

东方精选混合型开放式证券投资基金

2009 年年度报告

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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。

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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§4 管理人报告	7
§5 托管人报告	12
§6 审计报告	12
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
7.4 报表附注	17
§8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 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	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
8.9 投资组合报告附注	46
§9 基金份额持有人信息	47
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
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	47
§10 开放式基金份额变动	48
§11 重大事件揭示	48
§12 备查文件目录	53

§ 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	
基金主代码	400003	
交易代码	400003(前端)	400004(后端)
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	
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	
报告期末基金份额总额	8,102,696,289.09 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（包括债券）、行业优化组成。
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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所	上海市南京路61号新黄浦金融大厦4层
注册登记机构	东方基金管理有限责任公司	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、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	2007年
本期已实现收益	-96,518,603.80	-1,303,168,888.04	1,607,630,711.39
本期利润	4,676,572,400.71	-6,550,039,114.79	3,469,110,600.02
加权平均基金份额本期利润	0.5371	-0.7165	0.6026
本期加权平均净值利润率	64.52%	-90.61%	51.00%
本期基金份额净值增长率	100.81%	-56.87%	168.81%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配利润	1,757,728,163.77	1,449,191,950.02	3,378,435,259.44
期末可供分配基金份额利润	0.2169	0.1641	0.3722
期末基金资产净值	8,644,560,349.66	4,690,752,055.23	11,182,493,397.01
期末基金份额净值	1.0669	0.5313	1.2318
3.1.3 累计期末指标	2009年末	2008年末	2007年末
基金份额累计净值增长率	375.47%	136.76%	448.94%

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
过去三个月	21.24%	1.55%	11.54%	1.11%	9.70%	0.44%
过去六个月	24.96%	1.81%	8.78%	1.33%	16.18%	0.48%
过去一年	100.81%	1.77%	54.39%	1.29%	46.42%	0.48%
过去三年	132.84%	2.16%	40.52%	1.51%	92.32%	0.65%
自基金合同生	375.47%	1.96%	125.21%	1.38%	250.26%	0.58%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

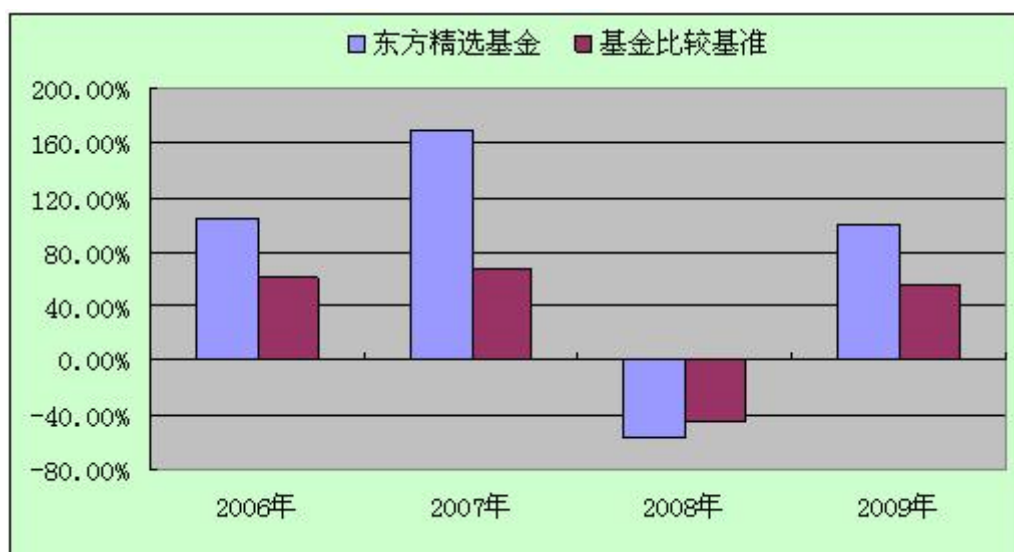
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方精选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
(2006 年 1 月 11 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

