

东方龙混合型开放式证券投资基金

2010 年半年度报告

2010 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年八月二十五日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

一、基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

二、基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 23 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。

三、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

四、基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

五、本报告中财务资料未经审计。

六、本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
§ 2 基金简介	3
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	6
§ 5 托管人报告	9
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§ 7 投资组合报告	27
7.1 期末基金资产组合情况	27
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	32
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	33
7.9 投资组合报告附注	33
§ 8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	34
§ 9 开放式基金份额变动	34
§ 10 重大事件揭示	34
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	38
§ 12 备查文件目录	38

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方龙混合型开放式证券投资基金
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	1,489,354,351.96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	<p>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。</p> <p>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%。</p> <p>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。</p>
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.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 400-628-5888	010-67595096
传真		010-66578700	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 (长安兴融中心)
邮政编码		100140	100033
法定代表人		李维雄	郭树清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2010年1月1日至2010年6月30日）
本期已实现收益	40,459,121.72
本期利润	-106,648,958.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0791
本期加权平均净值利润率	-12.38%
本期基金份额净值增长率	-11.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配利润	-627,005,394.15
期末可供分配基金份额利润	-0.4210
期末基金资产净值	862,348,957.81
期末基金份额净值	0.5790
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010年6月30日)
基金份额累计净值增长率	134.25%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

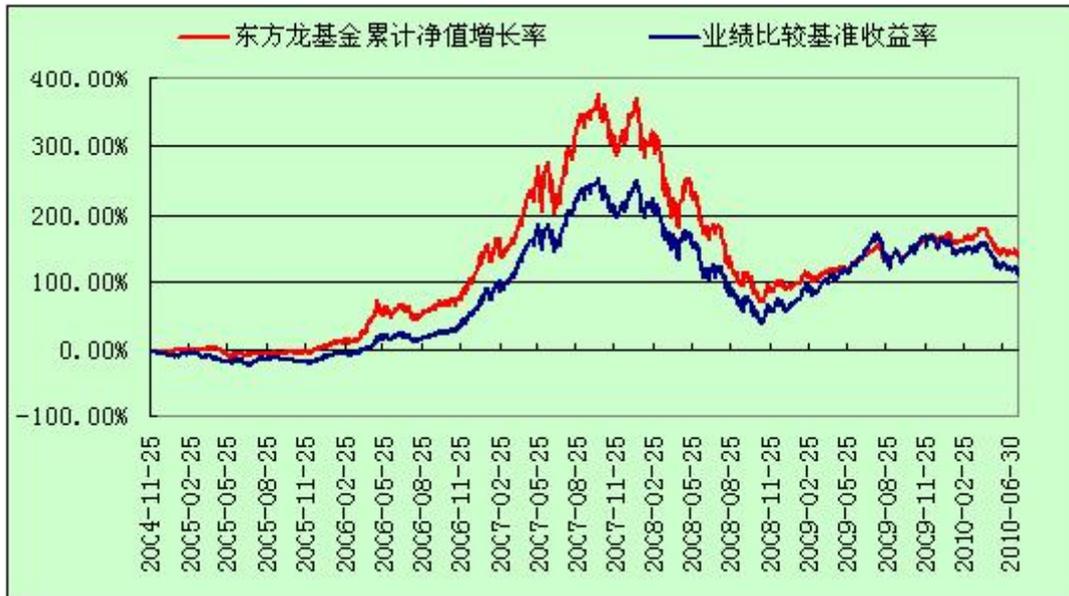
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.40%	1.03%	-5.65%	1.22%	2.25%	-0.19%
过去三个月	-15.14%	1.12%	-17.27%	1.34%	2.13%	-0.22%
过去六个月	-11.76%	0.96%	-20.44%	1.18%	8.68%	-0.22%
过去一年	-0.07%	0.95%	-11.92%	1.41%	11.85%	-0.46%
过去三年	-26.96%	1.69%	-18.62%	1.79%	-8.34%	-0.10%
自基金合同生效起至今	134.25%	1.59%	108.51%	1.56%	25.74%	0.03%

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 2010 年 6 月 30 日)



注：①根据《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票 0%~95%、债券 0%~95%、货币市场工具 5%~100%，基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。本报告期内，本基金严格执行了《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》的相关规定。

②本基金合同规定，基金建仓期为自基金合同生效之日起六个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。本基金基金合同生效日为 2004 年 11 月 25 日，截止 2010 年 6 月 30 日，本基金基金合同生效不满六年。

③所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司。东方基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”)经中国证监会批准(证监基金字【2004】80 号)于 2004 年 6 月 11 日成立，是《中华人民共和国证券投资基金法》施行后成立的第一家基金管理公司。本公司注册资本 1 亿元人民币。本公司股东为东北证券股份有限公司，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 2010 年 6 月 30 日，本公司管理六只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿

货币市场证券投资基金、东方策略成长股票型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力股票型开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于鑫（先生）	本基金基金经理、投资决策委员会委员	2008-09-20	-	9 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 年加盟东方基金管理有限责任公司，曾任东方精选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遵规守信情况的说明

