

**东方策略成长股票型开放式
证券投资基金
2009 年年度报告摘要**

2009 年 12 月 31 日

**基金管理人：东方基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一〇年三月二十七日**

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 26 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，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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

立信会计师事务所为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。

本报告期自 2009 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

基金简称	东方策略成长股票	
基金主代码	400007	
交易代码	400007(前端)	400008(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 6 月 3 日	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	59,542,641.32 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司,分享国民经济快速发展带来的成长性收益,追求管理资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析宏观经济发展战略,确定基金重点投资的行业,自上而下配置资产,自下而上精选证券。本基金从重点投资的行业中寻找成长性公司,通过成长风险值控制成长风险,以合理的价格投资于优秀公司和/或相对价值低估的其他公司;通过组合投资有效分散风险,谋求基金资产长期稳定的增长。
业绩比较基准	本基金的股票业绩比较基准是中信标普 300 指数;债券业绩比较基准是中信标普全债指数。 本基金的业绩比较基准为: 中信标普 300 指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30% 随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适合本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进

	行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
风险收益特征	本基金属于成长型股票基金，为证券投资基金中的高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕日	尹东
	联系电话	010-66295888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	yindong@ccb.com
客户服务电话		010-66578578	010-67595096
传真		010-66578700	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§ 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	2009 年	2008 年 6 月 3 日至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	37,774,770.60	-14,081,989.37
本期利润	57,863,852.68	-26,524,883.05
加权平均基金份额本期利润	0.6249	-0.1357
本期基金份额净值增长率	67.65%	-14.61%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3757	-0.1461

期末基金资产净值	85,243,820.18	127,893,310.22
期末基金份额净值	1.4316	0.8539

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。

④本基金基金合同于 2008 年 6 月 3 日生效。

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
过去三个月	17.80%	1.10%	13.57%	1.23%	4.23%	-0.13%
过去六个月	18.90%	1.30%	10.01%	1.49%	8.89%	-0.19%
过去一年	67.65%	1.21%	61.47%	1.43%	6.18%	-0.22%
自基金合同生效起至今	43.16%	1.59%	4.85%	1.73%	38.31%	-0.14%

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

东方策略成长股票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

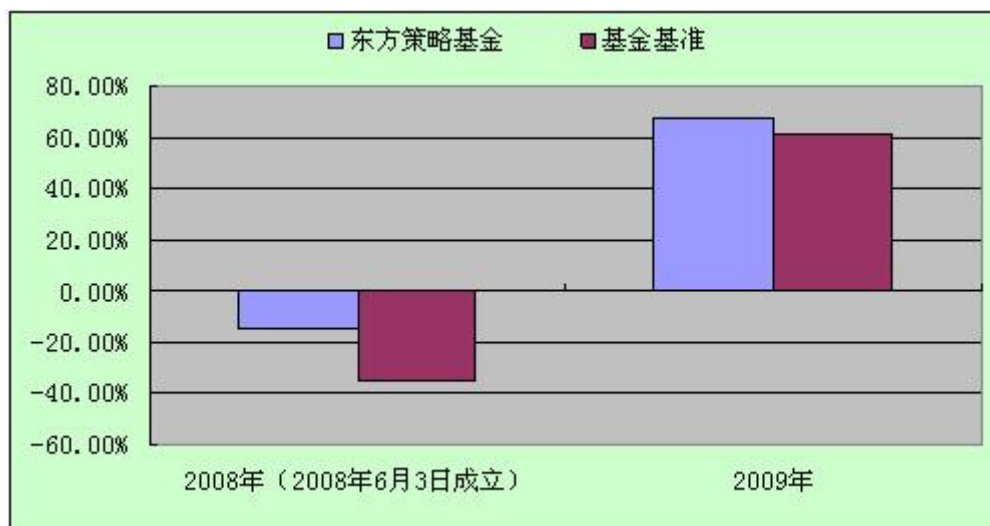
（2008 年 6 月 3 日至 2009 年 12 月 31 日）



3.2.3 自基金合同生效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

东方策略成长股票型开放式证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2008 年 6 月 3 日，截至 2008 年末，本基金成立不满一年。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本报告期及上年度可比期间 2008 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日，本基金未进行利润分配。

