司	2	963,741,954.60	13.14%	-	-
光大证券股份有限公司	1	521,898,185.21	7.12%	-	-
招商证券股份有限公司	1	460,360,747.04	6.28%	-	-
山西证券股份有限公司	1	390,725,881.92	5.33%	-	-
联合证券股份有限公司	1	161,716,219.79	2.21%	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-
银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-
		回购交易		权证交易	
		成交金额		占当期权证成交总额的比例	
		占当期回购成交总额的比例		佣金	
		成交金额		占当期佣金总量的比例	
东北证券股份有限公司	-	-	-	1,410,354.13	23.02%
中信证券股份有限公司	-	-	-	914,970.51	14.93%
申银万国证券股份有限	-	-	-	895,868.62	14.62%
中银国际证券有限责任	-	-	-	858,832.59	14.02%
中国国际金融有限公司	-	-	-	783,046.67	12.78%
光大证券股份有限公司	-	-	-	424,046.93	6.92%
招商证券股份有限公司	-	-	-	391,304.49	6.39%
山西证券股份有限公司	-	-	-	317,469.19	5.18%
联合证券股份有限公司	-	-	-	131,395.57	2.14%
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-
银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序：

本基金管理人选择代理所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下 7 个方面：① 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③ 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚；④ 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及

其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

本基金管理人选择代理所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：①券商服务评价；②拟定租用对象：由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；③上报批准：研究部将拟定租用对象按程序报公司总经理办公会研究通过后，基金的主交易单元报董事会批准租用；其他交易单元报公司董事长，由董事长根据董事会授权批准租用；④签约：在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式六份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存监察稽核部备案，报中国证券监督管理委员会备案并按照规定在基金的年度报告和半年度报告中公告相关内容。

本报告期内，交易单元的选择标准和程序、基金租用券商交易单元情况未发生变更。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于更改本基金业绩比较基准的公告	指定报刊、网站	2009-1-14
2	本基金基金合同（2009 年 1 月 18 日修订）	网站	2009-1-19
3	本基金 2008 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2009-1-22
4	本公司关于旗下基金持有“000668 荣丰控股”恢复“市值估值法”的公告	指定报刊、网站	2009-2-2
5	本公司关于旗下基金增加招商证券股份有限公司为代销机构并同时开通定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-2-6
6	本公司关于旗下基金在中信银行股份有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-2-9
7	本公司关于变更督察长的公告	指定报刊、网站	2009-2-12
8	本公司关于赎回旗下东方精选混合型开放式证券投资基金的公告	指定报刊、网站	2009-2-14
9	本基金招募说明书（更新）摘要（2008 年第 2 号）	指定报刊、网站	2009-2-24
10	本基金招募说明书（更新）（2008 年第 2 号）	网站	2009-2-24
11	本公司关于降低旗下基金定期定额投资业务起始金额的公告	指定报刊、网站	2009-2-24
12	本公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	指定报刊、网站	2009-2-27
13	本公司关于旗下基金开展农行金穗卡网上交易定期定额投资业务四折优惠活动的公告	指定报刊、网站	2009-3-5
14	本公司关于旗下基金增加交通银行股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊、网站	2009-3-17
15	更正公告	指定报刊、网站	2009-3-21
16	农行金穗卡网上直销系统暂停服务的提示公告	指定报刊、网站	2009-3-25

17	本公司关于增加工商银行股份有限公司代销旗下基金的公告	指定报刊、网站	2009-3-27
18	本公司关于总经理辞职及代行总经理职务人员的公告	指定报刊、网站	2009-3-28
19	本公司关于新版网上交易平台开通上线的公告	指定报刊、网站	2009-3-30
20	本关于旗下基金开通招商银行网上交易的公告	指定报刊、网站	2009-3-30
21	本公司关于网上交易平台开通招商银行定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-3-30
22	本基金 2008 年年度报告(2008 年 12 月 31 日)	网站	2009-3-31
23	本基金 2008 年年度报告摘要(2008 年 12 月 31 日)	指定报刊、网站	2009-3-31
24	本公司旗下部分基金参加中国建设银行股份有限公司开展的电话银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2009-4-9
25	本基金 2009 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2009-4-20
26	本公司关于旗下基金增加齐鲁证券有限公司为代销渠道的公告	指定报刊、网站	2009-4-30
27	本公司关于旗下基金增加江海证券有限公司为代销渠道并参与其网上申购费率优惠的公告	指定报刊、网站	2009-5-5
28	本公司关于旗下基金持有“600900 长江电力”恢复“市值估值法”公告	指定报刊、网站	2009-5-19
29	本公司关于旗下基金在中信建投证券有限责任和齐鲁证券有限公司开通基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2009-5-22
30	本公司关于旗下部分基金参加兴业银行股份有限公司开展的基金定投申购费率优惠的公告	指定报刊、网站	2009-6-8
31	本公司关于延长旗下基金在中国邮政储蓄银行定期定额投资申购费率优惠时间的公告	指定报刊、网站	2009-6-26
32	本公司关于旗下基金在齐鲁证券开通定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-6-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方精选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、基金份额净值及其他临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，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，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

12.3 查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方基金管理有限责任公司

二〇〇九年八月二十七日