

东方龙混合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	东方龙混合
基金主代码	400001
交易代码	400001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 11 月 25 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	1,368,856,076.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济和资本市场的高速增长，努力为基金份额持有人谋求长期发展、稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股（包括债券）选择组成。本基金将资产配置、基金风格管理和个股选择都建立在全面、深入而有效的研究的基础上。研究贯穿于基金投资管理的每一个环节。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是中信标普 300 风格指数，具体包括中信标普 300 成长指数和中信标普 300 价值指数，本基金债券部分的业绩比较基准为中信标普全债指数。 本基金整体业绩比较基准=中信标普 300 成

	长指数*30% + 中信标普 300 价值指数*45% + 中信标普全债指数*25%。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，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
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	2007年
---------------	-------	-------	-------

本期已实现收益	-3,368,139.43	-831,799,114.09	845,089,308.54
本期利润	312,380,593.61	-1,186,054,850.52	902,293,815.59
加权平均基金份额本期利润	0.1931	0.6304	0.7770
本期基金份额净值增长率	40.12%	-57.21%	107.31%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3525	-0.5317	0.0734
期末基金资产净值	898,229,578.48	877,280,408.28	1,668,070,202.84
期末基金份额净值	0.6562	0.4683	1.0945

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	14.16%	0.81%	14.59%	1.30%	-0.43%	-0.49%
过去六个月	13.26%	0.93%	10.70%	1.58%	2.56%	-0.65%
过去一年	40.12%	0.86%	66.45%	1.51%	-26.33%	-0.65%
过去三年	24.29%	1.92%	64.86%	1.89%	-40.57%	0.03%
过去五年	165.06%	1.65%	177.41%	1.61%	-12.35%	0.04%
自基金合同生效起至今	165.48%	1.64%	162.08%	1.59%	3.40%	0.05%

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

东方龙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

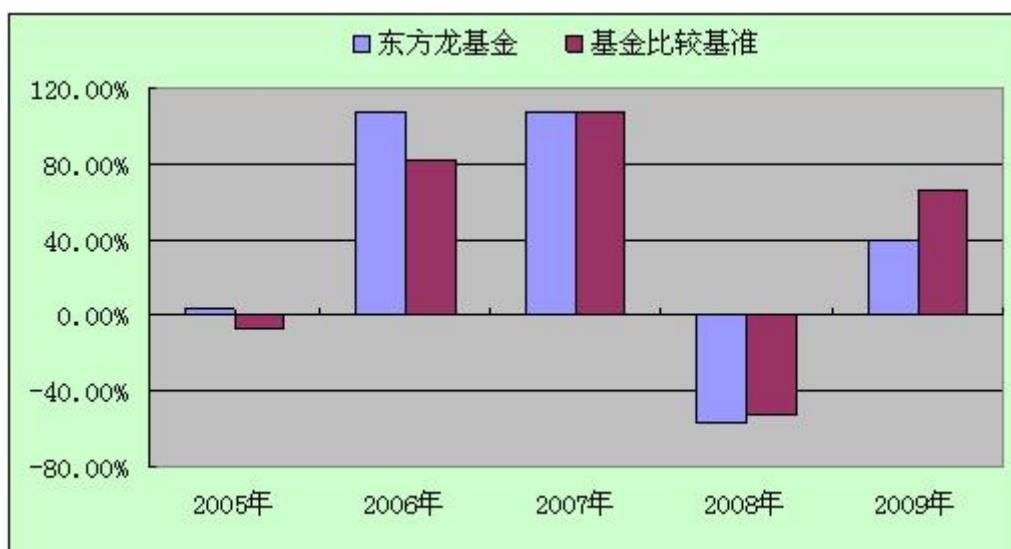
（2004 年 11 月 25 日至 2009 年 12 月 31 日）



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

东方龙混合型开放式证券投资基金

过去五年基金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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009	-	-	-	-	-

2008	-	-	-	-	-
2007	11.815	343,183,349.77	361,402,152.91	704,585,502.68	-
合计	11.815	343,183,349.77	361,402,152.91	704,585,502.68	-

§ 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	2008-09-20	-	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, 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。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。2008 年 6 月 3 日至今担任东方策略成长股

					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、《东方龙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。

本报告期内，由于首次使用电子平台进行累计投标询价，因误操作导致“四川成渝”股票申购无效。为切实保护基金份额持有人利益，基金管理人及时采取了补救措施，弥补了资金无效申购期间的利息损失。事后，公司对相关责任人员进行了严肃处理，完善了新股申购的制度、流程，加强了操作人员的管理和培训。