§ 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股份有限公司，持有股份 46%；中辉国华实业（集团）有限公司，持有股份 18%；上海城投控股股份有限公司，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 12 月 31 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		
于鑫 (先生)	本基金基金经理、投资决策委员会委员	2008-06-03	-	8 年	清华大学 MBA, CFA; 具有基金从业资格, 曾任世纪证券有限公司资产管理部投资经理; 2005 年至今在本公司工作, 曾任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理, 2007 年 7 月 20 日至 2008 年 9 月 20 日担任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理; 2006 年 8 月 2 日至 2006 年 12 月 29 日、2007 年 8 月 14 日至今担任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理; 2008 年 9 月 20 日至今担任东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理。
付勇 (先生)	本基金基金经理、本公司副总经理	2008-06-03	2010-2-12	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

	理、投资决策委员会主任委员				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责任公司，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、本公司副总经理，2006 年 1 月 11 日至 2010 年 2 月 12 日担任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。
--	---------------	--	--	--	---

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、《东方策略成长股票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

本报告期内，本公司共管理两只股票型基金，分别为东方策略成长股票型开放式证券投资基金（本基金）和东方核心动力股票型开放式证券投资基金（以下简称“东方核心动力基金”）。三季度，本基金与东方核心动力基金业绩差异超过 5%，主要原因在于东方核心动力基金成立于 2009 年 6 月 24 日，三季度处于建仓期，期间基金仓位经历了由低到高的变动过程，特别是建仓初期仓位较低，未能充分分享市场的上涨，导致两只基金业绩差异明显。四季度，由于两只基金的行业配置、个股选择均有较大不同，本基金四季度净值增长率略高于东方核心动力基金净值增长率。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金投资运作未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金的投资主要以业绩明确、估值较低的行业为主，没有参与主题投资。下半年适当参与了优质新股的网下发行，并适当进行了波段操作。

上半年，本基金主要选择了银行、保险、食品饮料、医药、地产等业绩明确、有确定增长空间的行业。随着市场的上涨，本基金降低了在地产、医药等行业的投资比例，增持了港口、制造业等受益于出口复苏的行业。进入三季度后，本基金积极参与网下优质新股的发行，对持仓品种也进行了调整，增持了钢铁、化工等业绩复苏的行业，并适当进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2009 年基金净值增长率为 67.65%，业绩比较基准收益率为 61.47%，高于业绩比较基准 6.18%，弱于沪深 300 指数的收益率。总的看，本基金上半年业绩表现一般，下半年的业绩表现相对较好。

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 2010 年，我们持审慎乐观的态度。一方面，我们认为市场不会继续大幅度上涨，另一方面，受益于宏观经济结构性调整的企业以及部分高增长的企业仍将有不错的表现。

从宏观经济层面看，金融危机已经过去，全球经济以及中国经济已重新回到正常的增长轨道，内需和外需将成为促进中国经济发展的推动力，优质企业的利润也将同步增长；随着经济的企稳，经济增长的结构将发生转变，一些新兴产业将出现爆发性的增长；但对资产泡沫的担忧可能会影响一部分行业的表现；比较大规模的融资对市场也会起到一定的负面作用。

在操作上，本基金将继续持有那些业绩优良、估值便宜、成长确定的行业龙头，并加强对新兴产业上市公司、新兴区域上市公司的研究，密切关注制度变革可能带来的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，定期和实时监察，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监

察稽核工作包括：（一）开展对公司各项业务的日常监管业务，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的合法合规。（二）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强了基金投资监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（三）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（四）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。2010 年本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 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，本基金管理人成立了东方基金管理有限公司估值委员会（以下简称“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、监察稽核部负责人组成，估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经验，具备良好的专业知识和专业胜任能力，具有绝对的独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。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，负责对基金投资组合中“长期停牌”等没有市价的股票所属行业和重估方法形成最后决议；