东方精选混合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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
李骥（先生）	本基金基金经理、投资决策委员会委员	2010-02-12	-	8年	北京大学经济学博士，8年证券从业经历，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监，长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部经理，公司投资决策委员会委员；现任研究部经理，公司投资决策委员会委员。
王瑞（先生）	本基金基金经理助理	2009-05-13	-	7年	北京大学理学硕士，7年证券、基金行业从业经历。曾在中国林业科学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责任公司，任研究员；2009 年 5 月起任本基金基金经理助理。
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	2006-01-11	2010-02-12	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，2008 年 6 月 3 日至 2010 年 2 月 12 日担任东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理。
郑军恒（先生）	本基金基金经理助理	2008-05-30	2009-05-13	10 年	北京大学分子生物学硕士。10 年金融、证券从业经历，曾任天津氨基酸公司助理工程师，先后在北京涌金财经顾问有限公司、博时基金管理有限公司、江南证券基金筹备组任分析师、研究员。2005 年加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部副经理、本基金基金经理助理。2008 年 12 月 10 日至今任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。2009 年 6 月 24 日至今任东方核心动力股票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：东方精选混合型开放式证券投资基金（本基金）、东方龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方龙基金”）。本基金本报告期净值增长率高于东方龙基金 60.69%。现将业绩差异的原因说明如下：

两只基金基金仓位不同导致了业绩差异。

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金股票资产占基金净值比例为 93.21%，东方龙基金股票资产占基金净值比例为 49.31%，差距较大，而 2009 年对市场具有代表意义的沪深 300 指数收益率为 19.00%。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经历了 2008 年的经济休克和股市雪崩，2009 年的市场表现之强劲的确有些意料之外，不过也在情理之中。首先，宏观经济在金融危机冲击下陷入短暂停顿当然是非正常的极端状态，其恢复运转并出现一定程度的复苏不难预期；其次，股市在长时间单边巨幅非理性下跌后，迎来报复性反弹，从技术上分析也是大概率事件。虽然发达国家经济复苏仍较为缓慢，但中国经济却有惊无险，在政府巨额投资计划和天量信贷刺激下，在一连串区域和行业振兴措施推动下，尤其是在神奇反转的房地产的拉动下，2009 年中国经济强劲回升。而随着经济逐步向好，沪深 A 股一路上涨，虽然中期因为政策微调、扩容超预期，大盘冲高回落，但随后仍维持强势格局，沪深 300 指数全年涨幅达到 96.71%。

报告期内本基金的运作主要有两点成功之处：一是年初时市场估值整体处于低位，我们判断有利因素将逐渐增加，所以投资策略较为积极，保持了较高仓位的股票资产；二是在年中政策出现微调迹象时心态趋于谨慎，采取了积极防御的策略，在行业配置基本均衡的同时，

适当超配了食品饮料、品牌服装、医药生物、旅游等消费类板块。

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 100.81%，业绩比较基准收益率为 54.39%，高于业绩比较基准 46.42%，并在银河证券基金分类体系的 72 只混合基金—偏股型基金中排名第二。

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，随着通胀预期上升和资产泡沫化，政策出现调整迹象，但政府表示将继续实施积极的财政政策和适度宽松的货币政策，并将保增长、调结构、扩内需作为政策着力点。我们认为投资、消费将维持较高增长，经济仍有望在高位运行。

不过，经济强劲复苏的主要推动力靠的是投资拉动，特别是以政府主导的投资为主，未来在政府财政趋紧和房地产出现量价僵持的局面下，创历史高位的投资增长水平能否持续值得观察；消费方面，汽车下乡、家电下乡、以旧换新，多少有些透支的意味，在政府对收入分配结构短期难以作出实质调整的情况下，居民消费尚不能很快对经济增长起到更大的作用；另外，在发达经济体经济复苏不确定，贸易保护主义抬头的情况下，外贸即使有所恢复也难有大的起色。如此看来，中国经济虽在全球一枝独秀，但形势并不是高枕无忧。

目前市场估值整体尚属合理范围，但新股、中小盘股明显处于结构性高估状态，估值有待回归。新股发行、再融资、限售股解禁和大小非减持连绵不绝，扩容压力不断加强。基于以上分析，我们认为 2010 年市场可能维持震荡格局。本基金将适当加大配置估值相对合理的大盘权重股，如钢铁、金融、石化、煤炭等，以应对结构性行情。

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

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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本年度，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 审计报告