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

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：东方龙混合型开放式证券投资基金（本基金）、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”）。本基金本报告期净值增长率低于东方精选基金 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 49.31%，东方精选基金股票资产占基金净值比例为 93.21%，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，本基金对市场的走势判断出现了失误，认为市场将以震荡为主，投资品种上以业绩明确、估值较低的行业为主，股票仓位较低。下半年适当增加了股票仓位，并进行了波段操作。

本基金从审慎的角度出发，主要选择了银行、保险、商业、地产、食品饮料、港口等业绩明确、有确定增长空间的行业。在上半年大盘上涨过程中，本基金适当降低了仓位。进入三季度后，本基金在大盘回调过程中适当增加了股票仓位，并积极参与网下新股的发行，对持仓品种也进行了调整，卖出了部分估值较高的品种，增持了钢铁、化工等业绩复苏的行业。

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 40.12%，业绩比较基准收益率为 66.45%，低于业绩比较基准 26.33%，弱于沪深 300 指数的收益率。总体来看，本基金上半年业绩表现不佳，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

对于 2010 年的 A 股市场，本基金认为可能将会大幅震荡、但涨幅有限。随着经济的好转，政府刺激政策的退出事实上已经开始，对资产泡沫的调控将列入管理层的日程，这些可能会影响二级市场投资者的信心，并造成市场的大幅波动；从固定资产占 GDP 的比重看，固定资产投资继续大幅度增长的可能性非常低；国外经济的复苏对中国的出口将起到积极作用。从估值上看，由于 A 股的估值并未低估，市场整体难以重现 2009 年的辉煌。

在操作上，本基金将选择业绩稳定、估值相对低的公司长期持有，重点关注银行、化工、商业、食品饮料等行业；密切关注股指期货、融资融券等带来的盈利机会；继续积极参与优质新股的网下发行；把握好宏观经济结构转型带来的投资机会；在市场震荡过程中通过仓位的调整来增强收益。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

§ 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，发现本基金无效申购“四川成渝”并及时通知了基金管理人。基金管理人对上述行为给基金资产造成的损失进行了补偿，对基金份额持有人利益未造成损害。

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80306号

东方龙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龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方龙基金”）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》、《东方龙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龙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，东方龙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》、《东方龙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龙基金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：东方龙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	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	410,185,581.24	229,152,799.75
结算备付金	1,817,901.84	216,760.93
存出保证金	705,602.17	412,749.05
交易性金融资产	488,809,024.93	652,351,968.61
其中：股票投资	442,960,824.93	545,670,968.61
基金投资	-	-
债券投资	45,848,200.00	106,681,000.00
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	1,696,337.81	-
应收利息	95,313.20	3,029,973.24
应收股利	-	-
应收申购款	176,104.20	67,372.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	903,485,865.39	885,231,623.86
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	-	4,500,499.96
应付赎回款	1,717,639.96	410,691.79
应付管理人报酬	1,144,542.48	1,152,212.49
应付托管费	190,757.07	192,035.45
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	864,987.36	359,944.02

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,338,360.04	1,335,831.87
负债合计	5,256,286.91	7,951,215.58
所有者权益：		
实收基金	1,368,856,076.75	1,873,151,808.19
未分配利润	-470,626,498.27	-995,871,399.91
所有者权益合计	898,229,578.48	877,280,408.28
负债和所有者权益总计	903,485,865.39	885,231,623.86

注：报告截止日期 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6562 元，基金总份额

1,368,856,076.75 份。

7.2 利润表

会计主体：东方龙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	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月 31日
一、收入	333,196,239.17	-1,139,662,923.35
1. 利息收入	4,269,408.40	3,476,017.03
其中：存款利息收入	2,809,953.76	2,513,697.66
债券利息收入	1,459,198.06	958,683.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	256.58	3,635.95
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	12,915,787.08	-789,414,789.76
其中：股票投资收益	8,741,157.69	-798,622,594.50
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,518.66	26,888.47
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	73,456.74
股利收益	4,170,110.73	9,107,459.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	315,748,733.04	-354,255,736.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填	-	-