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作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 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）和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”）。2010 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金净值增长率为-11.76%，东方精选基金净值增长率为-22.24%，本基金净值增长率高于东方精选基金 10.48%。原因在于两只基金的仓位不同，2010 年上半年度，本基金股票资产占基金净值比例为 67.90%，东方精选基金股票资产占基金净值比例为 88.41%，对市场具有代表意义的沪深 300 指数收益率为-23.39%。

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，本基金主要持有业绩优良、增长明确的绩优公司，自下而上发掘新的投资品种，适当通过仓位调整来获取超额收益，寻找机会以较低的风险获取较高的收益。

一季度，在市场调整过程中，本基金适当提高了仓位，主要增持了银行、保险等业绩明确、有确定增长空间的行业，还增持了地产等业绩向好的行业，同时减持了一些估值较高的小盘股票。随后，国家对房地产调控措施进一步加强。本基金在政策出台后，及时采取了应对措施，较大幅度降低了房地产行业的仓位，增持了商业贸易、食品饮料等业绩增长稳定的行业，并整体上降低了仓位。但本基金的净值在四月份有一定损失。六月中下旬，本基金又适当提高了仓位，小幅度增持了银行、保险、机械等行业。在报告期内，本基金通过对新股的认真研究，主动参与了网下部分优质新股的发行，在风险较低的情况下获取了相对较好的收益。

总的看来，本基金上半年的操作较好，基金净值跌幅远小于沪深 300 指数的跌幅，取得了较好的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金净值增长率为-11.76%，业绩比较基准收益率为-20.44%，高于业绩比较基准 8.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年年中以来的适度从紧政策正在逐渐产生效果，宏观经济增速有所放缓，固定资产投资增速逐步降低；国内消费一直保持了很好的势头；出口也保持了较高的增速。总的看，目前的经济情况较 2009 年上半年有很大的改善。下半年，预计不会出台进一步的从紧政策，管理层将针对经济的运行情况，进行微调。宏观经济增速有望企稳。

由于去年市场涨幅较大，A 股市场估值相对提升较快，抑制了做多的力量；资金面上，新增资金入市规模减少，而融资、再融资规模较大，导致市场走势偏弱。进入下半年，权重

股估值已进入合理区间，部分公司的 A 股公司的价格较海外交易的价格有很大的价格折让，对市场提供了支撑。预计下半年 A 股市场将以震荡为主。

行业层面上，金融、地产、钢铁、煤炭、工程机械、家电等行业估值较低，虽然行业运行趋势不明朗，但已进入可投资区间；食品饮料、医药、商业百货、服装等行业依然增长较好；部分新兴产业发展迅速，但相关公司估值较高。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会公告【2008】38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的相关规定，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方龙混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	170,474,332.52	410,185,581.24
结算备付金		862,073.81	1,817,901.84
存出保证金		923,954.94	705,602.17
交易性金融资产	6.4.7.2	665,005,517.49	488,809,024.93
其中：股票投资		585,512,733.09	442,960,824.93
基金投资		-	-
债券投资		79,492,784.40	45,848,200.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	-
应收证券清算款		17,820,000.00	1,696,337.81
应收利息	6.4.7.4	1,180,800.49	95,313.20
应收股利		181,904.22	-
应收申购款		22,187,098.25	176,104.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		878,635,681.72	903,485,865.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 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		12,441,692.40	-
应付赎回款		177,950.02	1,717,639.96
应付管理人报酬		997,479.49	1,144,542.48

应付托管费		166,246.59	190,757.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	1,060,049.81	864,987.36
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,443,305.60	1,338,360.04
负债合计		16,286,723.91	5,256,286.91
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	1,489,354,351.96	1,368,856,076.75
未分配利润	6.4.7.9	-627,005,394.15	-470,626,498.27
所有者权益合计		862,348,957.81	898,229,578.48
负债和所有者权益总计		878,635,681.72	903,485,865.39

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5790 元，基金总份额 1,489,354,351.96 份。

6.2 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：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日
一、收入		-96,140,100.11	208,202,295.71
1. 利息收入		1,139,618.64	2,801,432.82
其中：存款利息收入	6.4.7.10	708,635.69	1,738,871.45
债券利息收入		393,066.30	1,062,304.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37,916.65	256.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,768,723.42	-76,183,518.35
其中：股票投资收益	6.4.7.11	47,559,521.27	-78,199,606.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-1,480.00	-166,050.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.13	2,210,682.15	2,182,138.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-147,108,080.01	281,460,722.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	59,637.84	123,659.03
减：二、费用		10,508,858.18	9,966,618.86
1. 管理人报酬		6,404,218.95	6,926,463.31

2. 托管费		1,067,369.85	1,154,410.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.16	2,816,588.33	1,687,534.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.17	220,681.05	198,210.65
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-106,648,958.29	198,235,676.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-106,648,958.29	198,235,676.85

