东方龙混合型开放式证券投资基金 2008年年度报告摘要

二零零八年十二月三十一日

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　送出日期:二零零九年三月三十一日

§1 重要提示及目录

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 2009 年 3 月 27 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。

六、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。

七、本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金的基本情况

基金简称	东方龙混合型基金
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
报告期末基金份额总额	1,873,151,808.19 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	根据本基金积极风格管理的特征,本基金选择新华富时风格指数作为业绩比较基准。 东方龙基金业绩比较基准 = 新华富时 A600 成长指数 *30%+ 新华富时 A600 价值指数 *45%+ 新华雷曼中国债券指数 *25% 如果新华富时指数有限公司停止计算编制这些指数或更改指数名称,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。 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。

注:本公司与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商,并经中国证监会同意,已于 2009 年 1 月 18 日起将本基金"业绩比较基准"变更为"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%",并于 2009 年 1 月 14 日在法定信息披露媒体进行了公告。

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
信息披露责任人	姓名	吕日	尹东
	联系电话	010-66295888	010-67595003
	电子邮箱	lvr@orient-fund.com	yindong@ccb.cn
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	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、基金净值表现及收益分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

期间数据和指标	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-831,799,144.09	845,089,308.54	129,681,930.49
本期利润	-1,186,054,850.52	902,293,815.59	150,220,467.31
加权平均基金份额本期利润	0.6304	0.7770	0.8862
本期基金份额净值增长率	-57.21%	107.31%	106.91%
期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.5317	0.0734	0.2670
期末基金资产净值	877,280,408.28	1,668,070,202.84	277,610,935.92
期末基金份额净值	0.4683	1.0945	1.2991

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。

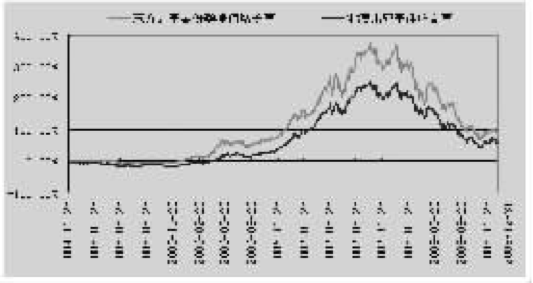
②本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

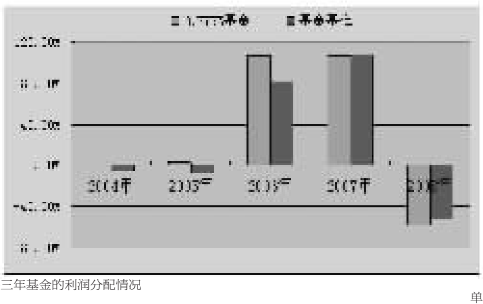
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-11.16%	1.73%	-10.90%	2.25%	-0.26%	-0.52%
过去六个月	-28.81%	1.94%	-24.64%	2.23%	-4.17%	-0.29%
过去一年	-57.21%	2.34%	-52.24%	2.29%	-4.97%	0.05%
过去三年	83.53%	2.04%	80.21%	1.78%	3.32%	0.26%
自基金合同生效起至今	89.46%	1.78%	57.45%	1.61%	32.01%	0.17%

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



3.2.3 自基金合同生效以来净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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
2008年	-	-	-	-	-
2007年	11.815	343,183,349.77	361,402,152.91	704,585,502.68	-
2006年	5.600	56,364,263.73	13,590,066.26	69,954,329.99	-
合计	17.415	399,547,613.50	374,992,219.17	774,539,832.67	-

§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 2008 年 12 月 31 日,本公司管理五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。

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		
于鑫	本基金基金经理	2008-9-20	-	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 年加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方精选基金经理助理,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。
杜位移		2006-3-3	2008-9-20	9年	中国人民银行总行研究生部金融学专业研究生,经济学硕士。历任首钢总公司调研员,大成基金管理有限公司市场副总监、研究副总监,富国基金管理有限公司研究部副经理;2005 年加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部经理、基金管理部经理。
季雷		2007-3-16	2008-9-20	7年	经济学博士、MBA、物理学士。历任上海黄浦机电物资供应公司技术主管,上海宝康电子控制工程有限公司项目经理,东北证券有限责任公司金融与产业研究所投资策划部经理;2005 年加盟公司,曾任本基金基金经理助理,研究部经理、金融工程部经理。