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，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

交易部：负责提议召开估值委员会会议，并将已形成决议的重估方法所适用的金融产品明细提供金融工程部；

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。

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。

4.8 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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，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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

信会师报字[2010]第80307号

东方策略成长股票型开放式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的东方策略成长股票型开放式证券投资基金（以下简称“东方策略基金”）财务报表，包括2009年12月31日的资产负债表，2009年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基

金行业实务操作的有关规定编制财务报表是东方策略基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，东方策略基金的财务报表已经按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了东方策略基金2009年12月31日的财务状况以及2009年度的经营成果和基金净值变动情况。

立信会计师事务所有限公司

中国注册会计师：王云成 王友业

上海市南京路61号新黄浦金融大厦4层

二〇一〇年三月二十五日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方策略成长股票型开放式证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资产：		
银行存款	26,257,704.16	39,785,079.00
结算备付金	278,050.04	224,772.78
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	59,200,855.55	86,994,999.71
其中：股票投资	55,214,055.55	86,994,999.71
基金投资	-	-
债券投资	3,986,800.00	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	760,474.91	1,446,770.83
应收利息	13,676.56	10,096.82
应收股利	-	-
应收申购款	14,134.05	9,875.60
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	86,774,895.27	128,721,594.74
负债和所有者权益	本期末 2009年12月31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	253,377.51	-
应付赎回款	671,260.31	98,864.40
应付管理人报酬	103,919.46	166,453.08
应付托管费	17,319.90	27,742.20
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	149,380.72	142,261.96
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	335,817.19	392,962.88
负债合计	1,531,075.09	828,284.52
所有者权益：		

实收基金	59,542,641.32	149,774,753.47
未分配利润	25,701,178.86	-21,881,443.25
所有者权益合计	85,243,820.18	127,893,310.22
负债和所有者权益总计	86,774,895.27	128,721,594.74

注：(1) 报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4316 元，基金总份额 59,542,641.32 份。

(2) 本基金基金合同于 2008 年 6 月 3 日生效，本报告 2008 年实际报告期为 2008 年 6 月 3 日至 2008 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：东方策略成长股票型开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年6月3日至2008年12月31日
一、收入	61,054,766.42	-22,740,469.39
1. 利息收入	245,495.50	390,621.64
其中：存款利息收入	235,295.72	375,599.28
债券利息收入	10,199.78	163.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	14,858.50
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	40,597,253.92	-10,982,200.19
其中：股票投资收益	39,687,451.43	-11,978,759.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	18,868.18	-8,711.42
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	8,871.13	42,965.90
股利收益	882,063.18	962,304.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	20,089,082.08	-12,442,893.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	122,934.92	294,002.84
减：二、费用	3,190,913.74	3,784,413.66
1. 管理人报酬	1,565,420.63	1,556,012.82
2. 托管费	260,903.32	259,335.44
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	956,503.10	1,813,610.50
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	408,086.69	155,454.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	57,863,852.68	-26,524,883.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	57,863,852.68	-26,524,883.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方策略成长股票型开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31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）	149,774,753.47	-21,881,443.25	127,893,310.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,863,852.68	57,863,852.68
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）	-90,232,112.15	-10,281,230.57	-100,513,342.72
其中：1. 基金申购款	18,451,681.05	4,192,024.63	22,643,705.68
2. 基金赎回款	-108,683,793.20	-14,473,255.20	-123,157,048.40
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）	59,542,641.32	25,701,178.86	85,243,820.18
项目	上年度可比期间 2008年6月3日至2008年12月31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）	329,346,406.20	-	329,346,406.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-26,524,883.05	-26,524,883.05

润)			
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)	-179,571,652.73	4,643,439.80	-174,928,212.93
其中: 1. 基金申购款	62,492,505.17	-2,218,786.09	60,273,719.08
2. 基金赎回款	-242,064,157.90	6,862,225.89	-235,201,932.01
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)	149,774,753.47	-21,881,443.25	127,893,310.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告序号从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：单宇，主管会计工作负责人：张蓉梅，会计机构负责人：李景岩

