东方龙混合型开放式证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年 9 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:2011 年 10 月 26 日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方龙混合
基金主代码	400001
交易代码	400001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年 11 月 25 日
报告期末基金份额总额	1,357,265,578.85 份
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、稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股《包括债券》选择组成。本基金将资产配置、基金风格管理和个股选择都建立在全面、深入而有效的研究的基础上。研究贯穿于基金投资管理的每一个环节。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是中信标普 300 风格指数,具体包括中信标普 300 成长指数和中信标普 300 价值指数,本基金债券部分的业绩比较基准为中信标普全债指数。 本基金整体业绩比较基准=中信标普 300 成长指数*30% +
风险收益特征	中信标普 300 价值指数*45% +中信标普全债指数*25%。 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。 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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011 年 7 月 1 日-2011 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-7,474,047.26
2.本期利润	-91,388,311.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0694
4.期末基金资产净值	842,398,604.79
5.期末基金份额净值	0.6207

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

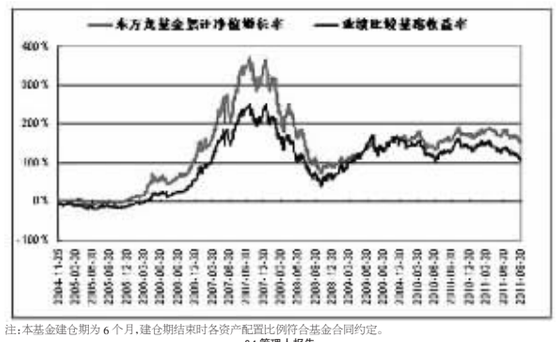
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.98%	0.97%	-11.91%	1.00%	1.93%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 2011 年 9 月 30 日)



注:本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时各资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	
		任职日期	离任日期		
于鑫(先生)	本基金基金经理、基金管理部经理、投资决策委员会委员	2008-9-20	-	10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 2010 年 9 月 15 日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。现任基金管理部经理、投资决策委员会委员。

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 公平交易专项说明

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")。

2011 年 3 季度,本基金净值增长率为-9.98%,东方精选基金净值增长率为-5.55%,本基金低于东方精选基金 4.43%。现将业绩差异的原因说明如下:

1.本基金仓位较东方精选基金高,本季度对市场具有代表意义的沪深 300 指数收益率为 -15.20%;

2.本基金持有较多的金融服务、钢铁和地产行业的上市公司,这三个行业在本季度表现一般,对基金净值造成一定损失;东方精选基金持有较多的食品饮料行业的上市公司,该行业本季度表现出色。

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 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 3 季度,本基金继续关注业绩优良、增长明确的绩优公司,波段操作,适当调整持仓结构。

报告期内,本基金根据对市场的判断,继续坚定持有业绩优良、增长明确的绩优公司。7 月下旬,本基金从审慎的角度出发,适当降低了仓位,主要减持了黑色金属、房地产等弹性较大的行业;9 月上旬开始,本基金开始加仓,主要增持了交通运输等业绩预期较好、增长确定的行业,对通信、保险等安全边际较高的行业也进行了增持,股票仓位有了一定的提升。

总的来说,报告期内,本基金在波段选择上均取得了一定的效果,行业选择一般。由于报告期内市场大幅下跌,本基金的净值也出现了一定程度的下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年 7 月 1 日至 9 月 30 日,本基金净值增长率为-9.98%,业绩比较基准收益率为-11.91%,高于业绩比较基准 1.93%。

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 4 季度,我们认为中国经济仍将保持较好的发展,但增速略有下滑。通胀压力有望得到缓解,融资平台债务问题将进一步明朗,从紧的经济政策可能出现微调。海外看,欧债危机能够缓解,美国和新兴经济体的经济将重新步入增长的轨道。