6.3 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：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,368,856,076.75	-470,626,498.27	898,229,578.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-106,648,958.29	-106,648,958.29
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)	120,498,275.21	-49,729,937.59	70,768,337.62
其中：1. 基金申购款	205,468,809.54	-79,362,900.44	126,105,909.10
2. 基金赎回款	-84,970,534.33	29,632,962.85	-55,337,571.48
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)	1,489,354,351.96	-627,005,394.15	862,348,957.81
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	198,235,676.85	198,235,676.85
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)	-220,840,730.75	102,738,949.08	-118,101,781.67

填列)			
其中: 1. 基金申购款	30,889,964.34	-14,450,372.44	16,439,591.90
2. 基金赎回款	-251,730,695.09	117,189,321.52	-134,541,373.57
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)	1,652,311,077.44	-694,896,773.98	957,414,303.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 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: 郝丽琨

6.4 报表附注

6.4.1 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“普化永道中天验字(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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照中国财政部 2006 年 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 3 号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合《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 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
活期存款	170,474,332.52
定期存款	-
其他存款	-
合计	170,474,332.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	671,099,663.06	585,512,733.09	-85,586,929.97	
债券	交易所市场	946,000.00	956,784.40	10,784.40
	银行间市场	78,599,520.00	78,536,000.00	-63,520.00
	合计	79,545,520.00	79,492,784.40	-52,735.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	750,645,183.06	665,005,517.49	-85,639,665.57	

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应收活期存款利息	31,249.87
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	301.80
应收债券利息	1,145,418.46
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3,781.16
其他	49.20
合计	1,180,800.49

注：“其他”为应收权证保证金利息。

6.4.7.5 其他资产

本期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,058,856.57
银行间市场应付交易费用	1,193.24
合计	1,060,049.81

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00
应付赎回费	368.31
预提费用	192,937.29
合计	1,443,305.60

注：预提费用包括按日计提的审计费和银行间账户维护费。

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,368,856,076.75	1,368,856,076.75
本期申购	205,468,809.54	205,468,809.54
本期赎回（以“-”号填列）	-84,970,534.33	-84,970,534.33
本期末	1,489,354,351.96	1,489,354,351.96

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.9 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	-482,527,875.52	11,901,377.25	-470,626,498.27
本期利润	40,459,121.72	-147,108,080.01	-106,648,958.29
本期基金份额交易产生的变动数	-38,380,838.60	-11,349,098.99	-49,729,937.59
其中：基金申购款	-66,369,544.60	-12,993,355.84	-79,362,900.44
基金赎回款	27,988,706.00	1,644,256.85	29,632,962.85

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-480,449,592.40	-146,555,801.75	-627,005,394.15

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
活期存款利息收入	693,193.06
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	10,010.18
其他	5,432.45
合计	708,635.69

注：“其他”包含基金申购款利息收入 4,540.82 元，基金权证保证金利息收入 891.63 元。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出股票成交总额	866,899,938.53
减：卖出股票成本总额	819,340,417.26
买卖股票差价收入	47,559,521.27

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	86,000,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	85,709,680.00
减：应收利息总额	291,800.00
债券投资收益	-1,480.00

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,210,682.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,210,682.15

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
1. 交易性金融资产	-147,108,080.01
——股票投资	-147,056,824.41
——债券投资	-51,255.60
——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	-147,108,080.01

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
基金赎回费收入	36,520.07
印花税返还	17,332.93
基金转换费收入	5,784.84
合计	59,637.84

6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
交易所市场交易费用	2,815,988.33
银行间市场交易费用	600.00
合计	2,816,588.33

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	23,243.76
持有人大会费	-
债券帐户维护费	9,000.00
交易所费用	-
其他	-
合计	220,681.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海城投控股股份有限公司	本基金管理人股东
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、代销机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
东北证券股份 有限公司	413,999,575.63	21.79%	169,871,143.60	17.48%

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券股份有 限公司	336,378.23	21.23%	336,378.23	31.77%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日 至 2009年6月30日			
	当期	占当期佣	期末应付	占期末应付佣

	佣金	金总量的比例	佣金余额	金总额的比例
东北证券股份有限公司	142,787.60	17.59%	59,917.22	13.57%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年6月 30日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,404,218.95	6,926,463.31
其中：支付销售机构的客户维护费	816,735.48	866,545.62

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年6月 30日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,067,369.85	1,154,410.62

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010年6月30日		上年度末 2009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	2.66%	39,618,000.00	2.89%

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”。

6.4.10.5 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 2010年1月1日至 2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	170,474,332.52	693,193.06	572,408,384.50	1,734,110.31