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方策略成长股票型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2008 年 3 月 21 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】407 号）和《关于同意东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集时间安排的函》（基金部函【2008】121 号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》发起设立。本基金为股票型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 329,260,029.20 元人民币，业经天华中兴会计师事务所有限公司“天华中兴验字【2008】第 1058-01 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》于 2008 年 6 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 329,346,406.20 份基金单位，其中认购资金利息折合 86,377.00 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券

以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

7.4.2 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 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、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 2 号—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》、《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。

7.4.3 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《企业会计准则》及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告保持一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2005】107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税【2007】84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年04月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。对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。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，2007 年05 月30 日之前按0.1%的税率，自2007 年05 月30 日起至2008 年04 月23 日止按0.3%的税率由交易双方各自缴纳证券(股票)交易印花税；自2008 年04 月24 日起至2008 年09 月18 日止按0.1%的税率由交易双方各自缴纳证券(股票)交易印花税；自2008 年09 月19 日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

7.4.7.1 与基金存在重大利益关系的主要关联方的名称及关联关系

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
中辉国华实业（集团）有限公司	本基金管理人股东
上海城投控股股份有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
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
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 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。

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年6月3日（基金合同生效日）至2008年12月31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	164,645,338.89	27.77%	510,229,804.56	54.42%

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间 2008 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 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日至2009年12月31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	136,113.39	27.45%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2008年6月3日（基金合同生效日）至2008年12月31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	430,616.15	54.51%	97,599.68	68.61%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年6月3日（基金合同生效日） 至2008年12月31日
当期发生的基金应支付 的管理费	1,565,420.63	1,556,012.82
其中：支付销售机构的 客户维护费	260,357.01	180,481.91

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计算，具体计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年6月3日（基金合同生效日） 至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	260,903.32	259,335.44

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间 2008 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日

	月 31 日	效日) 至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日 (2008 年 6 月 3 日) 持有的基金份额	-	9,001,722.50
期初持有的基金份额	9,001,722.50	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,001,722.50	9,001,722.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.12%	6.01%

注: 基金管理人投资本基金时, 本基金按照基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费, 并履行了信息披露义务。

7.4.8.4.2 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

本期末及上年度末, 除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2008 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	26,257,704.16	232,507.95	39,785,079.00	365,176.59

7.4.8.6 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 2008 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2008 年 12 月 31 日, 本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末 (2009 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601139	深圳燃气	2009-12-15	2010-03-25	认购	6.95	16.78	10,924	75,921.80	183,304.72	-

				新股						
002302	西部建设	2009-10-22	2010-02-03	认购 新股	15.00	31.79	7,319	109,785.00	232,671.01	-
002305	南国置业	2009-10-29	2010-02-08	认购 新股	12.30	19.57	7,402	91,044.60	144,857.14	-
002307	北新路桥	2009-11-05	2010-02-11	认购 新股	8.58	27.40	9,490	81,424.20	260,026.00	-
002316	键桥通讯	2009-12-01	2010-03-09	认购 新股	18.80	31.13	5,992	112,649.60	186,530.96	-
002319	乐通股份	2009-12-03	2010-03-11	认购 新股	13.70	31.28	8,164	111,846.80	255,369.92	-
002321	华英农业	2009-12-09	2010-03-16	认购 新股	16.98	26.61	11,101	188,494.98	295,397.61	-
002328	新朋股份	2009-12-22	2010-03-30	认购 新股	19.38	26.55	12,135	235,176.30	322,184.25	-
002330	得利斯	2009-12-25	-	认购 新股	13.18	13.18	11,040	145,507.20	145,507.20	可流 通日 未定
002332	仙琚制药	2009-12-30	-	认购 新股	8.20	8.20	13,143	107,772.60	107,772.60	可流 通日 未定
300013	新宁物流	2009-10-15	2010-02-01	认购 新股	15.60	32.75	8,786	137,061.60	287,741.50	-
300021	大禹节水	2009-10-19	2010-02-03	认购 新股	14.00	41.20	30,612	428,568.00	1,261,214.40	-
300032	金龙机电	2009-12-18	2010-03-25	认购 新股	19.00	29.80	14,709	279,471.00	438,328.20	-
300039	上海凯宝	2009-12-28	2010-01-08	认购 新股	38.00	38.00	500	19,000.00	19,000.00	-
300040	九洲电气	2009-12-28	2010-01-08	认购 新股	33.00	33.00	500	16,500.00	16,500.00	-
300041	回天胶业	2009-12-28	2010-01-08	认购 新股	36.40	36.40	500	18,200.00	18,200.00	-