列)		
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	262,310.65	531,585.81
减：二、费用	20,815,645.56	46,391,927.17
1. 管理人报酬	13,674,245.34	19,712,813.75
2. 托管费	2,279,041.00	3,285,469.05
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,438,570.91	23,185,794.77
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	423,788.31	207,849.60
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	312,380,593.61	-1,186,054,850.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	312,380,593.61	-1,186,054,850.52

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：东方龙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)	1,873,151,808.19	-995,871,399.91	877,280,408.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	312,380,593.61	312,380,593.61
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)	-504,295,731.44	212,864,308.03	-291,431,423.41
其中：1. 基金申购款	74,172,117.30	-31,452,647.08	42,719,470.22
2. 基金赎回款	-578,467,848.74	244,316,955.11	-334,150,893.63
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）	1,368,856,076.75	-470,626,498.27	898,229,578.48
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（基金净值）	1,523,987,683.03	144,082,519.81	1,668,070,202.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,186,054,850.52	-1,186,054,850.52
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）	349,164,125.16	46,100,930.80	395,265,055.96
其中：1. 基金申购款	909,437,169.42	-68,563,284.08	840,873,885.34
2. 基金赎回款	560,273,044.26	114,664,214.88	445,608,829.38
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）	1,873,151,808.19	-995,871,399.91	877,280,408.28

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

东方龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2004 年 9 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于同意东方龙混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2004】152 号）和《关于募集东方龙混合型开放式证券投资基金的确认函》（基金部函【2004】117 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《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》发起设立。本基金为混合型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,130,234,808.17 元人民币，业经普华永道中天会计师事务所有限公司“普华永道中天验字（2004）第 220 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》于 2004 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

1,130,727,725.99 份基金单位，其中认购资金利息折合 492,917.82 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《东方龙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 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》、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 年度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	567,024,001.18	20.76%	4,713,832,262.00	61.99%

7.4.8.1.2 权证交易

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	占当期权证成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
东北证券股份 有限公司	-	-	652,709.54	100.00%

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	465,477.09	20.39%	248,976.67	28.82%
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	3,950,501.32	61.69%	-	-

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	13,674,245.34	19,712,813.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,720,491.28	2,414,030.64

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 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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	2,279,041.00	3,285,469.05

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 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延

至最近可支付日支付。

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,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

本报告期及上年度可比期间,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海市原水股份有限公司	39,618,000.00	2.89%	39,618,000.00	2.12%

注:(1)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。

(2)上海市原水股份有限公司于 2008 年 5 月 8 日刊登了名称变更公告,由原“上海市原水股份有限公司”更名为“上海城投控股股份有限公司”。

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 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
中国建设银行股份有限公司	410,185,581.24	2,795,008.08	229,152,799.75	2,419,855.58

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,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

7.4.12.1.1 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
601989	中国重工	2009-12-09	2010-03-16	认购新股	7.38	7.81	251,162	1,853,575.56	1,961,575.22	-
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	认购新股	11.78	20.94	89,359	1,052,649.02	1,871,177.46	-
601139	深圳燃气	2009-12-15	2010-03-25	认购新股	6.95	16.78	83,022	577,002.90	1,393,109.16	-
002300	太阳电缆	2009-10-13	2010-01-21	认购新股	20.56	33.33	48,535	997,879.60	1,617,671.55	-
002302	西部建设	2009-10-22	2010-02-03	认购新股	15.00	31.79	51,233	768,495.00	1,628,697.07	-
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	认购新股	60.00	113.99	12,991	779,460.00	1,480,844.09	-
002305	南国置业	2009-10-29	2010-02-08	认购新股	12.30	19.57	59,221	728,418.30	1,158,954.97	-
002306	湘鄂情	2009-11-05	2010-02-11	认购新股	18.90	33.36	46,639	881,477.10	1,555,877.04	-
002307	北新路桥	2009-11-05	2010-02-11	认购新股	8.58	27.40	60,106	515,709.48	1,646,904.40	-
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	认购新股	23.80	31.83	56,492	1,344,509.60	1,798,140.36	-
002309	中利科技	2009-11-18	2010-03-01	认购新股	46.00	61.21	6,771	311,466.00	414,452.91	-
002310	东方园林	2009-11-20	2010-03-01	认购新股	58.60	110.88	13,914	815,360.40	1,542,784.32	-
002311	海大集团	2009-11-20	2010-03-01	认购新股	28.00	37.54	52,646	1,474,088.00	1,976,330.84	-
002313	日海通讯	2009-11-26	2010-03-03	认购新股	24.80	40.82	17,281	428,568.80	705,410.42	-
002315	焦点科技	2009-12-01	2010-03-09	认购新股	42.00	69.18	21,100	886,200.00	1,459,698.00	-
002316	键桥通讯	2009-12-01	2010-03-09	认购新股	18.80	31.13	11,984	225,299.20	373,061.92	-

