

# 东方龙混合型开放式证券投资基金 招募说明书（更新）摘要 （2012年第1号）

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

日期：二〇一二年七月

## 重要提示

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《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，进行募集。本基金基金合同于2004年11月25日正式生效。本基金为混合型开放式。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所载内容截止日为2012年5月25日。

本摘要根据本基金合同和本基金《招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金合同。

## 一、基金合同生效日期

2004年11月25日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人：崔伟

总经理：崔伟（代）

成立日期：2004年6月11日

注册资本：壹亿元人民币

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80号

基金管理公司法人许可证编号：A039

企业法人营业执照注册号：110000007042263

联系人：吕日

电话：010-66295888

股权结构：

持股单位	出资金额（人民币）	占总股本比例
东北证券股份有限公司	4600万元	46%
中辉国华实业（集团）有限公司	1800万元	18%
渤海国际信托有限公司	1800万元	18%
河北省国有资产控股运营有限公司	1800万元	18%
合计	10,000万元	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会两个专门委员会；本公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会和董事会办公室、综合管理部、人力

资源部、监察稽核部、财务部、信息技术部、登记清算部、研究部、基金管理部、交易部、专户管理部、金融工程部、国际业务部、营销策划部、渠道销售部、机构理财部十六个职能部门及上海分公司；本公司设督察长，分管监察稽核部，负责组织指导公司的监察稽核工作。

## （二）基金管理人主要人员情况

### 1. 董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人；现任吉林大学商学院教师，东北证券股份有限公司董事。

杨树财先生，董事，硕士研究生，中国注册会计师，高级会计师。吉林省高级职称评委会委员，中国证券业协会财务会计委员会执行委员。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师，吉林会计师事务所副所长，东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监，东方基金管理有限责任公司董事长；现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长。

齐伟丽女士，董事，会计师。历任中国计算机软件与技术服务总公司工程师，中软总公司多维公司会计师，北京宏世通达商贸集团财务部长，中辉投资有限公司财务总监，新疆中建投资有限责任公司总经理，中天高科特种车辆有限公司副总经理，北京中辉阳光房地产开发有限公司董事；现任北京京发置业有限公司监事，北京宏世通达商贸集团副总经理。

彭铭巧女士，董事，经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司深圳营业部交易员、研究员，特区时空杂志社编辑，国泰君安证券公司海口营业部研究员，海航集团有限公司证券业务部研究室经理，海航集团财务有限公司投资银行部理财主管；现任渤海国际信托有限公司投资部总经理。

邱建武先生，董事，高级工程师。历任廊坊市轴瓦厂团支部书记，河北省粮油工业公司总经理、党支部书记，河北省粮油集团公司副总裁、党委常委，河北省粮食局副局长、党组成员，河北省商贸集团公司党委书记、董事长，河北省工贸资产经营有限公司党委书记、董事长、总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司董事长，河北省商贸有限公司董事长，河北省机械工业供销协会名誉理事长，河北省商业会计学会名誉会长。

田瑞璋先生，独立董事，大学本科。历任中国北方工业（集团）总公司副总经理，中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员（副部级），中国工商银行党委副书记、副

行长、中央金融工委委员（副部级），工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长；现任中国扶贫开发协会常务副会长（中组部任命、副部级）、中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。。

金硕先生，独立董事，教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授，长春税务学院党委书记、院长，长春市政协委员，吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任；现任吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士，独立董事，经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长；现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事。

## 2. 监事会成员

何俊岩先生，监事会主席，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任东北证券股份有限公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券股份有限公司财务总监，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司副总裁，吉林省总会计师协会副会长，吉林省证券业协会副会长，东证融通投资管理有限公司董事。

田文艳女士，监事，本科，会计师。历任北京市丰台区石油销售有限公司会计，北京中天高科特种车辆有限公司主管会计，北京中天行房车俱乐部有限公司主管会计，蓝色港湾有限公司财务部经理；现任中辉国华实业（集团）有限公司财务总监助理。