信会师报字[2010]第80304号

东方精选混合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精选混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方精选基金”）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》、《东方精选混合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精选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，东方精选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》、《东方精选混合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精选基金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：东方精选混合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	附注号	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	7.4.7.1	210,939,194.08	122,627,620.65
结算备付金		1,255,019.47	2,676,166.12
存出保证金		3,052,803.50	2,500,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	8,456,576,674.92	4,571,108,465.92
其中：股票投资		8,057,896,674.92	4,374,888,465.92
基金投资		-	-
债券投资		398,680,000.00	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	7.4.7.3	-	-
应收证券清算款		64,726,036.43	3,890,874.03
应收利息	7.4.7.4	327,103.03	2,292,103.95
应收股利		-	-
应收申购款		12,453,505.96	937,701.27
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,749,330,337.39	4,706,032,931.94
负债和所有者权益	附注号	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		-	-
应付赎回款		87,832,945.73	4,557,709.11
应付管理人报酬		10,897,394.30	6,193,570.37
应付托管费		1,816,232.37	1,032,261.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.5	2,299,934.32	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	7.4.7.6	1,923,481.01	1,360,432.06
负债合计		104,769,987.73	15,280,876.71
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.7	2,974,965,562.31	3,241,560,105.21
未分配利润	7.4.7.8	5,669,594,787.35	1,449,191,950.02
所有者权益合计		8,644,560,349.66	4,690,752,055.23
负债和所有者权益总计		8,749,330,337.39	4,706,032,931.94

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0669 元，基金份额总额

8,102,696,289.09 份。

7.2 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 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至200 9年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至200 8年12月31日
一、收入		4,825,980,007.28	-6,390,567,019.06
1. 利息收入		11,215,754.59	14,671,567.87
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,987,988.21	3,774,973.27
债券利息收入		9,227,766.38	10,896,594.60
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）		38,755,946.66	-1,161,702,335.03
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-23,819,665.39	-1,126,551,563.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-2,224,973.91	-1,026,317.06
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-104,988,324.12
股利收益	7.4.7.13	64,800,585.96	70,863,869.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	4,773,091,004.51	-5,246,870,226.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	2,917,301.52	3,333,974.85
减：二、费用		149,407,606.57	159,472,095.73

1. 管理人报酬		108,019,233.55	109,388,528.55
2. 托管费		18,003,205.61	18,231,421.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.16	22,978,729.39	31,288,406.95
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	7.4.7.17	406,438.02	237,312.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,676,572,400.71	-6,550,039,114.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,676,572,400.71	-6,550,039,114.79

7.3 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）	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）	-	4,676,572,400.71	4,676,572,400.71
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）	-266,594,542.90	-456,169,563.38	-722,764,106.28
其中：1. 基金申购款	1,049,263,897.93	1,409,230,388.59	2,458,494,286.52
2. 基金赎回款	-1,315,858,440.83	-1,865,399,951.97	-3,181,258,392.80
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）	2,974,965,562.31	5,669,594,787.35	8,644,560,349.66
项目	上年度可比期间 2008年1月1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	3,333,109,106.17	7,849,384,290.84	11,182,493,397.01

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,550,039,114.79	-6,550,039,114.79
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)	-91,549,000.96	149,846,773.97	58,297,773.01
其中: 1. 基金申购款	934,744,813.52	1,815,889,604.78	2,750,634,418.30
2. 基金赎回款	-1,026,293,814.48	-1,666,042,830.81	-2,692,336,645.29
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)	3,241,560,105.21	1,449,191,950.02	4,690,752,055.23

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

东方精选混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2005 年 9 月 7 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《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《关于东方精选混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2005】273 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

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 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成本基金的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

1. 金融资产的分类

金融资产应当在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；（2）持有至到期投资；（3）贷款和应收款项；（4）可供出售金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

2. 金融负债的分类

金融负债应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）其他金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利（包括送红股和公积金转增股本）以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作

为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊,确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后,逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊,确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账,相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,基金管理人根据具体情况与托管银行进行商定,按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的,按其规定进行估值。

具体投资品种的估值方法如下:

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票,根据 2008 年 09 月 12 日证监会发布的【2008】38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,因最近交易日后经济环境发生了重大变化,以参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法),调整最近交易市价,确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值。

首次公开发行但未上市股票采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。首次公开发行有明确锁定期的股票,于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(2) 债券投资

①证券交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价估值。

②证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值。

③发行未上市流通的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

④同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

⑤在全国银行间债券市场交易的债券,采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量。

(3) 权证投资

①证券交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价估值。

②首次发行但尚未上市的权证在上市交易前,采用估值技术确定公允价值;在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本计量。

③因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

④因认购或获配新发行的分离交易可转债而取得的债券和权证,上市日前,分别按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价确定当日债券和权证的估值;自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述相关原则进行估值。

(4) 资产支持证券等其他有价证券按国家有关规定进行估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自

占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于年末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提并确认。

（2）基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提并确认。

（3）卖出回购金融资产利息支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实

际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提并确认。

（4）交易费用

进行股票、债券、权证等交易过程中产生的交易费用，在发生时按照确定的金额计入交易费用。

（5）其他费用

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；

（2）基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；

（3）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；

（4）本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；

（5）本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

（6）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 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, 暂不缴纳营业税和企业所得税。
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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
活期存款	210,939,194.08	122,627,620.65
定期存款	-	-