002317	众生药业	2009-12-03	2010-03-11	认购新股	55.00	70.77	26,782	1,473,010.00	1,895,362.14	-
002318	久立特材	2009-12-03	2010-03-11	认购新股	23.00	33.13	15,054	346,242.00	498,739.02	-
002319	乐通股份	2009-12-03	2010-03-11	认购新股	13.70	31.28	34,019	466,060.30	1,064,114.32	-
002320	海峡股份	2009-12-09	2010-03-16	认购新股	33.60	51.18	13,298	446,812.80	680,591.64	-
002321	华英农业	2009-12-09	2010-03-16	认购新股	16.98	26.61	55,505	942,474.90	1,476,988.05	-
002322	理工监测	2009-12-11	2010-03-18	认购新股	40.00	61.88	14,995	599,800.00	927,890.60	-
002323	中联电气	2009-12-11	2010-03-18	认购新股	30.00	40.57	23,045	691,350.00	934,935.65	-
002324	普利特	2009-12-11	2010-03-18	认购新股	22.50	34.62	33,562	755,145.00	1,161,916.44	-
002325	洪涛股份	2009-12-15	2010-03-22	认购新股	27.00	33.18	30,354	819,558.00	1,007,145.72	-
002326	永太科技	2009-12-15	2010-03-22	认购新股	20.00	31.27	37,849	756,980.00	1,183,538.23	-
002327	富安娜	2009-12-22	2010-03-30	认购新股	30.00	39.66	27,665	829,950.00	1,097,193.90	-
002328	新朋股份	2009-12-22	2010-03-30	认购新股	19.38	26.55	139,563	2,704,730.94	3,705,397.65	-
002329	皇氏乳业	2009-12-25	-	认购新股	20.10	20.10	51,032	1,025,743.20	1,025,743.20	可流通日未定
002330	得利斯	2009-12-25	-	认购新股	13.18	13.18	107,009	1,410,378.62	1,410,378.62	可流通日未定
002332	仙琚制药	2009-12-30	-	认购新股	8.20	8.20	97,604	800,352.80	800,352.80	可流通日未定
002333	罗普斯金	2009-12-30	-	认购新股	22.00	22.00	38,985	857,670.00	857,670.00	可流通日未定
300002	神州泰岳	2009-09-29	2010-02-01	认购新股	58.00	105.20	11,389	660,562.00	1,198,122.80	-
300003	乐普医疗	2009-09-29	2010-02-01	认购新股	29.00	51.20	60,281	1,748,149.00	3,086,387.20	-

300005	探路者	2009-09-29	2010-02-01	认购新股	19.80	43.17	29,177	577,704.60	1,259,571.09	-
300009	安科生物	2009-09-29	2010-02-01	认购新股	17.00	42.67	25,917	440,589.00	1,105,878.39	-
300012	华测检测	2009-10-15	2010-02-01	认购新股	25.78	43.14	9,482	244,445.96	409,053.48	-
300014	亿纬锂能	2009-10-15	2010-02-01	认购新股	18.00	39.55	18,571	334,278.00	734,483.05	-
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	认购新股	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	-
300017	网宿科技	2009-10-15	2010-02-01	认购新股	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	-
300021	大禹节水	2009-10-19	2010-02-03	认购新股	14.00	41.20	91,837	1,285,718.00	3,783,684.40	-
300024	机器人	2009-10-19	2010-02-01	认购新股	39.80	72.28	25,175	1,001,965.00	1,819,649.00	-
300025	华星创业	2009-10-19	2010-02-01	认购新股	19.66	46.07	14,705	289,100.30	677,459.35	-
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	认购新股	28.58	55.43	46,222	1,321,024.76	2,562,085.46	-
300030	阳普医疗	2009-12-18	2010-03-26	认购新股	25.00	35.10	21,667	541,675.00	760,511.70	-
300032	金龙机电	2009-12-18	2010-03-25	认购新股	19.00	29.80	95,611	1,816,609.00	2,849,207.80	-
300034	钢研高纳	2009-12-18	2010-03-25	认购新股	19.53	34.53	67,656	1,321,321.68	2,336,161.68	-
300036	超图软件	2009-12-18	2010-03-25	认购新股	19.60	38.31	24,330	476,868.00	932,082.30	-
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	-	认购新股	33.00	33.00	62,578	2,065,074.00	2,065,074.00	可流通日未定