杨晓燕女士，监事，哲学硕士，金融学研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，18年金融、证券从业经历；现任本公司监察稽核部经理。

## 3. 其他高级管理人员

崔伟先生，总经理（代），简历请参见董事介绍。

王兴宇先生，副总经理，美国宾西法尼亚印第安那大学工商管理硕士、美国依阿华大学法律学硕士；具有7年基金从业经历和5年保险从业经历，曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部经理、董事会秘书，先后任职于博时基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、益民基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司。

吕日先生，督察长，吉林大学经济学院政治经济学专业博士研究生，高级经济师。曾担任吉林省证券公司长春北国之春营业部副经理、延吉证券营业部副经理、营业机构管理部经

理；东北证券股份有限公司总裁助理兼营销交易管理总部总经理。2008年11月加盟本公司。

#### 4. 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
于鑫（先生）	2008年9月20日 至今	清华大学MBA，CFA；11年证券从业经历，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，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。
季雷（先生）	2007年3月16日至2008年9月20日任本基金基金经理	
杜位移（先生）	2006年3月3日至2008年9月20日任本基金基金经理	
宋炳山（先生）	2004年11月25日至2006年3月3日任本基金基金经理	
陈光明（先生）	2004年11月25日至2005年3月27日任本基金基金经理	

#### 5. 投资决策委员会成员

崔伟先生：总经理（代），投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍。

庞飒先生：总经理助理兼投资总监，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会副主任委员。浙江大学生命科学院理学硕士学历，12年证券从业经验，曾担任申银万国证券研究所行业分析师，富国基金行业分析师，汇添富基金管理有限公司投资决策委员会委员、基金投资部副总监、高级研究员、研究主管、基金经理。2010年5月加盟本公司。

张岗先生：西北大学经济学博士，11年证券从业经历。历任健桥证券股份公司行业公司部经理，天治基金管理公司研究员、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，建信基金管理公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟本公司，现任东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经

理，东方保本混合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。

于鑫先生：东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理，本基金基金经理，基金管理部经理，投资决策委员会委员。简历请参见本基金基金经理介绍。

李骥先生：首席策略分析师，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。北京大学经济学博士，11年证券从业经历，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟本公司，曾任研究部经理。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### （一）基金托管人情况

##### 1. 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总

数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2011年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2. 主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。



纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3. 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

##### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2. 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

##### 3. 内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业

务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2. 监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 四、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1. 直销机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

联系人：史鹏浩

电话：010-66295921

传真：010-66578690

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

## 2. 代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

联系人：王琳

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王隽

电话：010-66107900

传真：010-66108013

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(3) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

联系人：宋亚萍

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(4) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(5) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-58351666

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：陈春林

传真：010-68858117

客户服务电话：95580

网址：www.psbc.com

(7) 北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：谢小华

电话：010-66223587

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(8) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：宋晓明

电话：010-65541585

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(9) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号兴业大厦9楼

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021-52629999

传真：021-62569070

客户服务电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(10) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：陈丽

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.95559.com.cn

(11) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

(12) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：李洋

电话：010-66568888

传真：010-66568536

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(13) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市面上深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京朝阳区亮马桥路 48 号

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833799

网址：www.ecitic.com

(14) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

(15) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-23219100

客户服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

(16) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(17) 山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(18) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号3楼

法定代表人：徐浩明

联系人：李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：10108998

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(19) 东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼

办公地址：上海市浦东新区东坊路989号中达广场13楼

法定代表人：朱科敏

联系人：霍小菲

电话：021-50586660

传真：021-50585607

客户服务电话：400-888-8588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(20) 国泰君安证券股份有限公司



住所：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676767

传真：021-38670767

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(21) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：刘军

联系人：丁思聪

电话：0571-85112510

传真：0571-85783771

客户服务电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

(22) 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 178 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 178 号

法定代表人：凤良志

联系人：祝丽萍

电话：0551-2257012

传真：0551-2272100

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

(23) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

(24) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务电话：021-962506 或 40088-88506