其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	210,939,194.08	122,627,620.65

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,646,350,296.54	8,057,896,674.92	1,411,546,378.38
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	398,694,800.00	398,680,000.00	-14,800.00
	合计	398,694,800.00	398,680,000.00	-14,800.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,045,045,096.54	8,456,576,674.92	1,411,531,578.38
项目		上年度末 2008年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,740,330,292.05	4,374,888,465.92	-3,365,441,826.13
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	192,337,600.00	196,220,000.00	3,882,400.00
	合计	192,337,600.00	196,220,000.00	3,882,400.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,932,667,892.05	4,571,108,465.92	-3,361,559,426.13

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末及上年度末，本基金未持有买断式回购交易中取得的债券。

7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	120,048.57	42,241.94
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	439.30	1,204.30
应收债券利息	203,076.92	2,247,780.82
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	3,188.24	426.89
其他	350.00	450.00
合计	327,103.03	2,292,103.95

注：“其他”为应收权证保证金利息。

7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,298,784.32	2,136,728.42
银行间市场应付交易费用	1,150.00	175.00
合计	2,299,934.32	2,136,903.42

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,250,000.00
应付赎回费	338,981.01	25,932.06
预提费用	84,500.00	84,500.00
合计	1,923,481.01	1,360,432.06

注：预提费用包括按日计提的审计费和银行间账户维护费。

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31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	2,857,816,735.03	1,049,263,897.93
本期赎回（以“-”号填列）	-3,583,913,066.37	-1,315,858,440.83
本期末	8,102,696,289.09	2,974,965,562.31

注：申购包含基金转换入份额；赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

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	-96,518,603.80	4,773,091,004.51	4,676,572,400.71
本期基金份额交易产生的变动数	-144,298,115.28	-311,871,448.10	-456,169,563.38
其中：基金申购款	542,721,475.80	866,508,912.79	1,409,230,388.59
基金赎回款	-687,019,591.08	-1,178,380,360.89	-1,865,399,951.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,757,728,163.77	3,911,866,623.58	5,669,594,787.35

7.4.7.9 存款利息收入

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1月1日至2008年12月31日
活期存款利息收入	1,831,242.65	3,537,695.02
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	73,451.05	96,650.95
其他	83,294.51	140,627.30
合计	1,987,988.21	3,774,973.27

注：“其他”包括基金申购款利息收入 70,519.31 元，基金权证保证金利息收入 12,775.20 元。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	7,890,359,094.98	5,302,504,356.31
减：卖出股票成本总额	7,914,178,760.37	6,429,055,919.36
买卖股票差价收入	-23,819,665.39	-1,126,551,563.05

7.4.7.11 债券投资收益

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1月1日至2008年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	570,000,000.00	571,132,295.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	557,750,973.91	555,426,775.94
减：应收利息总额	14,474,000.00	16,731,836.55
债券投资收益	-2,224,973.91	-1,026,317.06

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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1月1日至2008年12月31日
卖出权证成交总额	-	240,614,873.18
减：卖出权证成本总额	-	345,603,197.30
买卖权证差价收入	-	-104,988,324.12

7.4.7.13 股利收益

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1月1日至2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	64,800,585.96	70,863,869.20
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	64,800,585.96	70,863,869.20

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
1. 交易性金融资产	4,773,091,004.51	-5,246,870,226.75
——股票投资	4,776,988,204.51	-5,252,692,786.75
——债券投资	-3,897,200.00	5,822,560.00
——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	4,773,091,004.51	-5,246,870,226.75

7.4.7.15 其他收入

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1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	2,836,876.45	3,245,332.84
基金转换费收入	80,425.07	4,637.26
印花税返还	-	84,004.75
合计	2,917,301.52	3,333,974.85

7.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	22,975,904.39	31,286,781.95
银行间市场交易费用	2,825.00	1,625.00
合计	22,978,729.39	31,288,406.95

7.4.7.17 其他费用

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1月1日至2008年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	100,000.00
银行费用	8,438.02	39,212.82
账户维护费用	18,000.00	18,000.00
其他费用	-	100.00
合计	406,438.02	237,312.82

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金 2010 年 2 月 12 日《东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理变更公告》，聘任李骥先生为本基金基金经理，同意付勇先生辞去本基金基金经理职务。付勇先生不再担任本基金基金经理。本基金管理人已在中国证券业协会办理了李骥先生基金经理的注册手续及付勇先生基金经理的注销手续，并已将有关事项报中国证券监督管理委员会北京监管局备案。