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发债券而于期末流通受限的债券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	55,214,055.55	63.63
	其中：股票	55,214,055.55	63.63
2	固定收益投资	3,986,800.00	4.59
	其中：债券	3,986,800.00	4.59
	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	26,535,754.20	30.58
6	其他各项资产	1,038,285.52	1.20
7	合计	86,774,895.27	100.00

8.2 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 (%)
A	农、林、牧、渔业	800,797.61	0.94

B	采掘业	-	-
C	制造业	19,495,792.62	22.87
C0	食品、饮料	2,160,907.20	2.53
C1	纺织、服装、皮毛	2,320,887.04	2.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	102,200.00	0.12
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,749,319.92	5.57
C5	电子	438,328.20	0.51
C6	金属、非金属	4,964,855.26	5.82
C7	机械、设备、仪表	2,846,414.40	3.34
C8	医药、生物制品	1,912,880.60	2.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	344,704.72	0.40
E	建筑业	2,117,026.00	2.48
F	交通运输、仓储业	10,015,441.50	11.75
G	信息技术业	1,337,030.96	1.57
H	批发和零售贸易	1,448,555.00	1.70
I	金融、保险业	16,296,950.00	19.12
J	房地产业	1,041,257.14	1.22
K	社会服务业	639,500.00	0.75
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,677,000.00	1.97
	合计	55,214,055.55	64.77

8.3 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

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	601328	交通银行	460,000	4,301,000.00	5.05
2	600036	招商银行	180,000	3,249,000.00	3.81
3	000022	深赤湾A	200,000	3,026,000.00	3.55
4	600016	民生银行	350,000	2,768,500.00	3.25
5	000629	攀钢钢钒	350,000	2,688,000.00	3.15
6	600269	赣粤高速	300,000	2,607,000.00	3.06
7	601318	中国平安	40,000	2,203,600.00	2.59

8	601628	中国人寿	65,000	2,059,850.00	2.42
9	600664	哈药股份	90,000	1,662,300.00	1.95
10	000088	盐田港	200,000	1,662,000.00	1.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值前 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	000002	万科A	6,454,821.52	5.05
2	600036	招商银行	5,258,050.00	4.11
3	000022	深赤湾A	5,050,909.86	3.95
4	600269	赣粤高速	4,970,544.92	3.89
5	601328	交通银行	4,867,662.00	3.81
6	600009	上海机场	4,856,111.00	3.80
7	601390	中国中铁	4,362,245.00	3.41
8	600383	金地集团	4,243,252.92	3.32
9	002154	报喜鸟	4,001,246.40	3.13
10	601668	中国建筑	3,863,060.00	3.02
11	601006	大秦铁路	3,528,880.00	2.76
12	000088	盐田港	3,401,664.68	2.66
13	600067	冠城大通	3,130,266.53	2.45
14	601601	中国太保	3,006,398.00	2.35
15	000629	攀钢钢钒	2,990,195.45	2.34
16	601766	中国南车	2,972,888.12	2.32
17	000089	深圳机场	2,970,301.27	2.32
18	000488	晨鸣纸业	2,751,383.00	2.15
19	600966	博汇纸业	2,743,009.70	2.14
20	600016	民生银行	2,591,815.41	2.03