6.4.10.6 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关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2010年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002378	章源钨业	2010-03-23	2010-07-01	认购新股	13.00	26.34	69,786	907,218.00	1,838,163.24	-
002380	科远股份	2010-03-23	2010-07-01	认购新股	39.00	46.13	44,823	1,748,097.00	2,067,684.99	-
002383	合众思壮	2010-03-26	2010-07-02	认购新股	37.00	48.45	41,124	1,521,588.00	1,992,457.80	-
002385	大北农	2010-03-31	2010-07-09	认购新股	35.00	32.32	29,734	1,040,690.00	961,002.88	-
002386	天原集团	2010-03-31	2010-07-09	认购新股	15.36	16.53	60,174	924,272.64	994,676.22	-
002387	黑牛食品	2010-04-02	2010-07-13	认购新股	27.00	36.96	29,968	809,136.00	1,107,617.28	-
002388	新亚制程	2010-04-02	2010-07-13	认购新股	15.00	30.92	42,464	636,960.00	1,312,986.88	-
002389	南洋科技	2010-04-02	2010-07-13	认购新股	30.00	55.19	24,630	738,900.00	1,359,329.70	-
002391	长青股份	2010-04-08	2010-07-16	认购新股	51.00	45.39	16,643	848,793.00	755,425.77	-
002397	梦洁家纺	2010-04-21	2010-07-29	认购新股	51.00	53.76	16,052	818,652.00	862,955.52	-
002400	省广股份	2010-04-28	2010-08-06	认购新股	39.80	35.26	34,438	1,370,632.40	1,214,283.88	-
002403	爱仕达	2010-04-30	2010-08-11	认购新股	18.80	16.16	65,583	1,232,960.40	1,059,821.28	-
002405	四维图新	2010-05-06	2010-08-18	认购新股	25.60	33.18	57,541	1,473,049.60	1,909,210.38	-
002411	九九久	2010-05-13	2010-08-25	认购新股	25.80	33.00	10,175	262,515.00	335,775.00	-
002417	三元达	2010-05-21	-	认购新股	20.00	21.47	16,958	339,160.00	364,088.26	可流通日未定
002420	毅昌股份	2010-05-21	-	认购新股	13.80	11.50	21,035	290,283.00	241,902.50	可流通日未定
002421	达实智能	2010-05-26	-	认购新股	20.50	31.79	24,615	504,607.50	782,510.85	可流通日未定
002439	启明星辰	2010-06-09	-	认购新股	25.00	36.41	22,988	574,700.00	836,993.08	可流通日未定
300069	金利华电	2010-04-12	2010-07-21	认购新股	23.90	25.73	16,891	403,694.90	434,605.43	-
300070	碧水源	2010-04-12	2010-07-21	认购新股	69.00	93.20	12,704	876,576.00	1,184,012.80	-
300071	华谊嘉信	2010-04-12	2010-07-21	认购新股	25.00	29.82	19,668	491,700.00	586,499.76	-
300074	华平股份	2010-04-16	2010-07-27	认购新股	72.00	63.41	14,971	1,077,912.00	949,311.11	-
300075	数字政通	2010-04-16	2010-07-27	认购新股	54.00	47.65	10,000	540,000.00	476,500.00	-
300081	恒信移动	2010-05-10	2010-08-20	认购	38.78	32.64	66,666	2,585,307.48	2,175,978.24	-

				新股						
300082	奥克股份	2010-05-10	2010-08-20	认购新股	85.00	67.55	14,099	1,198,415.00	952,387.45	-
300088	长信科技	2010-05-17	-	认购新股	24.00	28.40	36,106	866,544.00	1,025,410.40	可流通日未定
300090	盛运股份	2010-06-18	-	认购新股	17.00	24.12	113,140	1,923,380.00	2,728,936.80	可流通日未定
300093	金刚玻璃	2010-06-30	-	认购新股	16.20	16.20	79,601	1,289,536.20	1,289,536.20	可流通日未定
300094	国联水产	2010-06-30	2010-07-08	认购新股	14.38	14.38	500	7,190.00	7,190.00	-
601000	唐山港	2010-06-22	2010-07-05	认购新股	8.20	8.20	1,000	8,200.00	8,200.00	-
601369	陕鼓动力	2010-04-19	2010-07-28	认购新股	15.50	17.30	12,170	188,635.00	210,541.00	-

注：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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000001	深发展	2010-06-30	因筹划与中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安银行股份有限公司两行整合的重大无先例资产重组事项。	17.51	-	-	100,000	1,840,244.00	1,751,000.00	复牌日期未定
601318	中国平安	2010-06-29	因筹划控股子公司平安银行股份有限公司与深圳发展银行股份有限公司两行整合的重大无先例资产重组事项。	46.81	-	-	680,000	30,592,801.28	31,830,800.00	复牌日期未定
601989	中国重工	2010-05-06	因将讨论相关重要事项具有重大不确定性,需向相关方进行咨询论证。	7.50	2010-07-16	6.71	600,000	4,449,255.96	4,500,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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发行的证券，不超过该证券的百分之十。