网址：www.dfzq.com.cn

(25) 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41、42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(26) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95577

网址：www.htsc.com.cn

(27) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-68419974

客户服务电话：4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

(28) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

(29) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(30)长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(31)招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄健

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(32)齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(33) 江海证券经纪有限责任公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(34) 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(35) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

网址：www.hfzq.com.cn

(36) 五矿证券有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：高竹

联系人：高克南

电话：0755-82545707

传真：0755-82545500

客户服务电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

(37)恒泰长财证券有限公司

住所：长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

办公地址：长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

法定代表人：赵培武

联系人：曲志诚

电话：0431-82945299

传真：0431-82946531

网址：www.cczq.net

(38)东莞证券有限责任公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：苏卓仁

电话：0769-22112062

客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

网址：www.dgzq.com.cn

## （二）注册登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

联系人：王广辉

电话：010-66295871

传真：010-66578680

网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层

办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军 李晓明

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所有限公司

住所：上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层

办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层

法定代表人：朱建弟

联系人：朱锦梅

电话：010-68286868

传真：010-88210608

经办注册会计师：朱锦梅、魏星

## 五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方龙混合型开放式证券投资基金

（二）本基金类型：混合型

基金运作方式：契约型开放式

## 六、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标

分享中国经济和资本市场的高速增长，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

## （二）投资方向

本基金的投资方向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、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金的重点投资对象为经过严格筛选的优势行业中的龙头企业。本基金投资这类公司股票的比例将不低于基金股票资产的50%。

## 七、基金的投资策略

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。

### 1. 决策依据及投资程序

(1) 研究部和基金管理部通过自身的研究力量，并借助外部的研究机构，对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论形成本基金的资产配置比例指导意见；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括风格管理和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，金融工程部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程做出调整。

### 2. 投资管理的方法和标准

#### (1) 资产配置

本基金各类资产的投资比例范围根据本基金的投资理念和投资方针决定：股票资产的投资比例范围为0—95%，债券资产的投资比例范围为0—95%，而货币市场工具的投资比例范围为5—100%，其中保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债



券。实际管理中，本基金将通过战略性资产配置和战术性资产配置来确定投资组合中股票、债券和货币市场工具间的投资比例。

#### (2) 积极风格管理

结合对市场时机的分析和把握，进行积极的风格管理，主动调整股票资产中成长型股票和价值型股票的投资比例。

#### (3) 个股选择

在具体的个股选择上，本基金管理人建立了一套多层次的股票筛选体系。通过定量模型和定性分析的有机结合，充分发挥金融工程模型的客观科学性和投资研究人员的主观能动性，筛选出具有投资价值的个股。

本基金通过“股票初选”、“质量检验”、“精选龙头”和“行业优化”四个层次的股票筛选体系，层层筛选，得到最具投资价值的个股构成本基金核心股票池。

#### (4) 债券投资策略

本基金以“理想久期”作为债券组合配置的核心，通过期限结构配置、确定类属配置、浮息债和固息债的配置、一级市场和二级市场的配置、个债选择、组合调整等策略进行债券投资。

#### (5) 权证投资策略

基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下，本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于权证。根据股票、债券等资产类别的配置计划，为提高投资效率或避险，本基金可投资于权证，权证投资比例范围为0%~3%。

## 八、基金的业绩比较基准

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% + 中信标普300价值指数\*45% + 中信标普全债指数\*25%。

如果中信标普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。

## 九、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的中低风险品种，其风险收益特征介于单纯的股票型基金与单纯的债券型基金之间，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。

## 十、基金投资组合报告

本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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2012年3月31日（财务数据未经审计）。

### 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	758,031,357.35	67.08
	其中：股票	758,031,357.35	67.08
2	固定收益投资	150,538,400.00	13.32
	其中：债券	150,538,400.00	13.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	140,000,410.00	12.39
	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	62,787,516.22	5.56
6	其他各项资产	18,637,777.64	1.65
7	合计	1,129,995,461.21	100.00

