东方保本混合型开放式证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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:中国邮政储蓄银行有限责任公司
报告送出日期:2011年8月27日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行有限责任公司根据本基金合同规定,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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年2011年4月14日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方保本混合
基金主代码	400013
交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月14日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行有限责任公司
报告期末基金份额总额	1,440,957,180.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,在保本周期到期时,为保本周期内认购并持有到期的基金份额提供保本金额安全保证的基础上,力求基金资产的稳定增值。
投资策略	在大类资产配置方面,本基金运用CPPI固定比例投资组合保险机制,来动态分配基金资产在收益资产和保本资产上的投资比例。 在保本资产投资方面,以追求本金安全为目的。即通过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本周期的债券等低风险固定收益类证券,并规避利率、再投资等风险,以确保保本资产的稳定收益。 在收益资产投资方面,以追求收益为目的。即采用积极投资方式,把握市场时机、挖掘市场热点,精选个股,获取稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。 本基金为保本混合型基金产品,力争在保本周期到期日保障保本金额的安全。在目前国内金融市场环境下,银行定期存款可以近似理解为保本定息产品。本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准,能够帮助投资者界定本基金的风险收益特征,并反映投资目标。 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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在与托管人协商一致,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,不需要召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。

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	中国邮政储蓄银行有限责任公司
信息披露负责人	姓名	吕日	徐进
	联系电话	010-66295888	010-68858112
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	xujin@postmail.com.cn
客户服务电话		010-66578578 400-628-5888	95580
传真		010-66578700	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com http://www.df5888.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

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(2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日)
本期已实现收益	7,696,426.55
本期利润	-225,795.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0001
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0004
期末基金资产净值	1,440,443,806.40
期末基金份额净值	1.000

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本基金基金合同于2011年4月14日生效,至报告期末不满半年。

④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

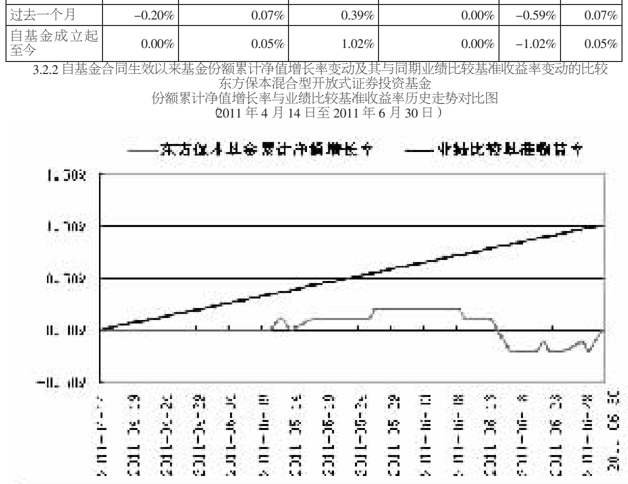
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.20%	0.07%	0.39%	0.00%	-0.59%	0.07%
自基金成立起至今	0.00%	0.05%	1.02%	0.00%	-1.02%	0.05%

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

东方保本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

(2011年4月14日至2011年6月30日)



注:①根据《东方保本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:保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金及到期日不超过1年的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%;收益资产占基金资产的比例不高于40%。其中,保本资产指债券(包括国债、央行票据、企业债、公司债、金融债、短期融资券、资产支持证券及其他法律法规或中国证监会允许投资的债券类金融工具)、货币市场工具;收益资产包括股票、权证等权益类资产。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。

②本基金基金合同于2011年4月14日生效,截止2011年6月30日,本基金基金合同生效不满6个月。

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2011年6月30日,本公司管理七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、东方保本混合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		
张岗(先生)	本基金基金经理、研究部经理、投资决策委员会委员	2011-04-14	-	10年	西北大学经济管理学院经济学博士,10年证券从业经验。历任健桥证券股份公司行业公司部经理,天治基金管理有限公司研究员、天治财富增长混合型证券投资基金基金经理(2006年3月-2007年4月)、投资副总监,投资决策委员会委员,建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、研究部经理、投资决策委员会委员。
杨林耘(女士)	本基金基金经理	2011-04-14	-	18年	北京大学经济学院金融硕士。18年金融、证券从业经历。曾先后在武汉融利期货任首席交易员和高级分析师,在泰康人寿保险资产管理公司任高级项目经理,在中国对外经济贸易信托有限公司任融资业务部总经理助理、交易部总经理助理、证券业务部高级投资经理。2008年11月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方稳健回报债券型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、《东方保本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

本报告期内本公司无与本基金投资风格相类似的投资组合。

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

2011年上半年,中国出现较为明显的高通胀,物价逐月上升,6月份的物价指数CPI同比增长6.4%,出现此轮物价涨幅的新高。而经济增长则出现减速的迹象,整体上经济呈现出高通胀低增长的特征。

上半年政府采取的是紧货币宽财政的政策,央行6次提高法定存款准备金率至21.5%,并于4月初和7月初2次提高存款基准利率。银行间市场资金面极度紧张,这样的宏观和政策环境对股票、债券的投资均为不利。