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

6.4.13.3 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在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告[6.4.12 期末（2010 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券]中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	170,474,332.52	—	—	—	170,474,332.52
结算备付金	862,073.81	—	—	—	862,073.81
存出保证金	140,741.00	—	—	783,213.94	923,954.94
交易性金融资产	78,536,000.00	—	956,784.40	585,512,733.09	665,005,517.49
应收证券清算款	—	—	—	17,820,000.00	17,820,000.00
应收利息	—	—	—	1,180,800.49	1,180,800.49
应收股利	—	—	—	181,904.22	181,904.22
应收申购款	22,187,098.25	—	—	—	22,187,098.25
资产总计	272,200,245.58	—	956,784.40	605,478,651.74	878,635,681.72
负债					
应付证券清算款	—	—	—	12,441,692.40	12,441,692.40
应付赎回款	—	—	—	177,950.02	177,950.02
应付管理人报酬	—	—	—	997,479.49	997,479.49
应付托管费	—	—	—	166,246.59	166,246.59
应付交易费用	—	—	—	1,060,049.81	1,060,049.81
其他负债	—	—	—	1,443,305.60	1,443,305.60
负债总计	—	—	—	16,286,723.91	16,286,723.91
利率敏感度缺口	272,200,245.58	—	956,784.40	589,191,927.83	862,348,957.81
上年度末 2009年12月31日					
资产					
银行存款	410,185,581.24	—	—	—	410,185,581.24
结算备付金	1,817,901.84	—	—	—	1,817,901.84
存出保证金	140,741.00	—	—	564,861.17	705,602.17
交易性金融资产	45,848,200.00	—	—	442,960,824.93	488,809,024.93
应收证券清算款	—	—	—	1,696,337.81	1,696,337.81
应收利息	—	—	—	95,313.20	95,313.20
应收申购款	176,104.20	—	—	—	176,104.20
资产总计	458,168,528.28	—	—	445,317,337.11	903,485,865.39
负债					
应付赎回款	—	—	—	1,717,639.96	1,717,639.96
应付管理人报酬	—	—	—	1,144,542.48	1,144,542.48
应付托管费	—	—	—	190,757.07	190,757.07

应付交易费用	-	-	-	864,987.36	864,987.36
其他负债	-	-	-	1,338,360.04	1,338,360.04
负债总计	-	-	-	5,256,286.91	5,256,286.91
利率敏感度缺口	458,168,528.28	-	-	440,061,050.20	898,229,578.48

6.4.13.4.1.2 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：人民币元）	
		本期末（2010年6月30日）	上年度末（2009年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-48,323.07	-22,140.00
	市场利率下调 0.25%	48,552.00	22,180.00

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日		上年度末 2009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	585,512,733.09	67.90	442,960,824.93	49.31
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	585,512,733.09	67.90	442,960,824.93	49.31

6.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末（2010年6月30日）	上年度末（2009年12月31日）
	基金业绩比较基准上涨5%	28,665,633.25	20,375,390.18
基金业绩比较基准下跌5%	-28,665,633.25	-20,375,390.18	

6.4.13.4.4 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 18,741,552 元，占基金资产净值比例为 2.17%；上年度末本基金风险价值为 14,941,403 元，占基金资产净值比例为 1.66%。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	585,512,733.09	66.64
	其中：股票	585,512,733.09	66.64
2	固定收益投资	79,492,784.40	9.05
	其中：债券	79,492,784.40	9.05
	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	171,336,406.33	19.50
6	其他各项资产	42,293,757.90	4.81
7	合计	878,635,681.72	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,215,190.00	0.14
B	采掘业	16,140,639.28	1.87
C	制造业	171,583,390.10	19.90
C0	食品、饮料	37,985,620.16	4.40
C1	纺织、服装、皮毛	10,008,247.08	1.16
C2	木材、家具	1,051,500.00	0.12
C3	造纸、印刷	4,099,000.00	0.48
C4	石油、化学、塑胶、塑料	15,436,266.94	1.79
C5	电子	9,020,226.98	1.05
C6	金属、非金属	59,842,420.72	6.94

C7	机械、设备、仪表	30,421,308.22	3.53
C8	医药、生物制品	2,498,000.00	0.29
C99	其他制造业	1,220,800.00	0.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,894,894.12	0.80
E	建筑业	9,596,000.00	1.11
F	交通运输、仓储业	40,135,000.00	4.65
G	信息技术业	19,952,253.12	2.31
H	批发和零售贸易	52,773,128.18	6.12
I	金融、保险业	215,763,641.85	25.02
J	房地产业	31,602,200.00	3.66
K	社会服务业	17,626,296.68	2.04
L	传播与文化产业	586,499.76	0.07
M	综合类	1,643,600.00	0.19
	合计	585,512,733.09	67.90