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	442,960,824.93	49.03
	其中：股票	442,960,824.93	49.03
2	固定收益投资	45,848,200.00	5.07
	其中：债券	45,848,200.00	5.07
	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	412,003,483.08	45.60
6	其他各项资产	2,673,357.38	0.30
7	合计	903,485,865.39	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	1,476,988.05	0.16
B	采掘业	-	-
C	制造业	153,605,617.64	17.10
C0	食品、饮料	37,588,896.75	4.18
C1	纺织、服装、皮毛	17,636,350.54	1.96
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	4,342,571.09	0.48
C4	石油、化学、塑胶、塑料	31,505,517.43	3.51
C5	电子	3,583,690.85	0.40
C6	金属、非金属	31,383,665.42	3.49
C7	机械、设备、仪表	23,744,332.23	2.64
C8	医药、生物制品	3,820,593.33	0.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,287,109.16	0.37
E	建筑业	22,291,834.44	2.48
F	交通运输、仓储业	75,409,729.44	8.40
G	信息技术业	17,051,479.39	1.90
H	批发和零售贸易	9,080,000.00	1.01
I	金融、保险业	105,894,600.00	11.79
J	房地产业	29,099,654.97	3.24
K	社会服务业	8,080,726.38	0.90
L	传播与文化产业	2,562,085.46	0.29
M	综合类	15,121,000.00	1.68
	合计	442,960,824.93	49.31

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	600036	招商银行	1,500,000	27,075,000.00	3.01
2	000022	深赤湾A	1,700,000	25,721,000.00	2.86
3	000568	泸州老窖	600,000	23,424,000.00	2.61
4	600016	民生银行	2,300,000	18,193,000.00	2.03

5	000088	盐 田 港	2,100,000	17,451,000.00	1.94
6	601328	交通银行	1,800,000	16,830,000.00	1.87
7	601668	中国建筑	3,500,000	16,520,000.00	1.84
8	000402	金 融 街	1,200,000	14,556,000.00	1.62
9	600269	赣粤高速	1,600,000	13,904,000.00	1.55
10	601318	中国平安	240,000	13,221,600.00	1.47

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	000022	深赤湾 A	34,222,525.40	3.90
2	601328	交通银行	28,816,014.04	3.28
3	601668	中国建筑	28,583,759.06	3.26
4	000088	盐 田 港	27,838,028.60	3.17
5	600269	赣粤高速	26,607,960.90	3.03
6	601006	大秦铁路	26,156,590.42	2.98
7	600009	上海机场	25,325,478.29	2.89
8	600016	民生银行	23,488,229.47	2.68
9	600036	招商银行	23,465,798.09	2.67
10	000002	万 科 A	22,683,396.18	2.59
11	600015	华夏银行	20,277,065.56	2.31
12	601390	中国中铁	19,613,559.62	2.24
13	000629	攀钢钢钒	18,254,312.30	2.08
14	000089	深圳机场	17,259,050.92	1.97
15	601398	工商银行	17,224,136.71	1.96
16	000726	鲁 泰 A	16,981,445.25	1.94
17	600028	中国石化	15,664,250.76	1.79
18	000826	合加资源	14,760,666.18	1.68
19	600383	金地集团	13,996,146.00	1.60

20	600966	博汇纸业	13,920,871.29	1.59
----	--------	------	---------------	------

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	000402	金融街	50,086,076.67	5.71
2	601398	工商银行	48,637,284.00	5.54
3	000629	攀钢钢钒	48,595,052.06	5.54
4	600009	上海机场	47,352,796.42	5.40
5	601318	中国平安	41,626,447.84	4.74
6	601601	中国太保	40,784,441.54	4.65
7	600019	宝钢股份	33,656,298.98	3.84
8	600036	招商银行	33,604,602.67	3.83
9	600141	兴发集团	29,679,374.86	3.38
10	600635	大众公用	29,482,138.36	3.36
11	600016	民生银行	28,889,025.66	3.29
12	600875	东方电气	28,458,379.84	3.24
13	600028	中国石化	26,671,816.14	3.04
14	600005	武钢股份	26,412,772.94	3.01
15	000002	万科A	25,960,402.22	2.96
16	600858	银座股份	25,549,912.44	2.91
17	000959	首钢股份	24,846,164.60	2.83
18	000063	中兴通讯	22,561,435.35	2.57
19	000568	泸州老窖	21,878,936.39	2.49
20	600583	海油工程	21,489,237.17	2.45
21	601006	大秦铁路	20,785,056.07	2.37
22	601328	交通银行	20,422,013.24	2.33
23	000089	深圳机场	18,776,581.20	2.14
24	600050	中国联通	18,491,126.43	2.11
25	600269	赣粤高速	18,183,610.04	2.07