7.4.9 关联方关系

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

中国民生银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构
--------------	-------------

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.1.1 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1月1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	3,777,482,567.05	25.69%	436,636,394.50	3.88%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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	3,169,109.93	25.76%	1,758,755.80	76.51%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1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	371,136.25	3.85%	371,136.25	17.37%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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1月1日至2008年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	108,019,233.55	109,388,528.55
其中：支付销售机构的客户维护费	24,908,716.49	24,682,681.20

注：①在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$
 本基金年管理费率为 1.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②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。

7.4.10.2.2 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1月1日至2008年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,003,205.61	18,231,421.36

注：①在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$
 本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

②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。

7.4.10.3 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，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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	46,302,424.23	46,302,424.23
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	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%	0.52%

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、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。

7.4.10.4.2 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均未投资本基金。

7.4.10.5 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 1 月 1 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
中国民生银行股份有限公司	210,939,194.08	1,831,242.65	122,627,620.65	3,537,695.02

7.4.10.6 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，本基金未在承销期内参与承销由关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

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。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金未持有暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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上市公司发行的证券，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。

7.4.13.3 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均在证券交易所交易，能够及时变现，且截至本报告期末未持有任何流通转让受到限制的证券。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 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	210,939,194.08	-	-	-	210,939,194.08
结算备付金	1,255,019.47	-	-	-	1,255,019.47
存出保证金	1,000,000.00	-	-	2,052,803.50	3,052,803.50
交易性金融资产	398,680,000.00	-	-	8,057,896,674.92	8,456,576,674.92
其中：股票投资	-	-	-	8,057,896,674.92	8,057,896,674.92

债券投资	398,680,000.00	-	-	-	398,680,000.00
应收证券清算款	-	-	-	64,726,036.43	64,726,036.43
应收利息	-	-	-	327,103.03	327,103.03
应收申购款	12,453,505.96	-	-	-	12,453,505.96
资产总计	624,327,719.51	-	-	8,125,002,617.88	8,749,330,337.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	87,832,945.73	87,832,945.73
应付管理人报酬	-	-	-	10,897,394.30	10,897,394.30
应付托管费	-	-	-	1,816,232.37	1,816,232.37
应付交易费用	-	-	-	2,299,934.32	2,299,934.32
其他负债	-	-	-	1,923,481.01	1,923,481.01
负债总计	-	-	-	104,769,987.73	104,769,987.73
利率敏感度缺口	624,327,719.51	-	-	8,020,232,630.15	8,644,560,349.66
上年度末 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
负债总计	-	-	-	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

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	市场利率上调 0.25%	-212,400.00	-346,400.00
	市场利率下调 0.25%	212,800.00	347,600.00

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 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	8,057,896,674.92	93.21	4,374,888,465.92	93.27
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,057,896,674.92	93.21	4,374,888,465.92	93.27

7.4.13.4.3.2 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；2. Beta系数以市场过去 100 个交易日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 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	基金业绩比较基准上 涨 5%	343,785.79	173,447.37
	基金业绩比较基准下 跌 5%	-343,785.79	-173,447.37

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95% 的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 272,847,787 元，占基金资产净值比例为 3.16%；上年度末本基金风险价值为 205,980,843 元，占基金资产净值比例为 4.39%。

7.4.14 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	8,057,896,674.92	92.10
	其中：股票	8,057,896,674.92	92.10
2	固定收益投资	398,680,000.00	4.56
	其中：债券	398,680,000.00	4.56
	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	212,194,213.55	2.43
6	其他各项资产	80,559,448.92	0.92
7	合计	8,749,330,337.39	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	-	-
B	采掘业	405,482,684.19	4.69
C	制造业	5,310,106,609.17	61.43
C0	食品、饮料	1,180,868,811.01	13.66
C1	纺织、服装、皮毛	219,277,312.91	2.54
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	60,191,920.71	0.70
C4	石油、化学、塑胶、塑料	704,215,253.31	8.15
C5	电子	116,532,997.74	1.35
C6	金属、非金属	1,322,118,568.18	15.29
C7	机械、设备、仪表	1,254,353,242.46	14.51
C8	医药、生物制品	452,548,502.85	5.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	350,378,663.10	4.05
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	345,324,004.10	3.99
G	信息技术业	371,425,904.56	4.30
H	批发和零售贸易	134,697,830.40	1.56
I	金融、保险业	395,868,305.84	4.58
J	房地产业	375,676,922.17	4.35
K	社会服务业	116,817,626.64	1.35
L	传播与文化产业	252,118,124.75	2.92
M	综合类	-	-
	合计	8,057,896,674.92	93.21