注: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。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

截止本报告期末,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。本基金重点投资对象为经过严格筛选的优势行业中的龙头企业,投资该类公司股票的比例不低于基金股票资产的 50%;东方精选混合型开放式证券投资基金重点投资对象为经过严格筛选的卓越的成长性公司,投资这类公司股票的比例不低于基金股票资产的 60%。由于基金投资风格差别及客观操作水平差异会引起基金净值增长率的正常差异,本基金本报告期净值增长率略低于东方精选混合型开放式证券投资基金净值增长率。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金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

2008 年的 A 股市场,让中国投资者感受到了熊市的严寒。在美国"次贷危机"的影响下,估值高企的 A 股市场没有如投资者所愿继续上涨,而是反复下跌。虽然管理层通过降低印花税、暂停新股发行、鼓励大股东增持等方式来维护市场的稳定,但 A 股市场仍然以大幅度下跌结束了全年的表现。2008 年,上证指数下跌了 65.39%,是中国资本市场成立以来下跌幅度最大的一年。全年来看,除了医药、电力设备等少数行业下跌幅度比较小外,多数行业跌幅都非常巨大。

年初,本基金对今年的行情持谨慎乐观态度,保持了一定的仓位,主要持有大型的国有控股上市公司;下半年,在指数大幅度下跌后,出于对救市政策比较乐观,本基金主要选择了银行、保险、煤炭、钢铁等流动性好、估值较低的行业进行了投资。但总的来看,本基金的投资策略并不成功,在报告期内,本基金的净值出现了较大的损失,虽然我们积极采取了一些补救措施,但仍然未能挽回损失。本基金 2008 年基金净值增长率为 -57.21%,低于业绩比较基准

4.97%,好于同期沪深 300 指数的收益率。2008 年本基金未能准确判断市场走势,行业配置方面也不成功,对此我们向基金持有人表示深深的歉意。

虽然 2008 年市场表现不如人意,但我们对未来市场仍充满希望。本基金 2008 年 9 月新的基金经理自担任基金经理后,一直坚持定期申购本基金,并表示在担任基金经理期间会一直坚持下去。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2009 年可能是中国经济比较困难的一年。拉动中国经济发展的三驾马车"投资、出口、消费"中,投资虽然受到国家 4 万亿投资的支持,但房地产投资、制造业投资面临较大的不确定性;受到国外需求萎缩的影响,出口增速将大幅下降,不排除出现负增长的可能;消费虽然能保持一定的增长,但增速难以维持高位。

我们认为,2009 年的证券市场将是一个震荡市。一方面,在大幅度下跌后,估值不再高企,市场已初步具备了投资价值,市场继续大幅度下跌的动能不足;另一方面,宏观经济的不确定难以支持 A 股市场大幅度走高。在这种情况下,本基金力争通过大类资产配置、时机抉择等方式来实现正的收益。

从行业来看,我们认为保险、银行、地产等行业已具备长期投资价值,值得逢低吸纳,长期持有;食品饮料、医药、公用事业、商业在经济不景气时仍将保持一定的增长,具备较好的防御性能;建材、机械设备、电力设备受益于国家产业政策的支持,也值得我们关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

总经理、副总经理、督察长:参与估值小组的日常工作,主要负责决议基金投资组合中"长期停牌"等没有市价的股票所属行业和重估方法;基金经理:参与估值小组的日常工作,对采纳的估值方法和估值模型等发表意见和建议。交易部:提请估值委员会就相关估值事宜召开会议,并将适用重估方法的股票明细提供给金融工程部;金融工程部:负责制定估值模型、假设及参数、确定参考行业指数并采集行业指数,据其计算估值公允价;登记清算部:负责估值事宜的内外部协调,依据金融工程部提供的公允价格对投资品种进行估值,计算基金资产净值及基金份额净值,并按照监管部门要求作好相关信息披露工作。监察稽核部:对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改。

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

除基金经理外,参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截止本报告期期末,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《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期可不进行利润分配。

§5 托管人报告

一、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。

二、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、利润分配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损害基金份额持有人利益的行为。