26	601390	中国中铁	18,142,104.76	2.07
----	--------	------	---------------	------

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	1,191,883,019.97
卖出股票的收入（成交）总额	1,619,703,588.24

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	45,848,200.00	5.10
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	45,848,200.00	5.10

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	400,000	39,868,000.00	4.44
2	0901051	09 央行票据 51	60,000	5,980,200.00	0.67

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	705,602.17
2	应收证券清算款	1,696,337.81
3	应收股利	-
4	应收利息	95,313.20
5	应收申购款	176,104.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,673,357.38

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
76,069	17,994.93	41,553,552.71	3.04%	1,327,302,524.04	96.96%

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	868,882.56	0.06%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年11月25日)基金份额总额	1,130,727,725.99
本报告期期初基金份额总额	1,873,151,808.19
本报告期期间基金总申购份额	74,172,117.30
减：本报告期期间基金总赎回份额	578,467,848.74
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	1,368,856,076.75

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。

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、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、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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
东北证券股份有限公司	2	567,024,001.18	20.76%	465,477.09	20.39%	-
东方证券股份有限公司	2	152,724,077.93	5.59%	129,815.22	5.69%	-
中国国际金融有限公司	1	231,164,601.33	8.46%	190,815.46	8.36%	-
中信证券股份有限公司	2	138,936,963.04	5.09%	118,096.23	5.17%	-
中国银河证券股份有限公司	1	275,897,977.37	10.10%	224,168.95	9.82%	-
国信证券股份有限公司	1	75,724,686.75	2.77%	64,365.34	2.82%	-
申银万国证券股份有限公司	1	290,840,673.87	10.65%	247,213.80	10.83%	-
国金证券股份有限公司	1	101,836,622.14	3.73%	82,743.12	3.62%	-
中国建银投资证券有限公司	1	67,689,101.59	2.48%	54,997.85	2.41%	-
长江证券股份有限公司	1	829,682,331.89	30.37%	705,225.99	30.89%	-

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）根据业务需要，本报告期新增东方证券股份有限公司、国元债券股份有限公司深圳交易单元各 1 个。

（3）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。

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
长江证券股份有限公司	735,396.50	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持有“盐湖钾肥”恢复“市值估值法”的公告	指定报刊、网站	2009-01-16
2	本基金招募说明书(更新)摘要(2008年第2号)	指定报刊、网站	2009-01-08
3	本基金招募说明书(更新)(2008年第2号)	网站	2009-01-08
4	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
5	本基金基金合同(2009年1月18日修订)	网站	2009-01-19
6	本基金2008年第4季度报告	指定报刊、网站	2009-01-22
7	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
8	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
9	本公司关于变更督察长的公告	指定报刊、网站	2009-02-12
10	本公司关于降低旗下基金定期定额投资业务起	指定报刊、网站	2009-02-24

	始金额的公告		
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
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 2008 年年度报告	网站	2009-03-31
21	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
22	本基金 2009 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2009-04-20
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	本基金招募说明书（更新）摘要（2009 年第 1 号）	指定报刊、网站	2009-07-08
31	本基金招募说明书（更新）（2009 年第 1 号）	网站	2009-07-08
32	本公司关于上海分公司成立公告	指定报刊、网站	2010-07-13
33	本基金 2009 年第 2 季度报告	指定报刊、网站	2009-07-21

34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	本公司关于总经理任职的公告	指定报刊、网站	2009-08-18
40	本基金 2009 年半年度报告（正文）	网站	2009-08-27
41	本基金 2009 年半年度报告（摘要）	指定报刊、网站	2009-08-27
42	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
43	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
44	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
45	本基金 2009 年第 3 季度报告	指定报刊、网站	2009-10-28
46	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
47	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
48	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 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