鉴于市场跌幅较大,以及对调控放松的期待,欧债危机的缓解,市场可能走出反弹行情。但资金面和信心面可能制约反弹的高度。

从行业层面上,金融服务、交通运输等低估值品种能有不错的表现,防御类行业能够有绝对收益,资源类和农业类公司可能面临压力。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	652,530,313.93	76.77
	其中:股票	652,530,313.93	76.77
2	固定收益投资	137,276,400.00	16.15
	其中:债券	137,276,400.00	16.15
	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	40,957,166.65	4.82
6	其他各项资产	19,186,545.25	2.26
7	合计	849,950,425.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,665,000.00	0.55
B	采掘业	33,772,710.52	4.01
C	制造业	108,089,480.83	12.83
C0	食品、饮料	16,708,500.00	1.98
C1	纺织、服装、皮毛	832,500.00	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,785,800.00	2.23
C5	电子	6,499,000.00	0.77
C6	金属、非金属	39,943,900.00	4.74
C7	机械、设备、仪表	18,886,480.83	2.24
C8	医药、生物制品	6,433,300.00	0.76
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	840,000.00	0.10
E	建筑业	17,212,338.66	2.04
F	交通运输、仓储业	41,559,306.79	4.93
G	信息技术业	23,397,610.78	2.78
H	批发和零售贸易	37,279,092.18	4.43
I	金融、保险业	339,986,701.79	40.36
J	房地产业	41,535,274.20	4.93
K	社会服务业	1,376,750.00	0.16
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,816,048.18	0.33
	合计	652,530,313.93	77.46

5.3 报告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

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	28,000,000	68,880,000.00	8.18
2	600036	招商银行	4,699,997	51,981,966.82	6.17
3	601318	中国平安	1,170,000	39,276,900.00	4.66
4	601601	中国太保	1,889,553	34,937,834.97	4.15
5	600016	民生银行	5,500,000	30,360,000.00	3.60
6	601009	南京银行	3,280,000	26,633,600.00	3.16
7	600000	浦发银行	2,900,000	24,766,000.00	2.94
8	601006	大秦铁路	2,696,879	19,336,622.43	2.30
9	000002	万 科 A	2,549,955	18,461,674.20	2.19
10	601166	兴业银行	1,400,000	17,346,000.00	2.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	36,456,200.00	4.33
	其中:政策性金融债	36,456,200.00	4.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	82,467,400.00	9.79
6	中期票据	-	-
7	可转债	18,352,800.00	2.18
8	其他	-	-
9	合计	137,276,400.00	16.30

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1081352	10岱海 CP01	460,000	46,262,200.00	5.49
2	100311	10进出 11	365,000	36,456,200.00	4.33
3	1081356	10一拖 CP01	200,000	20,114,000.00	2.39
4	113002	工行转债	180,000	18,352,800.00	2.18
5	1081348	10邮科院 CP01	160,000	16,091,200.00	1.91

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	890,741.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,182,613.06
5	应收申购款	15,113,191.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,186,545.25

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	18,352,800.00	2.18

5.8.5 报告期末前十名股票中在在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,267,271,552.13
本报告期基金总申购份额	119,703,933.79
减:本报告期基金总赎回份额	29,709,907.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,357,265,578.85

§7 备查文件目录

7.1 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、基金份额净值及其临时公告

7.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

7.3 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
2011 年 10 月 26 日

东方策略成长股票型开放式证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年 9 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:2011 年 10 月 26 日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方策略成长股票	
基金主代码	400007	
交易代码	400007(前端)	400008(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年 6 月 3 日	
报告期末基金份额总额	72,250,369.36 份	
投资目标	本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司,分享国民经济快速发展带来的成长性收益,追求管理资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金通过分析宏观经济发展战略,确定基金重点投资的行业,自上而下配置资产,自下而上精选证券。 本基金从重点投资的行业中寻找成长性公司,通过成长风险值控制成长风险,以合理的价格投资于优秀公司和或相对价值低估的其他公司;通过组合投资有效分散风险,谋求基金资产长期稳定的增长。	
业绩比较基准	本基金的股票业绩比较基准是中信标普 300 指数;债券业绩比较基准是中信标普全债指数。 本基金的业绩比较基准为: 中信标普 300 指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30% 随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适合本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。	
风险收益特征	本基金属于成长型股票基金,为证券投资基金中的高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
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	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011 年 7 月 1 日-2011 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-270,054.93
2.本期利润	-9,355,315.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1417
4.期末基金资产净值	93,501,791.28
5.期末基金份额净值	1.2941