三、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

立信会计师事务所为本基金出具了信会师报字[2009]第 80343 号标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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:2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2008年 12 月 31 日	上年度末 2007年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	229,152,799.75	170,962,193.09
结算备付金		216,760.93	4,451,625.10
存出保证金		412,749.05	1,964,069.66
交易性金融资产	7.4.7.2	652,351,968.61	1,481,645,452.60
其中:股票投资		545,670,968.61	1,480,197,964.60
基金投资		-	-
债券投资		106,681,000.00	1,447,488.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	659,403.76
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,029,973.24	57,495.39
应收股利		-	-
应收申购款		67,372.28	19,821,744.02
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		885,231,623.86	1,679,561,983.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年 12 月 31 日	上年度末 2007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		410,691.79	5,606,274.58
应付管理人报酬		1,152,212.49	1,931,374.76
应付托管费		192,035.45	321,895.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.6	359,944.02	2,427,313.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,335,831.87	1,204,922.34
负债合计		7,951,215.58	11,491,780.78
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.8	1,873,151,808.19	1,523,987,683.03
未分配利润	7.4.7.9	-995,871,399.91	144,082,519.81
所有者权益合计		877,280,408.28	1,668,070,202.84
负债和所有者权益总计		885,231,623.86	1,679,561,983.62

注:报告截止日 2008 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.4683 元,基金份额总额 1,873,151,808.19 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:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
一、收入		-1,139,662,923.35	966,328,379.68
1.利息收入		3,476,017.03	2,395,062.28
其中:存款利息收入	7.4.7.10	2,513,697.66	1,907,566.61
债券利息收入		958,683.42	487,495.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,635.95	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-789,414,789.76	902,932,209.11
其中:股票投资收益	7.4.7.11	-798,622,594.50	894,875,181.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	26,888.47	-5,451.21
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	73,456.74	-
股利收益	7.4.7.14	9,107,459.53	8,062,478.88
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.15	-354,255,736.43	57,204,507.05
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	531,585.81	3,796,601.24
二、费用(以"-"号填列)		-46,391,927.17	-64,034,564.09
1.管理人报酬		-19,712,813.75	-21,180,169.87
2.托管费		-3,285,469.05	-3,530,028.38
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.17	-23,185,794.77	-39,096,942.54
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.18	-207,849.60	-227,423.30
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,186,054,850.52	902,293,815.59
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,186,054,850.52	902,293,815.59

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:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 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(以"-"号填列)	-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
项目	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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)	213,688,819.30	63,922,116.62	277,610,935.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	902,293,815.59	902,293,815.59
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)	1,310,298,863.73	-117,547,909.72	1,192,750,954.01
其中:1.基金申购款	3,615,645,988.82	628,007,140.85	4,243,653,129.67
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-2,305,347,125.09	-745,555,050.57	-3,050,902,175.66
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)	-	-704,585,502.68	-704,585,502.68
五、期末所有者权益(基金净值)	1,523,987,683.03	144,082,519.81	1,668,070,202.84

7.4 报表附注

7.4.1 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与最近一期年度报告保持一致,但所采用的会计估计发生了变更。

7.4.1.1 会计估计变更的说明

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,本基金自 2008 年 9 月 16 日起,对证券投资的估值方法进一步明确如下:

(1)对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应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,确定公允价值进行估值;

(2)当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应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,确定投资品种的公允价值进行估值;

因上述估值事项而进行的会计估计变更,本基金采用未来适用法进行核算。此项会计估计变更对本基金 2008 年 9 月 16 日当日净利润和资产净值的影响均减少人民币 9,089,564.00 元;此项会计估计变更对本基金本年度净利润和本年末资产净值的影响均减少人民币 107,995.20 元。

7.4.2 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(自 2004 年 6 月 11 日公司成立至今)、代销机构
中辉国华实业(集团)有限公司	本基金管理人股东(自 2008 年 6 月 12 日至今)
上海城投控股股份有限公司	本基金管理人股东(自 2004 年 6 月 11 日公司成立至今)
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东(自 2008 年 6 月 12 日至今)
四川南方希望实业有限公司	本基金管理人股东(自 2004 年 6 月 11 日公司成立至 2008 年 6 月 11 日)
河北宝硕股份有限公司	本基金管理人股东(自 2004 年 6 月 11 日公司成立至 2008 年 6 月 11 日)
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