2011年上半年,债券市场呈现震荡下跌的走势,收益率小回大升,特别是短期债券受资金面和货币市场的影响,收益率上行较大,整体收益率曲线进一步平坦化。

本基金成立于2011年4月14日,基金处于建仓期,本着稳健保本的策略,主要进行了债券资产配置,收益资产方面少量配置了转债资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年4月14日(基金合同生效日)至6月30日,本基金净值增长率为0.00%,业绩比较基准收益率为1.02%,低于业绩比较基准1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年下半年,本基金认为经济减速是大概率事件。企业利润由于资金成本的上升将受到不利影响,其累积效应将在下半年逐渐体现出来。通货膨胀将在高位回落,如果没有新的涨价因素,CPI在四季度的回落将较为明显。

政策面方面,货币政策暂时不会再收紧,财政政策仍然维持宽松。资金面紧张的局面将得到缓解。受此影响,债券市场将逐步启稳。

本基金认为债券市场经过前期的大幅下滑,债券的票息大多已经处于历史的较高区域,下半年的债券市场收益大于风险。首先,纯债资产中较高的票息收入战胜净价下跌的概率较大;其次,可转债资产平均溢价率接近历史低位,部分转债具有纯债价值,可转债有可能成为下半年较好的投资品种,特别是可转债一级市场供应提高,提供了部分无风险套利机会。对于城投债,我们将密切关注个别城投债事件对市场的影响是否会引发信用债的整体系统性风险。基于市场仍然处于底部振荡的概率较大,我们在收益资产投资方面将继续保持稳健的策略,积极关注可能的趋势扭转,待市场情绪出现明显的积极变化之后加大收益资产的投资比例。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承"诚信是基、回报为金"的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

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。

截止本报告期期末,公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定,结合本基金实际运作情况,本基金本报告期末进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本托管人依据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》与《东方保本混合型开放式证券投资基金托管协议》,自2011年4月14日起托管东方保本混合型开放式证券投资基金(以下称"本基金")的全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查的复核,未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,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:东方保本混合型开放式证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年6月30日
资产:	
银行存款	4,953,757.96
结算备付金	12,843,921.32
存出保证金	-
交易性金融资产	1,433,407,934.50
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	1,433,407,934.50
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	66,500,299.75
应收证券清算款	-
应收利息	8,094,157.56
应收股利	-
应收申购款	84,980.25
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,525,885,051.34
负债和所有者权益	本期末 2011年6月30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	74,479,842.76
应付证券清算款	-
应付赎回款	8,323,944.98
应付管理人报酬	1,615,185.43
应付托管费	248,490.04
应付销售服务费	-
应付交易费用	17,353.00
应交税费	-
应付利息	10,319.17
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	746,109.56
负债合计	85,441,244.94
所有者权益:	
实收基金	1,440,957,180.10
未分配利润	-513,373.70
所有者权益合计	1,440,443,806.40
负债和所有者权益总计	1,525,885,051.34

注:①报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额1,440,957,180.10份。

②本基金基金合同于2011年4月14日生效,本报告实际报告期为2011年4月14日至2011年6月30日。

6.2 利润表

会计主体:东方保本混合型开放式证券投资基金

本报告期:2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日
一、收入	5,332,522.29
1.利息收入	11,678,529.32
其中:存款利息收入	601,278.45
债券利息收入	7,535,874.07
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	3,541,376.80
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-569,740.00
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-569,740.00
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-7,922,222.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,145,955.50
减:二、费用	5,558,318.27
1.管理人报酬	4,629,667.13
2.托管费	712,256.45
3.销售服务费	-
4.交易费用	11,647.59
5.利息支出	127,141.24
其中:卖出回购金融资产支出	127,141.24
6.其他费用	77,605.86
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-225,795.98
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-225,795.98

注:本基金基金合同于2011年4月14日生效,本报告实际报告期为2011年4月14日至2011年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方保本混合型开放式证券投资基金

本报告期:2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011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)	1,868,943,721.33	-	1,868,943,721.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-225,795.98	-225,795.98
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)	-427,986,541.23	-287,577.72	-428,274,118.95
其中:1.基金申购款	915,812.22	723.90	916,536.12
2.基金赎回款	-428,902,353.45	-288,301.62	-429,190,655.07
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)	1,440,957,180.10	-513,373.70	1,440,443,806.40

注:本基金基金合同于2011年4月14日生效,本报告实际报告期为2011年4月14日至2011年6月30日。

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

东方保本混合型开放式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]270号核准,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《东方保本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1,868,373,217.98元,业经立信会计师事务所验证。经向中国证监会备案,《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》于2011年4月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,868,943,721.33份基金份额,其中认购资金利息折合570,503.35份基金份额。本基金的基金管理人为东方基金管理有限责任公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会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编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》、《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》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2011年6月30日的财务状况以及2011年4月14日至2011年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本会计期间为2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

1.金融资产的分类

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

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

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

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

2.金融负债的分类

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

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

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

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2)债券投资

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

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3)权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

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

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

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4)分离交易可转债

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

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)买入返售金融资产

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

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

(6)卖出回购金融资产款

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金按以下方式进行估值:

1.股票估值方法

(1)上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况

下,按成本估值。

(3)有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的收盘价估值;非公开发行且处于明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(4)非公开发行有明确锁定期股票按以下方法估值

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该股票的估值价。如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价,应按以下公式确定该股票的价值:

$FV=C+(P-C)\times(Dl-Dr)/Dl$

其中:

FV为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值;

C为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时,应于除权日对其初始取得成本作相应调整);

P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价;

Dl为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数;

Dr为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数(不含估值日当天)。

2.固定收益证券的估值办法

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按有交易的最近交易日所采用的净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(3)未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

(4)在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

(5)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量。

(6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

3.权证估值:

(1)配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权,类同权证处理方式的,采用估值技术进行估值。

(2)认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值;因持有股票而享有的配股权、停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

4.本基金持有的回购以成本列示,按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5.本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。

6.在任何情况下,基金管理人采用上述1-5项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7.国家有最新规定的,按国家最新规定进行估值。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于年末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

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

(2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

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

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

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

(3)公允价值变动损益

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

(4)其他收入

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.30%的年费率逐日计提并确认。

(2)基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提并确认。

(3)卖出回购金融资产利息支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提并确认。

(4)交易费用

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

(5)其他费用

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式:

①保本周期内:采用现金分红方式进行收益分配,一般不接受红利再投资方式,但基金管理人可以根据有关规定更改本基金的分红方式;

②转型后:基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;

(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

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 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
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
中国邮政储蓄银行有限责任公司	本基金托管人、代销机构

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

本基金本期2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日,未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本期2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日,未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券股份有限公司	130,159,892.24	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券股份有限公司	10,115,261,000.00	100.00%

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本期2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日,无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,629,667.13
其中:支付销售机构的客户维护费	1,717,261.49

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.3%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

保本周期内,保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	712,256.45

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的2‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2‰÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 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2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日,本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 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 2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行有限责任公司	4,953,757.96	70,185.83

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期2011年4月14日(基金合同生效日)至2011年6月30日,本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 受限证券类别:债券										
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
122078	11东阳光	2011-06-17	2011-07-19	认购新发债券	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-
122080	11康美债	2011-06-23	2011-07-05	认购新发债券	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-
112029	11软控债	2011-06-09	2011-07-25	认购新发债券	100.00	100.00	600,000	60,000,000.00	60,000,000.00	-
1120005	11成都银行债	2011-06-02	2011-08-09	认购新发债券	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-

6.4.9.2 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股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
090205	09国开05	2011-07-01	100.68	760,000	76,516,800.00
合计		-	-	760,000	76,516,800.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日,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。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,433,407,934.50	93.94
	其中:债券	1,433,407,934.50	93.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	66,500,299.75	4.36
	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	17,797,679.28	1.17
6	其他各项资产	8,179,137.81	0.54
7	合计	1,525,885,051.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本报告期内本基金未投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本报告期内本基金未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本报告期内本基金未投资股票。

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	22,008,840.00	1.53
2	央行票据	129,155,000.00	8.97
3	金融债券	419,374,000.00	29.11
	其中:政策性金融债	389,374,000.00	27.03
4	企业债券	517,465,500.00	35.92
5	企业短期融资券	288,916,000.00	20.06
6	中期票据	-	-
7	可转债	56,488,594.50	3.92
8	其他	-	-
9	合计	1,433,407,934.50	99.51

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	090205	09国开05	3,200,000	322,176,000.00	22.37
2	1180114	11焦作建投债	700,000	70,021,000.00	4.86
3	1101029	11央行票据29	700,000	69,461,000.00	4.82
4	112029	11软控债	600,000	60,000,000.00	4.17
5	122074	11士兰微	600,000	59,760,000.00	4.15

7.7 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 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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 本报告期内本基金未投资股票。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,094,157.56
5	应收申购款	84,980.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,179,137.81

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
80,720	17,851.30	55,120,392.08	3.83%	1,385,836,788.02	96.17%

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	1,981.32	0.00%

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年4月14日)基金份额总额	1,868,943,721.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	915,812.22
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	428,902,353.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,440,957,180.10

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

本基金管理人于2011年3月1日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》,经公司董事会决议,聘任杨树财先生担任本公司董事长,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2011]292号);本基金管理人于2011年3月10日发布了《东方基金管理有限责任公司变更法定代表人的公告》,经北京市工商行政管理局核准,本公司法定代表人变更为杨树财先生;经本公司2011年7月8日第二次临时股东会决议,聘任田瑞璋先生担任公司第三届董事会独立董事,矫艾辛女士不再担任本公司独立董事。上述董事变更事项,本公司已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

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公司法定代表人、高级管理人员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公司法定代表人、高级管理人员、董事变更情况。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
东北证券股份有限公司	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。

(3)本报告期内,本基金新增东北证券股份有限公司交易单元2个。

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
东北证券股份有限公司	130,159,892.24	100.00%	10,115,261,000.00	100.00%	-	-

注:本公司于2011年7月14日通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露了《东方基金管理有限责任公司住所变更公告》,本公司住所变更为北京市西城区锦什坊街28号1至4层。

东方基金管理有限责任公司
2011年8月27日