8.3 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	600688	S 上石化	54,800,000	601,156,000.00	6.95

2	000568	泸州老窖	14, 599, 769	569, 974, 981. 76	6. 59
3	000959	首钢股份	94, 560, 000	568, 305, 600. 00	6. 57
4	600864	哈投股份	20, 731, 234	227, 007, 012. 30	2. 63
5	000063	中兴通讯	3, 357, 974	150, 672, 293. 38	1. 74
6	600519	贵州茅台	842, 289	143, 037, 517. 98	1. 65
7	600066	宇通客车	7, 073, 908	141, 407, 420. 92	1. 64
8	000651	格力电器	4, 838, 184	140, 017, 044. 96	1. 62
9	600511	国药股份	5, 261, 634	134, 697, 830. 40	1. 56
10	000527	美的电器	5, 769, 915	133, 862, 028. 00	1. 55
11	000898	鞍钢股份	8, 339, 881	133, 438, 096. 00	1. 54
12	600761	安徽合力	9, 339, 745	132, 717, 776. 45	1. 54
13	000002	万 科 A	12, 234, 257	132, 252, 318. 17	1. 53
14	000825	太钢不锈	13, 849, 942	132, 128, 446. 68	1. 53
15	600037	歌华有线	9, 149, 890	129, 836, 939. 10	1. 50
16	600276	恒瑞医药	2, 402, 550	126, 133, 875. 00	1. 46
17	000402	金 融 街	10, 253, 680	124, 377, 138. 40	1. 44
18	600806	昆明机床	8, 349, 651	124, 075, 813. 86	1. 44
19	000858	五 粮 液	3, 917, 926	124, 041, 537. 16	1. 43
20	600900	长江电力	9, 234, 405	123, 371, 650. 80	1. 43
21	600690	青岛海尔	4, 959, 784	122, 953, 045. 36	1. 42
22	600019	宝钢股份	12, 666, 082	122, 354, 352. 12	1. 42
23	600880	博瑞传播	4, 540, 705	122, 281, 185. 65	1. 41
24	000869	张 裕 A	1, 603, 536	121, 900, 806. 72	1. 41
25	600183	生益科技	11, 559, 941	119, 645, 389. 35	1. 38
26	000538	云南白药	1, 979, 980	119, 590, 792. 00	1. 38
27	600048	保利地产	5, 314, 619	119, 047, 465. 60	1. 38
28	601111	中国国航	12, 250, 000	118, 947, 500. 00	1. 38
29	000983	西山煤电	2, 941, 716	117, 345, 051. 24	1. 36
30	600809	山西汾酒	2, 732, 879	117, 322, 495. 47	1. 36
31	600026	中海发展	8, 159, 900	117, 094, 565. 00	1. 35
32	600054	黄山旅游	6, 283, 896	116, 817, 626. 64	1. 35
33	600585	海螺水泥	2, 339, 909	116, 667, 862. 74	1. 35
34	600563	法拉电子	7, 079, 769	116, 532, 997. 74	1. 35
35	601398	工商银行	21, 199, 999	115, 327, 994. 56	1. 33

36	000338	潍柴动力	1,780,000	114,774,400.00	1.33
37	600031	三一重工	3,079,899	113,371,082.19	1.31
38	600588	用友软件	4,039,445	111,731,048.70	1.29
39	000157	中联重科	4,287,937	111,529,241.37	1.29
40	000423	东阿阿胶	4,239,879	110,872,835.85	1.28
41	601169	北京银行	5,730,000	110,818,200.00	1.28
42	600036	招商银行	6,109,952	110,284,633.60	1.28
43	601006	大秦铁路	10,609,897	109,281,939.10	1.26
44	600271	航天信息	5,375,866	109,022,562.48	1.26
45	600497	驰宏锌锗	4,035,877	106,748,946.65	1.23
46	600005	武钢股份	12,849,946	106,397,552.88	1.23
47	600887	*ST 伊利	3,949,829	104,591,471.92	1.21
48	600596	新安股份	2,284,621	103,059,253.31	1.19
49	600583	海油工程	8,989,996	102,485,954.40	1.19
50	600557	康缘药业	4,580,000	95,951,000.00	1.11
51	600177	雅戈尔	6,539,895	94,893,876.45	1.10
52	000709	唐钢股份	11,299,980	80,116,858.20	0.93
53	600028	中国石化	5,599,910	78,902,731.90	0.91
54	002029	七匹狼	2,759,998	64,059,553.58	0.74
55	600888	新疆众和	3,989,173	62,709,799.56	0.73
56	600439	瑞贝卡	5,164,716	60,323,882.88	0.70
57	600308	华泰股份	4,259,867	60,191,920.71	0.70
58	601601	中国太保	2,319,964	59,437,477.68	0.69