注:经本公司股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可(2008)799 号《关于核准东方基金管理有限责任公司股权转让及章程修改的批复》核准,中辉国华实业(集团)有限公司受让四川南方希望实业有限公司所持本公司 18%的股权,河北省国有资产控股运营有限公司受让河北宝硕股份有限公司所持有本公司 18%的股权,本公司于 2008 年 7 月 24 日在法定信息披露媒体和公司网站进行了公告,并办理了工商变更登记手续。

7.4.3 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。

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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	4,713,832,262.00	61.99%	1,596,225,522.68	12.96%

7.4.3.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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%	-	-

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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	1,307,574.39	13.12%	27,651.98	1.14%

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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	19,712,813.75	21,180,169.87
其中:当期已支付	18,560,601.26	19,248,795.11
期末未支付	1,152,212.49	1,931,374.76

注:①在通常情况下,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,具体计算方法为:每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数。

②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。

③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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	3,285,469.05	3,530,028.38
其中:当期已支付	3,093,433.60	3,208,132.59
期末未支付	192,035.45	321,895.79

注:①在通常情况下,基金托管费按前一日的基金资产净值的 2.5‰的年费率计提,具体计算方法为:每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 2.5‰ ÷ 当年天数。

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 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。

③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。

7.4.3.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

2008 年度及 2007 年度,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。

7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

2008 年度及 2007 年度,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.3.2 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 2008年 12 月 31 日		上年度末 2007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
上海城投控股股份有限公司	39,618,000.00	2.12%	39,618,000.00	2.60%

注:上述关联方投资本基金时,按照本基金对外公告的费率标准收取相应的手续费。

7.4.3.4 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 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 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	229,152,799.75	2,419,855.58	170,962,193.09	1,629,714.99

7.4.3.5 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。

7.4.4 期末(2008 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止 2008 年 12 月 31 日,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。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

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	复牌中开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000792	盐湖钾肥	2008-6-26	重大资产重组	56.79	2008-12-26	78.23	449,980.00	38,891,771.40	25,554,364.20

注:①"盐湖钾肥"股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时,连续跌停且成交量极低,故作为流通受限证券列示。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板,当日的收盘价为 37.99 元 / 每股。

②"期末估值单价"是本公司按照中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的

指导意见》的规定,自 2008 年 9 月 16 日起对旗下基金产品所持有的长期停牌股票采用"指数收益法"进行估值调整的估值单价(详见本公司 2008 年 9 月 16 日的相关公告)。上述公允价值估值方法变更对估值方法改变当日损益及基金资产净值影响 -9,809,564.00 元。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截止 2008 年 12 月 31 日,本基金未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5 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	545,670,968.61	61.64
	其中:股票	545,670,968.61	61.64
2	固定收益投资	106,681,000.00	12.05
	其中:债券	106,681,000.00	12.05
	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	229,369,560.68	25.91
6	其他资产	3,510,094.57	0.40
7	合计	885,231,623.86	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	46,228,585.67	5.27
C	制造业	220,571,908.35	25.14
C0	食品、饮料	34,825,952.27	3.97
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	47,658,864.20	5.43
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	90,651,499.24	10.33
C7	机械、设备、仪表	45,758,592.64	5.22
C8	医药、生物制品	1,677,000.00	0.19
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,140,000.00	1.27
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	13,557,640.95	1.55
G	信息技术业	31,843,976.00	3.63
H	批发和零售贸易	3,895,000.00	0.44
I	金融、保险业	112,020,552.64	12.77
J	房地产业	59,720,000.00	6.81
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	46,693,305.00	5.32
	合计	545,670,968.61	62.20

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	000402	金 融 街	7,000,000	53,270,000.00	6.07
2	000629	攀钢钢钒	4,505,000	41,355,900.00	4.71
3	601318	中国平安	1,200,000	31,908,000.00	3.64
4	601398	工商银行	8,000,000	28,320,000.00	3.23
5	600875	东方电气	900,000	26,829,000.00	3.06
6	600858	银座股份	1,610,500	26,428,305.00	3.01
7	000792	盐湖钾肥	449,980	25,554,364.20	2.91
8	000568	泸州老窖	1,307,851	23,802,888.20	2.71
9	600019	宝钢股份	4,999,920	23,199,628.80	2.64
10	600635	大众公用	3,500,000	20,265,000.00	2.31