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	6,500,000	39,325,000.00	4.56
2	000629	*ST 钒钛	4,500,000	36,000,000.00	4.17
3	600036	招商银行	2,634,000	34,268,340.00	3.97
4	601318	中国平安	680,000	31,830,800.00	3.69
5	000858	五粮液	900,000	21,807,000.00	2.53
6	601169	北京银行	1,649,923	20,013,565.99	2.32
7	000022	深赤湾 A	1,550,000	17,887,000.00	2.07
8	601601	中国太保	749,918	17,075,632.86	1.98
9	601009	南京银行	1,549,950	15,561,498.00	1.80
10	000568	泸州老窖	500,000	14,110,000.00	1.64
11	601328	交通银行	2,242,500	13,477,425.00	1.56
12	600861	北京城乡	1,400,000	11,970,000.00	1.39
13	601166	兴业银行	446,000	10,271,380.00	1.19
14	000039	中集集团	750,000	8,925,000.00	1.03
15	002269	美邦服饰	399,914	7,554,375.46	0.88
16	600761	安徽合力	650,000	7,384,000.00	0.86
17	600000	浦发银行	520,000	7,072,000.00	0.82
18	601668	中国建筑	2,000,000	7,020,000.00	0.81
19	601628	中国人寿	280,000	6,916,000.00	0.80
20	600830	香溢融通	650,000	6,441,500.00	0.75
21	600858	银座股份	250,000	6,352,500.00	0.74
22	601398	工商银行	1,500,000	6,090,000.00	0.71
23	000918	嘉凯城	800,000	5,760,000.00	0.67
24	600269	赣粤高速	1,000,000	5,690,000.00	0.66
25	600628	新世界	499,950	5,584,441.50	0.65
26	601699	潞安环能	169,851	5,312,939.28	0.62
27	600240	华业地产	1,000,000	5,280,000.00	0.61
28	600754	锦江股份	300,000	5,178,000.00	0.60

29	600657	信达地产	750,000	4,785,000.00	0.55
30	601989	中国重工	600,000	4,500,000.00	0.52
31	600527	江南高纤	700,000	4,480,000.00	0.52
32	000088	盐田港	700,000	4,368,000.00	0.51
33	600439	瑞贝卡	500,000	4,325,000.00	0.50
34	600185	格力地产	550,000	4,290,000.00	0.50
35	000402	金融街	500,000	4,160,000.00	0.48
36	000926	福星股份	500,000	4,140,000.00	0.48
37	000014	沙河股份	400,000	3,932,000.00	0.46
38	000792	盐湖钾肥	100,000	3,900,000.00	0.45
39	601158	重庆水务	542,534	3,895,394.12	0.45
40	600015	华夏银行	350,000	3,892,000.00	0.45
41	600697	欧亚集团	150,399	3,726,887.22	0.43
42	000983	西山煤电	195,000	3,541,200.00	0.41
43	000937	冀中能源	150,000	3,337,500.00	0.39
44	000069	华侨城 A	300,000	3,300,000.00	0.38
45	000726	鲁泰 A	400,000	3,280,000.00	0.38
46	000157	中联重科	200,000	3,250,000.00	0.38
47	600585	海螺水泥	200,000	3,222,000.00	0.37
48	600028	中国石化	400,000	3,128,000.00	0.36
49	600060	海信电器	250,000	3,012,500.00	0.35
50	600031	三一重工	150,000	2,740,500.00	0.32
51	300090	盛运股份	113,140	2,728,936.80	0.32
52	600837	海通证券	300,000	2,718,000.00	0.32
53	000002	万科 A	400,000	2,712,000.00	0.31
54	601988	中国银行	800,000	2,712,000.00	0.31
55	600004	白云机场	300,000	2,649,000.00	0.31
56	600631	百联股份	200,000	2,630,000.00	0.30
57	600029	南方航空	400,000	2,512,000.00	0.29
58	601006	大秦铁路	300,000	2,451,000.00	0.28
59	600307	酒钢宏兴	300,000	2,409,000.00	0.28
60	600261	浙江阳光	100,000	2,310,000.00	0.27
61	000422	湖北宜化	180,000	2,293,200.00	0.27
62	000527	美的电器	200,000	2,280,000.00	0.26
63	002142	宁波银行	200,000	2,204,000.00	0.26
64	300081	恒信移动	66,666	2,175,978.24	0.25
65	600100	同方股份	100,000	2,104,000.00	0.24
66	000417	合肥百货	145,310	2,092,464.00	0.24
67	002376	新北洋	59,534	2,089,643.40	0.24
68	002380	科远股份	44,823	2,067,684.99	0.24
69	002277	友阿股份	100,000	2,014,000.00	0.23
70	002383	合众思壮	41,124	1,992,457.80	0.23
71	000800	一汽轿车	130,000	1,976,000.00	0.23
72	000548	湖南投资	320,000	1,952,000.00	0.23
73	000401	冀东水泥	130,000	1,938,300.00	0.22
74	002405	四维图新	57,541	1,909,210.38	0.22
75	002378	章源钨业	69,786	1,838,163.24	0.21
76	600383	金地集团	300,000	1,818,000.00	0.21
77	000001	深发展 A	100,000	1,751,000.00	0.20