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。

②“买入金额”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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%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	601601	中国太保	9,914,437.45	7.75
2	601318	中国平安	9,887,093.17	7.73
3	600036	招商银行	9,728,529.56	7.61
4	600269	赣粤高速	9,385,807.24	7.34
5	600383	金地集团	8,641,787.27	6.76
6	601328	交通银行	7,772,160.93	6.08
7	000002	万 科 A	7,289,784.74	5.70
8	000959	首钢股份	6,724,141.25	5.26
9	600009	上海机场	5,963,950.93	4.66
10	600887	*ST 伊利	5,959,951.35	4.66
11	600664	哈药股份	5,945,402.79	4.65
12	000800	一汽轿车	5,521,058.50	4.32
13	600016	民生银行	5,145,555.00	4.02
14	600583	海油工程	4,931,620.90	3.86
15	002154	报 喜 鸟	4,866,228.54	3.80
16	601398	工商银行	4,332,500.00	3.39
17	600067	冠城大通	4,240,401.67	3.32
18	601390	中国中铁	4,197,895.23	3.28
19	000659	珠海中富	3,653,843.50	2.86
20	600028	中国石化	3,500,367.00	2.74
21	000089	深圳机场	3,409,606.75	2.67
22	601766	中国南车	3,398,933.32	2.66
23	000531	穗恒运 A	3,361,871.59	2.63
24	000629	攀钢钢钒	3,286,343.33	2.57
25	600858	银座股份	3,269,471.56	2.56
26	000488	晨鸣纸业	3,135,361.01	2.45
27	600500	中化国际	3,103,290.70	2.43
28	000063	中兴通讯	2,851,775.74	2.23
29	600308	华泰股份	2,825,582.59	2.21
30	000026	飞亚达 A	2,711,713.12	2.12
31	600966	博汇纸业	2,650,356.53	2.07
32	600790	轻纺城	2,646,872.00	2.07
33	601006	大秦铁路	2,561,691.76	2.00

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“卖出金额”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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	253,121,163.20
卖出股票的收入（成交）总额	344,644,002.87

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。

8.5 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	3,986,800.00	4.68
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	3,986,800.00	4.68

8.6 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	0901051	09 央行票据	40,000	3,986,800.00	4.68

		51			
--	--	----	--	--	--

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	760,474.91
3	应收股利	-
4	应收利息	13,676.56
5	应收申购款	14,134.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,038,285.52

8.9.4 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。

8.9.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
3,463	17,193.95	9,080,815.15	15.25%	50,461,826.17	84.75%

9.2 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	923,144.74	1.55%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年6月3日)基金份额总额	329,346,406.20
本报告期期初基金份额总额	149,774,753.47
本报告期期间基金总申购份额	18,451,681.05
减：本报告期期间基金总赎回份额	108,683,793.20
本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	59,542,641.32

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，本基金管理人于2009年2月12日发布了《东方基金管理有限责任公司关于变更督察长的公告》吕日先生担任本公司督察长，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；经本公司董事会决议并经中国证券监督管理委员会核准，本基金管理人于2009年3月28日发布了《东方基金管理有限责任公司关于总经理辞职及代行总

经理职务人员的公告》，程红女士不再担任公司总经理职务，董事长李维雄先生代为履行公司总经理职务；经本公司董事会决议并经中国证券监督管理委员会核准，本基金管理人于 2009 年 8 月 18 日发布了《东方基金管理有限责任公司关于总经理任职的公告》，聘任单宇先生担任本公司总经理；经本公司董事会批准，本基金管理人于 2010 年 2 月 12 日发布了《东方基金管理有限责任公司关于高级管理人员离职的公告》，付勇先生不再担任公司副总经理职务；经本公司研究决定，本基金管理人于 2010 年 2 月 12 日发布了《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理变更公告》，付勇先生不再担任本基金基金经理。

本公司已分别通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站对上述高级管理人员、基金经理、董事变更情况履行了信息披露义务，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高级管理人员、基金经理、董事变更情况。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给立信会计师事务所有限公司报酬为 80,000.00 元，该审计机构已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券股份有限公司	2	164,645,338.89	27.77%	136,113.39	27.45%	-
中信建投证券有限责任公司	1	53,322,064.10	8.99%	45,323.93	9.14%	-