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,请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 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	600030	中信证券	321,266,720.79	19.26
2	600028	中国石化	199,112,238.90	11.94
3	600050	中国联通	167,598,249.55	10.05
4	600036	招商银行	167,212,935.97	10.02
5	000002	万 科 A	147,829,190.70	8.86
6	600019	宝钢股份	127,981,397.67	7.67
7	600830	香溢融通	101,996,193.11	6.11
8	600499	科达机电	94,075,167.81	5.64
9	600267	海正药业	93,554,425.10	5.61
10	000629	攀钢钢钒	92,609,672.76	5.55
11	600029	南方航空	88,485,745.56	5.30
12	600858	银座股份	85,576,662.46	5.13
13	601088	中国神华	78,172,952.46	4.69
14	000402	金 融 街	76,685,448.80	4.60
15	000063	中兴通讯	70,142,741.87	4.21
16	600354	敦煌种业	69,194,508.70	4.15
17	002052	同洲电子	65,098,065.92	3.90
18	600598	北大荒	62,371,167.41	3.74
19	000878	云南铜业	58,919,614.12	3.53
20	601898	中煤能源	58,548,221.69	3.51
21	600895	张江高科	56,362,092.93	3.38
22	000933	神火股份	54,587,490.03	3.27
23	600839	四川长虹	52,569,030.23	3.15
24	601111	中国国航	51,760,286.09	3.10
25	600795	国电电力	51,227,757.55	3.07
26	601601	中国太保	49,566,659.78	2.97
27	600655	豫园商城	49,433,399.12	2.96
28	601857	中国石油	48,727,456.65	2.92
29	600685	广船国际	47,464,598.25	2.85
30	600438	通威股份	46,758,594.07	2.80
31	600467	好当家	46,108,789.80	2.76
32	000898	鞍钢股份	45,558,429.63	2.73
33	601318	中国平安	45,371,950.56	2.72
34	002001	新 和 成	45,302,314.08	2.72
35	601169	北京银行	44,793,901.38	2.69
36	600141	兴发集团	44,674,539.49	2.68
37	601919	中国远洋	44,459,685.72	2.67
38	601600	中国铝业	40,292,297.01	2.42
39	000792	盐湖钾肥	38,890,199.15	2.33
40	600391	成发科技	38,282,344.21	2.30
41	000581	威孚高科	37,101,077.10	2.22
42	600897	厦门空港	33,387,149.38	2.00

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"买入股票成本"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	600030	中信证券	369,544,182.66	22.15
2	600028	中国石化	190,726,594.13	11.43
3	600050	中国联通	170,198,960.11	10.20
4	600036	招商银行	152,489,752.91	9.14
5	000002	万 科 A	144,193,280.31	8.64
6	600837	海通证券	104,257,025.91	6.25
7	601088	中国神华	87,370,628.01	5.24
8	600019	宝钢股份	84,143,707.87	5.04
9	000748	长城信息	72,698,808.07	4.36
10	600029	南方航空	71,832,723.82	4.31
11	601111	中国国航	71,062,816.43	4.26
12	600267	海正药业	70,549,049.02	4.23
13	600685	广船国际	69,724,182.19	4.18
14	601600	中国铝业	64,029,563.86	3.84
15	601006	大秦铁路	61,983,419.81	3.72
16	601169	北京银行	57,961,543.03	3.47
17	600031	三一重工	54,577,182.44	3.27
18	600111	包钢稀土	54,361,711.27	3.26
19	600499	科达机电	54,186,539.02	3.25
20	600830	香溢融通	54,058,651.70	3.24
21	601898	中煤能源	53,805,843.75	3.23
22	601857	中国石油	53,521,031.92	3.21
23	600354	敦煌种业	51,901,347.83	3.11
24	000878	云南铜业	50,923,673.41	3.05
25	600598	北大荒	50,692,200.92	3.04
26	601919	中国远洋	49,103,607.12	2.94
27	600328	兰太实业	46,613,797.74	2.79
28	000629	攀钢钢钒	46,211,078.25	2.77
29	600839	四川长虹	44,767,158.17	2.68
30	000680	山推股份	42,466,565.73	2.55
31	000651	格力电器	41,354,857.00	2.48
32	000898	鞍钢股份	40,529,661.15	2.43
33	000063	中兴通讯	39,809,397.06	2.39
34	000157	中联重科	39,711,884.35	2.38
35	002001	新 和 成	39,348,374.88	2.36
36	600438	通威股份	39,071,291.54	2.34
37	600005	武钢股份	38,992,290.28	2.34
38	600104	上海汽车	38,617,750.05	2.32
39	600016	民生银行	37,782,712.11	2.27
40	000858	五 粮 液	36,291,944.10	2.18
41	600900	长江电力	35,178,612.81	2.11