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

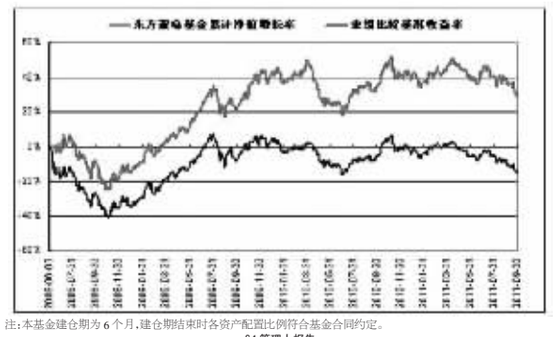
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.67%	0.98%	-11.07%	0.92%	1.40%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

东方策略成长股票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

(2008 年 6 月 3 日至 2011 年 9 月 30 日)



注:本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时各资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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、基金管理部经理、投资决策委员会委员	2008-6-3	-	10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,曾任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理,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;2006 年 8 月 2 日至 2006 年 12 月 29 日、2007 年 8 月 14 日至 2010 年 9 月 15 日担任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理;2008 年 9 月 20 日至今担任东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理。现任基金管理部经理、投资决策委员会委员。

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、《东方策略成长股票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 公平交易专项说明

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,本公司管理的股票型开放式证券投资基金共有两只:东方策略股票型开放式证券投资基金(本基金)和东方核心动力股票型开放式证券投资基金(以下简称"东方核心动力基金")。

2011 年 3 季度,本基金净值增长率为-9.67%,东方核心动力基金净值增长率为-12.65%,本基金净值增长率高于东方核心动力基金 2.98%。业绩差异的主要原因为:行业配置方面,两只基金在金融服务行业的配置比例存在较大差异,本基金的配置比例较高,东方核心动力基金配置偏低。

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 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 3 季度,本基金继续持有业绩优良、增长明确的绩优公司,适当调整持仓结构,均衡配置,降低行业的集中度。

报告期内,本基金根据对市场的判断,继续坚定持有业绩优良、增长明确的绩优公司。对于一些业绩达不到预期的公司,进行了减持,并降低了与投资相关行业的比重,同时卖出了一些弹性较大的中小市值股票;9 月上旬开始,本基金开始加仓,买入了交通运输、通信、保险等行业的公司。出于提高资金使用效率的目的,本基金还买入了一定数量的短期融资券。

总的来说,报告期内,本基金在波段选择上均取得了一定的效果,风格及行业选择尚可。由于报告期内市场大幅下跌,本基金的净值也出现了一定程度的下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年 7 月 1 日至 9 月 30 日,本基金净值增长率为-9.67%,业绩比较基准收益率为-11.07%,高于业绩比较基准 1.40%。

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 4 季度,我们对中国经济仍充满信心。消费仍将保持较高的增速,出口和投资增速略有下滑,但不会出现所谓的硬着陆。调控效果逐步显现,通胀压力有望得到缓解,房价平稳下滑,从紧的经济政策可能出现微调。