公司						
中银国际证券有限责任公司	1	245,347,278.19	41.39%	208,565.82	42.07%	-
中信证券股份有限公司	1	14,680,138.30	2.48%	12,478.18	2.52%	-
兴业证券股份有限公司	1	114,826,013.77	19.37%	93,297.03	18.82%	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）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资金雄厚，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，要明确签订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。

（3）本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银国际证券有限责任	100,078.32	100.00%	-	-	23,706.92	100.00%

11.8 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	本公司关于旗下基金在工行开通定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	指定报刊、网站	2009-01-14
2	本基金招募说明书（更新）摘要（2008 年）	指定报刊、网站	2009-01-21
3	本基金招募说明书（更新（2008 年）	网站	2009-01-21
4	本基金 2008 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2009-01-22
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	2009-02-06
6	本公司关于旗下基金在中信银行股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-02-09
7	本公司关于变更督察长的公告	指定报刊、网站	2009-02-12
8	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	2009-02-24
9	本公司关于旗下部分基金参与中国工商银行基金定投业务的公告	指定报刊、网站	2009-02-24
10	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	2009-02-27
11	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	2009-03-05
12	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	2009-03-17
13	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	2009-03-25
14	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	2009-03-28
15	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	2009-03-30
16	本公司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	2009-03-30
17	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	2009-03-30

18	本基金 2008 年年度报告	网站	2009-03-31
19	本基金 2008 年年度报告摘要	指定报刊、网站	2009-03-31
20	本基金 2009 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2009-04-20
21	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	2009-04-30
22	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	2009-05-05
23	本公司关于旗下基金在中信建投证券和齐鲁证券开通基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2009-05-22
24	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	2009-06-26
25	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	2009-06-27
26	本公司旗下基金截止 2009 年 6 月 30 日基金净值公告	指定报刊、网站	2009-07-01
27	本公司关于上海分公司成立公告	指定报刊、网站	2009-07-13
28	本基金招募说明书（更新）（2009 年第 1 号）	网站	2009-07-17
29	本基金招募说明书（更新）摘要（2009 年第 1 号）	指定报刊、网站	2009-07-17
30	本基金 2009 年第 2 季度报告	指定报刊、网站	2009-07-21
31	本公司关于旗下基金参与中信银行开展的网上交易申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2009-07-31
32	本公司关于旗下基金开通民生银行网上交易的公告	指定报刊、网站	2009-08-04
33	本公司关于网上交易平台开通民生银行定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-08-04
34	本公司关于总经理任职的公告	指定报刊、网站	2009-08-18
35	本基金 2009 年半年度报告（正文）	网站	2009-08-27
36	本基金 2009 年半年度报告（摘要）	指定报刊、网站	2009-08-27
37	本公司关于旗下基金在江海证券开通定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-09-07
38	本公司关于旗下基金参加齐鲁证券开展的基金网上申购费率优惠的公告	指定报刊、网站	2009-09-09
39	本公司关于旗下基金参与创业板投资及相关风险揭示的公告	指定报刊、网站	2009-09-24
40	本基金 2009 年第 3 季度报告	指定报刊、网站	2009-10-28
41	本公司关于旗下基金增加宏源证券股份有限公司为代销渠道的公告	指定报刊、网站	2009-11-05
42	本公司关于旗下基金在国信证券开通定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2009-11-19
43	本公司关于旗下基金增加广发华福证券有限责	指定报刊、网站	2009-12-26

	任公司为代销渠道并参与其网上申购费率优惠的公告		
--	-------------------------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2009 年 1 月 16 日，本基金托管人公告本行聘请胡哲一先生担任本行副行长。
2. 2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书。
3. 2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书。
4. 2009 年 5 月 26 日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书。
5. 2009 年 8 月 2 日，本基金托管人公告，自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任本行执行董事。
6. 2009 年 9 月 27 日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。
7. 2009 年 10 月 11 日，本基金托管人发布关于控股股东增持本行股份的公告。

东方基金管理有限责任公司

二〇一〇年三月二十七日