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

买入股票成本(成交)总额	3,912,797,129.51
卖出股票收入(成交)总额	3,693,744,456.33

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

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	106,681,000.00	12.16
	其中:政策性金融债	106,681,000.00	12.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	106,681,000.00	12.16

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	0801016	08央行票据 16	500,000	48,235,000.00	5.50
2	0801106	08央行票据 106	300,000	29,433,000.00	3.36
3	0801031	08央行票据 31	300,000	29,013,000.00	3.31

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	412,749.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,029,973.24
5	应收申购款	67,372.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,510,094.57

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

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	000792	盐湖钾肥	25,554,364.20	2.91	见(注)

注:"盐湖钾肥"股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时,连续跌停且成交量极低,故作为流通受限证券列示且于 2008 年 12 月 31 日采用指数收益法对其估值。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板,当日的收盘价为 37.99 元 / 每股。

§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
92,242	20,306.93	46,086,694.40	2.46%	1,827,065,113.79	97.54%

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	937,842.66	0.0501%

§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
报告期期初基金份额总额	1,523,987,683.03
报告期期间基金总申购份额	909,437,169.42
报告期期间基金总赎回份额	560,273,044.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,873,151,808.19

§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,鉴于本公司股东发生变更,根据新股东提案、并经本公司股东会 2008 年 6 月 24 日决议,聘任许建军先生和石运兴先生担任本公司第二届董事会非独立董事。本公司已在本基金及本公司管理的其他基金的招募说明书 - 基金管理人部分及时更新了上述董事情况。

经本公司董事会决议,自 2008 年 9 月 20 日起聘任于鑫先生担任本基金基金经理,杜位移先生与季雷先生不再担任本基金基金经理。本公司于 2008 年 9 月 20 日在《证券时报》及本公司网站披露了《东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理变更公告》。

2008 年 6 月 13 日,中国证券监督管理委员会核准本基金托管行中国建设银行股份有限公司投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

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

根据北京注册会计师协会文件,天华中兴会计师事务所有限公司部分人员、资产于 2008 年 4 月合并至立信会计师事务所有限公司,原天华中兴会计师事务所有限公司部分客户延续至立信会计师事务所有限公司。

鉴于上述原因,经本公司董事会决议,并经基金托管人同意,本基金审计机构由原天华中兴会计师事务所有限公司变更为立信会计师事务所有限公司。上述事项已于 2008 年 8 月 6 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站进行了公告(《东方基金管理有限责任公司关于旗下四只基金审计机构变更的公告》)。本报告期末立信会计师事务所有限公司提供审计服务年限不足 1 年。

本报告期内应支付给立信会计师事务所有限公司的报酬为 8 万元。

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

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		权证交易		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(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
东北证券股份有限公司	2	4,713,832,262.00	61.99			652,709.54	100.00	3,950,501.32	61.69	-
东方证券股份有限公司	1	371,533,961.13	4.89					315,799.35	4.93	-
中国国际金融有限公司	2	109,777,295.94	1.44					89,194.83	1.39	-
中信证券股份有限公司	1	1,759,038,617.39	23.13	1,421,538.00	100.00			1,495,177.09	23.35	-
国信证券股份有限公司	1	73,560,391.09	0.97					62,525.11	0.98	-
申银万国证券股份有限公司	1	576,581,638.29	7.58					490,092.74	7.65	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	
国金证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	
中国银河证券股份有限公司	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)根据业务需要,本报告期新增申银万国证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、长江证券股份有限公司上海交易单元各 1 个;新增中国国际金融有限公司、中国建银投资证券有限责任公司和国金证券有限责任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。

