

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: 二〇一一年八月二十七日

1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金服务机构在本报告期内不存在虚假记载、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责任。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2011年8月24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。

基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应当阅读半年度报告正文。
本报告中所载资料未审计。
本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金简称, 基金代码, etc.) and Value (东方稳健回报债券, 400009, etc.)

投资目标: 在控制风险和确保资产流动性的前提下,追求较高总回报,力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略: 本基金奉行“积极投资,稳健增值”的投资理念,在保持组合较低波动性的同时,采用稳健的资产配置策略和多种积极增值手段,实现较高的总回报率。

风险收益特征: 本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金、债券型基金中品种,其长期平均风险和预期收益率低于直接参与二级市场股票、权证投资的债券型基金,高于纯债券型基金。

基金管理人及基金托管人: 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

Table with 2 columns: Item (姓名, 联系电话, etc.) and Value (吕日, 010-66295888, etc.)

3 主要财务指标和财务指标
3.1 主要财务指标和财务指标
3.1.1 期间数据和指标

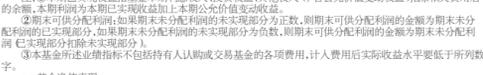
Table with 2 columns: Item (本期已实现收益, 本期利润, etc.) and Value (-4,276,677.66, 1,583,254.61, etc.)

3.1.2 期末数据和指标
3.1.3 基金份额净值增长率
3.1.4 基金份额持有人户数

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

Table with 6 columns: Period (过去一个月, 过去三个月, etc.), Standard Deviation, Beta, etc.

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
东方稳健回报债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2008年12月10日至2011年6月30日)



注:①根据《东方稳健回报债券型证券投资基金合同》的规定,本基金的投资组合比例为:固定收益类资产占可转换债券的比例不低于基金资产的30%,其中,信用类固定收益品种(国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他政府信用债除外)的比例不超过基金资产的50%,可转换债券的比例不超过基金资产的30%,股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。本报告期内,本基金严格执行了《东方稳健回报债券型证券投资基金合同》的相关规定。

②本基金建仓期为6个月,建仓期结束各项资产配置比例符合合同约定。本基金合同生效日为2008年12月10日,截至2011年6月30日,本基金合同生效满三年。
③本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。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金托管人及其托管基金的经验

4.2 基金经理 戚金松 基金经理的简介
4.2.1 基金经理 戚金松 基金经理的简介
4.2.2 基金经理 戚金松 基金经理的简介

4.3 基金管理人内部控制制度的说明
4.3.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.3.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.4 基金管理人内部控制制度的说明
4.4.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.4.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.5 基金管理人内部控制制度的说明
4.5.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.5.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.6 基金管理人内部控制制度的说明
4.6.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.6.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.7 基金管理人内部控制制度的说明
4.7.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.7.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.8 基金管理人内部控制制度的说明
4.8.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.8.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.9 基金管理人内部控制制度的说明
4.9.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.9.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.10 基金管理人内部控制制度的说明
4.10.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.10.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.11 基金管理人内部控制制度的说明
4.11.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.11.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.12 基金管理人内部控制制度的说明
4.12.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.12.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.13 基金管理人内部控制制度的说明
4.13.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.13.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.14 基金管理人内部控制制度的说明
4.14.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.14.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.15 基金管理人内部控制制度的说明
4.15.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.15.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.16 基金管理人内部控制制度的说明
4.16.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.16.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.17 基金管理人内部控制制度的说明
4.17.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.17.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.18 基金管理人内部控制制度的说明
4.18.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.18.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.19 基金管理人内部控制制度的说明
4.19.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.19.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.20 基金管理人内部控制制度的说明
4.20.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.20.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.21 基金管理人内部控制制度的说明
4.21.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.21.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.22 基金管理人内部控制制度的说明
4.22.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.22.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.23 基金管理人内部控制制度的说明
4.23.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.23.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.24 基金管理人内部控制制度的说明
4.24.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.24.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.25 基金管理人内部控制制度的说明
4.25.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.25.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.26 基金管理人内部控制制度的说明
4.26.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.26.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.27 基金管理人内部控制制度的说明
4.27.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.27.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.28 基金管理人内部控制制度的说明
4.28.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.28.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.29 基金管理人内部控制制度的说明
4.29.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.29.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.30 基金管理人内部控制制度的说明
4.30.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.30.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.31 基金管理人内部控制制度的说明
4.31.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.31.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.32 基金管理人内部控制制度的说明
4.32.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.32.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.33 基金管理人内部控制制度的说明
4.33.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.33.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.34 基金管理人内部控制制度的说明
4.34.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.34.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.35 基金管理人内部控制制度的说明
4.35.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.35.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.36 基金管理人内部控制制度的说明
4.36.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.36.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.37 基金管理人内部控制制度的说明
4.37.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.37.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.38 基金管理人内部控制制度的说明
4.38.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.38.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.39 基金管理人内部控制制度的说明
4.39.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.39.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.40 基金管理人内部控制制度的说明
4.40.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.40.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.41 基金管理人内部控制制度的说明
4.41.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.41.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.42 基金管理人内部控制制度的说明
4.42.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.42.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.43 基金管理人内部控制制度的说明
4.43.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.43.2 基金管理人内部控制制度的说明