78	000718	苏宁环球	200,000	1,728,000.00	0.20
79	000910	大亚科技	250,000	1,725,000.00	0.20
80	601866	中海集运	500,000	1,685,000.00	0.20
81	600820	隧道股份	200,000	1,676,000.00	0.19
82	000915	山大华特	170,000	1,635,400.00	0.19
83	000966	长源电力	300,000	1,554,000.00	0.18
84	601111	中国国航	150,000	1,542,000.00	0.18
85	002291	星期六	101,069	1,540,291.56	0.18
86	600690	青岛海尔	80,000	1,528,000.00	0.18
87	600976	武汉健民	120,000	1,518,000.00	0.18
88	002389	南洋科技	24,630	1,359,329.70	0.16
89	600125	铁龙物流	100,000	1,351,000.00	0.16
90	000419	通程控股	150,000	1,326,000.00	0.15
91	002388	新亚制程	42,464	1,312,986.88	0.15
92	300093	金刚玻璃	79,601	1,289,536.20	0.15
93	002104	恒宝股份	80,000	1,220,800.00	0.14
94	600280	南京中商	60,772	1,215,440.00	0.14
95	002400	省广股份	34,438	1,214,283.88	0.14
96	300070	碧水源	12,704	1,184,012.80	0.14
97	600785	新华百货	36,000	1,181,520.00	0.14
98	600019	宝钢股份	200,000	1,178,000.00	0.14
99	002387	黑牛食品	29,968	1,107,617.28	0.13
100	600050	中国联通	200,000	1,066,000.00	0.12
101	002403	爱仕达	65,583	1,059,821.28	0.12
102	002043	兔宝宝	150,000	1,051,500.00	0.12
103	300088	长信科技	36,106	1,025,410.40	0.12
104	601918	国投新集	100,000	1,017,000.00	0.12
105	002386	天原集团	60,174	994,676.22	0.12
106	600479	千金药业	70,000	980,000.00	0.11
107	002385	大北农	29,734	961,002.88	0.11
108	300082	奥克股份	14,099	952,387.45	0.11
109	300074	华平股份	14,971	949,311.11	0.11
110	600791	京能置业	200,000	932,000.00	0.11
111	600266	北京城建	80,000	900,000.00	0.10
112	002397	梦洁家纺	16,052	862,955.52	0.10
113	600265	景谷林业	100,000	841,000.00	0.10
114	002439	启明星辰	22,988	836,993.08	0.10
115	600188	兖州煤业	50,000	821,000.00	0.10
116	002244	滨江集团	100,000	816,000.00	0.09
117	002421	达实智能	24,615	782,510.85	0.09
118	000887	中鼎股份	50,000	762,500.00	0.09
119	002391	长青股份	16,643	755,425.77	0.09
120	000898	鞍钢股份	100,000	718,000.00	0.08
121	000616	亿城股份	165,000	706,200.00	0.08
122	600053	中江地产	100,000	699,000.00	0.08
123	002024	苏宁电器	60,000	684,000.00	0.08
124	000920	南方汇通	100,000	683,000.00	0.08
125	000546	光华控股	50,000	647,000.00	0.08
126	000488	晨鸣纸业	100,000	646,000.00	0.07

127	600104	上海汽车	52,000	638,040.00	0.07
128	000959	首钢股份	200,000	624,000.00	0.07
129	300071	华谊嘉信	19,668	586,499.76	0.07
130	600030	中信证券	50,000	585,000.00	0.07
131	000613	ST 东海 A	100,000	508,000.00	0.06
132	300075	数字政通	10,000	476,500.00	0.06
133	300069	金利华电	16,891	434,605.43	0.05
134	600292	九龙电力	50,000	428,500.00	0.05
135	600570	恒生电子	28,000	420,560.00	0.05
136	600423	柳化股份	50,000	410,500.00	0.05
137	000663	永安林业	50,000	367,000.00	0.04
138	002417	三元达	16,958	364,088.26	0.04
139	002411	九九久	10,175	335,775.00	0.04
140	600876	ST 洛玻	40,000	333,600.00	0.04
141	600331	宏达股份	30,000	309,900.00	0.04
142	000928	中钢吉炭	50,000	307,000.00	0.04
143	002420	毅昌股份	21,035	241,902.50	0.03
144	601369	陕鼓动力	12,170	210,541.00	0.02
145	601000	唐山港	1,000	8,200.00	0.00
146	300094	国联水产	500	7,190.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	34,310,664.85	3.82
2	600016	民生银行	32,787,165.60	3.65
3	601009	南京银行	29,875,657.18	3.33
4	000629	*ST 钒钛	28,440,428.17	3.17
5	600028	中国石化	26,746,057.21	2.98
6	000858	五粮液	26,059,280.35	2.90
7	601601	中国太保	21,654,606.20	2.41
8	601169	北京银行	21,479,521.31	2.39
9	600000	浦发银行	21,088,641.48	2.35
10	601166	兴业银行	20,911,750.54	2.33
11	600036	招商银行	17,222,048.85	1.92
12	601398	工商银行	16,918,929.24	1.88
13	000918	嘉凯城	16,475,453.13	1.83
14	601328	交通银行	16,233,503.58	1.81
15	000039	中集集团	16,094,588.50	1.79
16	000002	万科 A	14,302,866.37	1.59
17	600185	格力地产	13,996,556.06	1.56
18	600861	北京城乡	12,848,810.33	1.43
19	300002	神州泰岳	11,871,000.00	1.32
20	600657	信达地产	11,707,185.92	1.30