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	本基金招募说明书(更新)摘要(2007 年第 2 号)	指定报刊、网站	2008-01-04
2	本基金招募说明书(更新)(2007 年第 2 号)	网站	2008-01-04
3	关于增加中国民生银行股份有限公司代销本基金的公告	指定报刊、网站	2008-01-08
4	本基金 2007 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2008-01-22
5	本公司新增安信证券股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊、网站	2008-01-29
6	关于兴业银行开通本公司旗下部分开放式基金定期定额申购业务公告	指定报刊、网站	2008-01-29
7	本公司增加招商银行股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊、网站	2008-03-12
8	关于招商银行股份有限公司开通本公司旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2008-03-13
9	本公司增加北京银行股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊、网站	2008-03-27
10	本基金 2007 年年度报告摘要	指定报刊、网站	2008-03-27
11	本基金 2007 年年度报告	网站	2008-03-27
12	本基金 2008 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2008-04-21
13	关于新增中信银行为本公司代销机构的公告	指定报刊、网站	2008-04-25
14	关于北京银行开通本公司旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2008-05-27
15	本公司为地震灾区持有人提供专线服务的公告	指定报刊、网站	2008-05-28
16	本公司旗下基金截止 2008 年 6 月 30 日基金净值公告	指定报刊、网站	2008-07-01
17	本基金招募说明书(更新)摘要(2008 年第 1 号)	指定报刊、网站	2008-07-09
18	本基金招募说明书(更新)(2008 年第 1 号)	网站	2008-07-09
19	本公司关于旗下开放式基金在中国民生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	2008-07-09
20	本公司关于旗下开放式基金在中信建投证券有限责任公司开通定期定额投资业务并参加于 2008 年 7 月 14 日至 2009 年 12 月 31 日定期定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2008-07-09
21	本公司旗下开放式基金延长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	2008-07-11
22	本基金 2008 年第 2 季度报告	指定报刊、网站	2008-07-17
23	本公司关于股权变更的公告	指定报刊、网站	2008-07-24
24	本公司关于旗下四只基金审计机构变更的公告	指定报刊、网站	2008-08-06
25	本基金 2008 年半年度报告	网站	2008-08-25
26	本基金 2008 年半年度报告摘要	指定报刊、网站	2008-08-25
27	本公司关于推出电子对账单服务的公告	指定报刊、网站	2008-08-28
28	本公司关于调整旗下基金所持长期停牌股票估值方法的公告	指定报刊、网站	2008-09-16
29	本公司关于调整所管理的基金持有的长期停牌股票的估值方法的公告	指定报刊、网站	2008-09-16
30	本基金基金经理变更公告	指定报刊、网站	2008-09-20
31	本公司关于旗下基金增加定期定额投资业务渠道的公告	指定报刊、网站	2008-10-08
32	本公司关于股东名称变更的公告	指定报刊、网站	2008-10-22
33	本基金 2008 年第 3 季度报告	指定报刊、网站	2008-10-24
34	关于在广发证券股份有限公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2008-10-27
35	本公司关于开展旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2008-10-27
36	本公司关于旗下基金开通农业银行金穗卡网上交易的公告	指定报刊、网站	2008-11-05
37	本公司关于网上交易平台开通农行金穗卡定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2008-11-05
38	本公司关于旗下开放式证券投资基金增加长江证券股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊、网站	2008-11-10
39	关于中国建设银行网上基金直销业务交易费率调整的公告	指定报刊、网站	2008-12-26
40	关于旗下部分基金参加中国建设银行定投优惠的公告	指定报刊、网站	2008-12-29
41	关于延长旗下开放式证券投资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	2008-12-29
42	本公司旗下基金截止 2008 年 12 月 31 日基金净值公告	指定报刊、网站	2008-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1.2008 年 5 月 27 日,本行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告,美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于 2005 年 6 月 17 日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权;

2.2008 年 9 月 23 日,本行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持本行股份的公告;

3.2008 年 11 月 17 日,本行公告美国银行公司行使认购期权的事宜;

4.2008 年 12 月 2 日,中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

除上述事项,本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

东方基金管理有限责任公司
2009 年 3 月 31 日