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 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	600005	武钢股份	205,247,753.30	4.38
3	600864	哈投股份	193,706,189.37	4.13
4	600028	中国石化	166,501,109.07	3.55
5	000527	美的电器	162,624,633.32	3.47

6	600497	驰宏锌锗	150,779,739.99	3.21
7	000898	鞍钢股份	145,116,813.61	3.09
8	600690	青岛海尔	143,562,707.26	3.06
9	600031	三一重工	140,490,859.93	3.00
10	002029	七匹狼	137,274,173.59	2.93
11	000825	太钢不锈	129,792,117.88	2.77
12	600761	安徽合力	120,275,271.44	2.56
13	600806	昆明机床	117,372,988.83	2.50
14	600809	山西汾酒	115,673,700.10	2.47
15	000157	中联重科	114,910,075.02	2.45
16	601601	中国太保	109,415,801.16	2.33
17	600183	生益科技	107,042,669.16	2.28
18	600026	中海发展	106,673,009.31	2.27
19	000338	潍柴动力	105,700,512.77	2.25
20	601398	工商银行	105,511,965.85	2.25
21	600583	海油工程	104,771,759.39	2.23
22	601169	北京银行	103,723,010.24	2.21
23	000538	云南白药	101,608,263.03	2.17
24	600887	*ST 伊利	100,827,314.74	2.15
25	600037	歌华有线	100,482,115.18	2.14
26	601111	中国国航	100,156,778.36	2.14
27	600718	东软集团	100,094,536.62	2.13
28	600801	华新水泥	99,547,979.60	2.12
29	600177	雅戈尔	99,053,076.41	2.11
30	000932	华菱钢铁	97,849,493.16	2.09
31	600054	黄山旅游	97,440,892.80	2.08
32	600309	烟台万华	97,065,871.52	2.07
33	000800	一汽轿车	96,145,250.90	2.05
34	600563	法拉电子	94,701,395.86	2.02
35	600439	瑞贝卡	94,138,103.06	2.01

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	000800	一汽轿车	543,453,160.17	11.59
2	600688	S 上石化	302,317,347.99	6.44
3	600635	大众公用	249,100,330.71	5.31
4	600005	武钢股份	216,658,926.01	4.62
5	000933	神火股份	190,256,930.20	4.06
6	600690	青岛海尔	176,185,188.08	3.76
7	600547	山东黄金	170,569,995.07	3.64
8	600831	广电网络	170,235,474.06	3.63
9	000527	美的电器	155,054,807.60	3.31
10	002029	七匹狼	149,598,695.69	3.19
11	000959	首钢股份	135,847,426.99	2.90
12	000898	鞍钢股份	135,584,634.74	2.89
13	600790	轻纺城	132,748,602.64	2.83
14	600312	平高电气	122,299,793.52	2.61
15	600028	中国石化	119,449,162.26	2.55
16	600166	福田汽车	118,127,577.26	2.52
17	000068	赛格三星	117,783,762.96	2.51
18	600761	安徽合力	116,256,086.67	2.48
19	600497	驰宏锌锗	116,177,724.42	2.48
20	600660	福耀玻璃	115,389,199.42	2.46
21	600328	兰太实业	114,206,858.22	2.43
22	600806	昆明机床	112,173,999.53	2.39
23	600123	兰花科创	111,997,130.33	2.39
24	600686	金龙汽车	111,749,119.57	2.38
25	600970	中材国际	107,728,255.80	2.30
26	000983	西山煤电	107,466,167.78	2.29
27	000629	攀钢钢钒	107,399,684.26	2.29
28	000401	冀东水泥	106,066,579.10	2.26
29	002078	太阳纸业	103,752,322.14	2.21
30	600718	东软集团	103,451,961.78	2.21
31	600309	烟台万华	101,601,099.62	2.17

32	000024	招商地产	98,482,015.15	2.10
33	600299	蓝星新材	97,842,809.82	2.09
34	600000	浦发银行	96,334,989.67	2.05
35	600801	华新水泥	95,593,524.83	2.04
36	600631	百联股份	94,397,864.83	2.01
37	002022	科华生物	94,003,097.84	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。