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	23,829,205.08	2.65
2	300002	神州泰岳	16,944,625.57	1.89
3	000002	万科A	14,909,522.72	1.66
4	000402	金融街	14,237,175.48	1.59
5	601328	交通银行	13,572,500.42	1.51
6	600015	华夏银行	13,331,512.46	1.48
7	601318	中国平安	13,302,250.95	1.48
8	601009	南京银行	12,731,577.40	1.42
9	600000	浦发银行	12,684,328.08	1.41
10	000915	山大华特	12,541,405.86	1.40
11	601998	中信银行	11,631,107.51	1.29
12	000039	中集集团	11,402,217.40	1.27
13	000088	盐田港	11,351,960.42	1.26
14	600227	赤天化	11,175,725.47	1.24
15	601398	工商银行	10,794,000.00	1.20
16	000826	桑德环境	10,120,537.73	1.13
17	002310	东方园林	10,060,704.60	1.12
18	600269	赣粤高速	9,692,196.73	1.08
19	600830	香溢融通	9,673,637.23	1.08
20	000024	招商地产	8,772,282.43	0.98

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,110,233,591.43
卖出股票的收入（成交）总额	866,899,938.53

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	78,536,000.00	9.11
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	956,784.40	0.11
7	其他	-	-
8	合计	79,492,784.40	9.22

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0901040	09 央行票据 40	800,000	78,536,000.00	9.11
2	113001	中行转债	9,460	956,784.40	0.11

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金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。

7.9.2 本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.9.3 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	923,954.94
2	应收证券清算款	17,820,000.00
3	应收股利	181,904.22
4	应收利息	1,180,800.49
5	应收申购款	22,187,098.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,293,757.90

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	31,830,800.00	3.69	因筹划控股子公司平安银行股份有限公司与深圳发展银行股份有限公司两行整合的重大无先例资产重组事项。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
75,346	19,766.87	198,110,869.26	13.30%	1,291,243,482.70	86.70%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	928,175.71	0.06%

§ 9 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	1,368,856,076.75
本报告期基金总申购份额	205,468,809.54
减：本报告期基金总赎回份额	84,970,534.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,489,354,351.96

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经本公司董事会决议并报中国证券监督管理委员会备案，付勇先生不再担任公司副总经理职务；经本公司董事会决议并经中国证券监督管理委员会核准，王兴宇先生自 2010 年 4 月 20 日起担任本公司副总经理。

本公司已于 2010 年 2 月 12 日、2010 年 4 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站披露了上述高级管理人员变更的相关情况，并在本基金及本公司管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述高级管理人员变更情况。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券股份有限公司	1	590,334,188.66	31.07%	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	497,157,036.70	26.16%	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	413,999,575.63	21.79%	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	398,677,938.68	20.98%	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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 实力雄厚, 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。

(3) 本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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
中信证券股份有限公司	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中国国 际金融 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申银万 国证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国建 银投资 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
国元证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本公司旗下基金净值公告	报纸、网站	2010-01-01
2	本基金招募说明书(更新)摘要(2009年第2号)	报纸、网站	2010-01-08
3	本基金招募说明书(更新)(2009年第2号)	网站	2010-01-08
4	本公司关于旗下基金在广发华福证券开通定期定额投资业务的公告	报纸、网站	2010-01-12
5	本公司关于旗下基金参与邮储银行网上基金申购费率优惠活动的公告	报纸、网站	2010-01-15
6	本基金2009年第4季度报告	报纸、网站	2010-01-20
7	本公司关于高级管理人员离职的公告	报纸、网站	2010-02-12
8	本基金2009年年度报告摘要	报纸、网站	2010-03-27
9	本基金2009年年度报告	网站	2010-03-27
10	本公司关于旗下基金参与东方证券开展的网上、电话、手机委托交易申购费率优惠活动的公告	报纸、网站	2010-04-03

11	本基金2010年第1季度报告	报纸、网站	2010-04-22
12	本公司关于副总经理任职的公告	报纸、网站	2010-04-30
13	本公司关于网上交易平台开通上海浦东发展银行卡定期定额投资业务的公告	报纸、网站	2010-05-20
14	本公司关于网上交易平台开通广东发展银行卡定期定额投资业务的公告	报纸、网站	2010-05-20
15	本公司关于旗下基金开通上海浦东发展银行卡网上交易的公告	报纸、网站	2010-05-20
16	本公司关于旗下基金参与安信证券开展的网上交易申购费率优惠活动的公告	报纸、网站	2010-06-24
17	本公司关于开通400全国统一客服热线的公告	报纸、网站	2010-06-25
18	本公司关于网站新域名上线的公告	报纸、网站	2010-06-25
19	本公司关于旗下基金参与邮储银行开展的网上交易申购费率优惠活动的公告	报纸、网站	2010-06-29
20	本公司关于旗下基金参与交通银行开展的网上交易申购费率优惠活动的公告	报纸、网站	2010-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任本行副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方龙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

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。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

东方基金管理有限责任公司

二〇一〇年八月二十五日