目前市场估值较低,政策面可能趋好,信心面也会逐渐修复。对未来一个季度的行情可以预期。但资金面和信心面可能制约反弹的高度。

4 季度,自上而下,我们看好金融服务、交通运输、通信等行业的机会,自下而上,我们看好前期股东增持、明年业务扩张明确的公司。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	74,128,209.95	77.91
	其中:股票	74,128,209.95	77.91
2	固定收益投资	13,478,640.00	14.17
	其中:债券	13,478,640.00	14.17
	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	6,609,264.17	6.95
6	其他各项资产	924,214.48	0.97
7	合计	95,140,328.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	466,500.00	0.50
B	采掘业	4,555,650.00	4.87
C	制造业	13,187,725.00	14.10
C0	食品、饮料	2,331,960.00	2.49
C1	纺织、服装、皮毛	92,500.00	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,507,780.00	2.68
C5	电子	865,050.00	0.93
C6	金属、非金属	4,331,060.00	4.63
C7	机械、设备、仪表	2,253,665.00	2.41
C8	医药、生物制品	805,710.00	0.86
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	84,000.00	0.09
E	建筑业	1,475,007.81	1.58
F	交通运输、仓储业	4,812,397.14	5.15
G	信息技术业	3,538,820.00	3.78
H	批发和零售贸易	3,741,470.00	4.00
I	金融、保险业	35,800,420.00	38.29
J	房地产业	6,031,810.00	6.45
K	社会服务业	197,930.00	0.21
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	236,480.00	0.25
	合计	74,128,209.95	79.28

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	3,050,000	7,503,000.00	8.02
2	600036	招商银行	430,000	4,755,800.00	5.09
3	601601	中国太保	220,000	4,067,800.00	4.35
4	601318	中国平安	120,000	4,028,400.00	4.31
5	000002	万 科 A	471,000	3,410,040.00	3.65
6	600016	民生银行	550,000	3,036,000.00	3.25
7	601009	南京银行	351,000	2,850,120.00	3.05
8	600000	浦发银行	285,000	2,433,900.00	2.60
9	601006	大秦铁路	300,000	2,151,000.00	2.30
10	600030	中信证券	170,000	1,912,500.00	2.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,495,800.00	3.74
	其中:政策性金融债	3,495,800.00	3.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	8,045,600.00	8.60
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,937,240.00	2.07
8	其他	-	-
9	合计	13,478,640.00	14.42

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1081348	10邮科院 CP01	40,000	4,022,800.00	4.30
2	1081352	10岱海 CP01	40,000	4,022,800.00	4.30
3	100311	10进出 11	35,000	3,495,800.00	3.74
4	113002	工行转债	19,000	1,937,240.00	2.07
5	-	-	-	-	-

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	308,802.21
5	应收申购款	115,412.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	924,214.48

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	1,937,240.00	2.07

5.8.5 报告期末前十名股票中在在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	64,203,300.24
本报告期基金总申购份额	13,990,243.05
减:本报告期基金总赎回份额	5,943,173.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	72,250,369.36

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

一、《东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方策略成长股票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、基金份额净值及其临时公告

7.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

7.3 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
2011 年 10 月 26 日

东方金账簿货币市场证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年 9 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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2011 年 10 月 26 日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方金账簿货币
基金主代码	400005
交易代码	400005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年 8 月 2 日
报告期末基金份额总额	290,137,407.89 份
投资目标	在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金以价值分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,把握宏观经济走向与微观经济脉搏,通过以剩余期限为核心的资产配置,充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行税后活期利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011 年 7 月 1 日-2011 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,163,494.37
2.本期利润	4,163,494.37
3.期末基金资产净值	290,137,407.89

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 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。

③本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

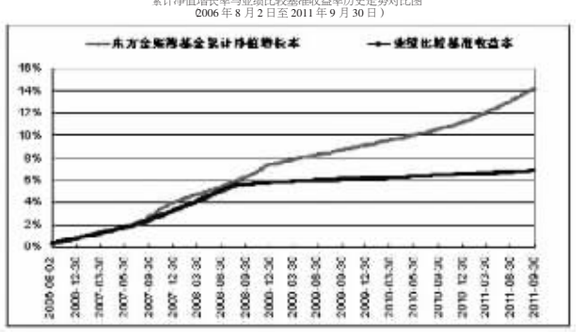
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0180%	0.0019%	0.1260%	0.0000%	0.8920%	0.0019%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方金账簿货币市场证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006 年 8 月 2 日至 2011 年 9 月 30 日)



注:本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时各资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说