4.44 基金管理人内部控制制度的说明
4.44.1 基金管理人内部控制制度的说明
4.44.2 基金管理人内部控制制度的说明

东方稳健回报债券型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

会计主体: 东方稳健回报债券型证券投资基金
报告截止日: 2011年6月30日

Table with 2 columns: Item (资产, 负债和所有者权益) and Value (1,642,786,232.55, 1,668,879,201.06, etc.)

6.4.8 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。
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.8.1.1 股票交易

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (成交金额/占当期股票成交总额的比例), Value (168,320,952.53/100.00%)

6.4.8.1.2 权证交易
6.4.8.1.3 债券交易

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (成交金额/占当期债券成交总额的比例), Value (231,401,846.77/100.00%)

6.4.8.1.4 债券回购交易

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (成交金额/占当期债券回购成交总额的比例), Value (14,350,400,000.00/100.00%)

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期佣金/占当期佣金总额的比例), Value (140,396.34/100.00%)

6.4.8.1.6 关联方名称
6.4.8.1.7 当期佣金
6.4.8.1.8 占当期佣金总额的比例

注:①上述数据按市场佣金率计算,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基金后的净额列示。
②关联方佣金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。

6.4.8.2 基金管理人报酬
6.4.8.2.1 基金管理费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (36,949.19/74,613.81)

6.4.8.2.2 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (3,150.35/100.00%)

注:①上述数据按市场佣金率计算,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基金后的净额列示。
②关联方佣金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。

6.4.8.2.3 基金管理人报酬
6.4.8.2.4 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.5 基金管理人报酬
6.4.8.2.6 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (544,657.37/177,081.17)

6.4.8.2.7 基金管理人报酬
6.4.8.2.8 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (614,257.62/219,565.26)

6.4.8.2.9 基金管理人报酬
6.4.8.2.10 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.11 基金管理人报酬
6.4.8.2.12 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.13 基金管理人报酬
6.4.8.2.14 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.15 基金管理人报酬
6.4.8.2.16 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.17 基金管理人报酬
6.4.8.2.18 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.19 基金管理人报酬
6.4.8.2.20 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.21 基金管理人报酬
6.4.8.2.22 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.23 基金管理人报酬
6.4.8.2.24 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.25 基金管理人报酬
6.4.8.2.26 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.27 基金管理人报酬
6.4.8.2.28 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.29 基金管理人报酬
6.4.8.2.30 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.31 基金管理人报酬
6.4.8.2.32 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.33 基金管理人报酬
6.4.8.2.34 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.35 基金管理人报酬
6.4.8.2.36 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.37 基金管理人报酬
6.4.8.2.38 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.39 基金管理人报酬
6.4.8.2.40 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.41 基金管理人报酬
6.4.8.2.42 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.43 基金管理人报酬
6.4.8.2.44 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.45 基金管理人报酬
6.4.8.2.46 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.47 基金管理人报酬
6.4.8.2.48 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.49 基金管理人报酬
6.4.8.2.50 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.51 基金管理人报酬
6.4.8.2.52 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.53 基金管理人报酬
6.4.8.2.54 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.55 基金管理人报酬
6.4.8.2.56 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.57 基金管理人报酬
6.4.8.2.58 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.59 基金管理人报酬
6.4.8.2.60 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.61 基金管理人报酬
6.4.8.2.62 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.63 基金管理人报酬
6.4.8.2.64 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.65 基金管理人报酬
6.4.8.2.66 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.67 基金管理人报酬
6.4.8.2.68 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.69 基金管理人报酬
6.4.8.2.70 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.71 基金管理人报酬
6.4.8.2.72 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.73 基金管理人报酬
6.4.8.2.74 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)

6.4.8.2.75 基金管理人报酬
6.4.8.2.76 基金托管费

Table with 4 columns: Party (关联方名称), Period (2011年1月1日至2011年6月30日), Ratio (当期费用/占当期基金应支付费用总额的比例), Value (1,842,773.00/688,695.88)