8.4.3 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	6,822,209,255.64
卖出股票的收入（成交）总额	7,890,359,094.98

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	398,680,000.00	4.61
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	398,680,000.00	4.61

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	0901067	09 央行票据 67	4,000,000	398,680,000.00	4.61

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

本基金在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

本基金在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。2009 年 3G 已在中国大面积推广，该公司在 3G 领域做了充分的准备，具备很强的竞争实力，未来业绩增长具有比较强的确定性，因此决定继续投资该公司。本基金在这一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。

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	3,052,803.50
2	应收证券清算款	64,726,036.43
3	应收股利	—
4	应收利息	327,103.03
5	应收申购款	12,453,505.96
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	80,559,448.92

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金在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
349,625	23,175.39	20,503,023.60	0.25%	8,082,193,265.49	99.75%

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	7,225.62	0.0001%

§ 10 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
本报告期期初基金份额总额	8,828,792,620.43
本报告期期间基金总申购份额	2,857,816,735.03
减：本报告期期间基金总赎回份额	3,583,913,066.37
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	8,102,696,289.09

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《东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理变更公告》，聘任李骥先生担任本基金基金经理，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稽查或处罚等情况

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	3,777,482,567.05	25.69%	3,169,109.93	25.76%	-
光大证券股份有限公司	1	521,898,185.21	3.55%	424,046.93	3.45%	-
申银万国证券股份有限公司	1	1,971,897,714.39	13.41%	1,676,101.12	13.62%	-
中国国际金融有限公司	2	2,406,893,060.66	16.37%	1,955,619.66	15.89%	-
中银国际证券有限责任公司	1	1,010,397,386.86	6.87%	858,832.59	6.98%	-
中信证券股份有限公司	1	2,301,034,288.29	15.65%	1,955,858.35	15.90%	-
海通证券股份有限公司	1	595,965,587.32	4.05%	484,225.85	3.94%	-
联合证券股份有限公司	1	161,716,219.79	1.10%	131,395.57	1.07%	-
山西证券股份有限公司	1	390,725,881.92	2.66%	317,469.19	2.58%	-
招商证券股份有限公司	1	1,566,437,042.14	10.65%	1,331,462.68	10.82%	-

银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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）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。

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

本报告期本基金租用证券公司的交易单元未进行其他证券投资的情况。

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	关于更改本基金业绩比较基准的公告	指定报刊、网站	2009-01-14
2	本基金基金合同（2009 年 1 月 18 日修订）	网站	2009-01-19
3	本基金 2008 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2009-01-22

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	2009-02-02
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	2009-02-14
9	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
10	本基金招募说明书（更新）摘要（2008 年第 2 号）	指定报刊、网站	2009-02-24
11	本基金招募说明书（更新）（2008 年第 2 号）	网站	2009-02-24
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	2009-02-27
13	本公司关于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
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	2009-03-17
15	更正公告	指定报刊、网站	2009-03-21
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	2009-03-25
17	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
18	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
19	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
20	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
21	本基金 2008 年年度报告	网站	2009-03-31
22	本基金 2008 年年度报告摘要	指定报刊、网站	2009-03-31
23	本公司关于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	2009-04-09
24	本基金 2009 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2009-04-20
25	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
26	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

27	本公司关于旗下基金持有“600900 长江电力”恢复“市值估值法”的公告	指定报刊、网站	2009-05-19
28	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
29	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	2009-06-08
30	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
31	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
32	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
33	本公司关于上海分公司成立公告	指定报刊、网站	2009-07-13
34	本基金 2009 年第 2 季度报告	指定报刊、网站	2009-07-21
35	本公司关于旗下基金在中国工商银行开通定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2009-07-22
36	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
37	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
38	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
39	本公司关于旗下基金增加中国银行股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊、网站	2009-08-10
40	本公司关于总经理任职的公告	指定报刊、网站	2009-08-18
41	本基金招募说明书（更新）摘要（2009 年第 1 号）	指定报刊、网站	2009-08-24
42	本基金招募说明书（更新）（2009 年第 1 号）	网站	2009-08-24
43	本基金 2009 年半年度报告（正文）	网站	2009-08-27
44	本基金 2009 年半年度报告（摘要）	指定报刊、网站	2009-08-27
45	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
46	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
47	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
48	本基金 2009 年第 3 季度报告	指定报刊、网站	2009-10-28
49	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
50	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

51	本公司关于旗下基金增加广发华福证券有限责任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	2009-12-26
----	---	---------	------------

§ 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

二〇一〇年三月二十七日