### 2. 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	-	-
B	采掘业	54,862,294.50	4.89
C	制造业	175,078,288.83	15.62
C0	食品、饮料	46,066,569.24	4.11
C1	纺织、服装、皮毛	18,891,176.84	1.69
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,378,182.26	0.84
C5	电子	7,666,700.00	0.68
C6	金属、非金属	1,706,500.00	0.15
C7	机械、设备、仪表	67,039,263.87	5.98
C8	医药、生物制品	24,329,896.62	2.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,083,500.00	0.81
F	交通运输、仓储业	38,479,900.00	3.43
G	信息技术业	10,675,237.90	0.95
H	批发和零售贸易	56,580,067.27	5.05
I	金融、保险业	342,805,809.76	30.59
J	房地产业	63,729,531.73	5.69
K	社会服务业	3,636,527.36	0.32
L	传播与文化产业	3,100,200.00	0.28
M	综合类	-	-
	合计	758,031,357.35	67.63

## 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	601318	中国平安	1,720,000	62,917,600.00	5.61
2	601288	农业银行	21,153,700	56,691,916.00	5.06
3	600036	招商银行	4,600,000	54,740,000.00	4.88
4	601009	南京银行	3,610,000	31,731,900.00	2.83
5	600016	民生银行	5,000,000	31,350,000.00	2.80
6	600000	浦发银行	2,700,000	24,111,000.00	2.15
7	600009	上海机场	1,820,000	23,514,400.00	2.10
8	600694	大商股份	780,000	22,058,400.00	1.97
9	600383	金地集团	3,403,027	20,384,131.73	1.82
10	601169	北京银行	2,000,000	19,640,000.00	1.75

## 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	44,494,400.00	3.97
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	106,044,000.00	9.46
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	150,538,400.00	13.43

## 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	1181254	11蒙高新CP01	400,000	40,296,000.00	3.60
2	1101096	11央行票据96	360,000	34,826,400.00	3.11
3	041164010	11天山水泥CP001	300,000	30,465,000.00	2.72
4	1181276	11陕电子CP01	200,000	20,142,000.00	1.80
5	1181203	11农产品CP01	150,000	15,141,000.00	1.35

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。

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。

8. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	3,714,964.99
3	应收股利	-
4	应收利息	3,726,990.99
5	应收申购款	10,195,821.66
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,637,777.64

(4) 报告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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## 十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）基金净值表现

历史各时间段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
2004/11/25-2004/12/31	0.16%	0.01%	-5.53%	0.67%	5.69%	-0.66%
2005/1/1-2005/12/31	3.07%	0.69%	-7.52%	1.04%	10.59%	-0.35%
2006/1/1-2006/12/31	106.91%	1.46%	81.94%	1.05%	24.97%	0.41%
2007/1/1-2007/12/31	107.31%	2.15%	107.41%	1.73%	-0.10%	0.42%
2008/1/1-2008/12/31	-57.21%	2.34%	-52.24%	2.29%	-4.97%	0.05%
2009/1/1-2009/12/31	40.12%	0.86%	66.45%	1.51%	-26.33%	-0.65%
2010/1/1-2010/12/31	2.30%	1.02%	-8.09%	1.17%	10.39%	-0.15%
2011/1/1-2011/12/31	-8.39%	0.96%	-18.50%	0.97%	10.11%	-0.01%
2012/1/1-2012/3/31	2.49%	0.98%	3.59%	1.12%	-1.10%	-0.14%

（二）本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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本基金成立于 2004 年 11 月 25 日，截至 2012 年 3 月 31 日，本基金成立不满八年。

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。

## 十二、费用概览

（一）管理费：

按前一日的基金资产净值的 1.5% 年费率计提

（二）托管费：

按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计算

（三）申购费率：

本基金的申购费按申购金额采用比例费率，申购费率按申购金额的大小分为三档，具体如下表所示：

申购金额	费率
100 万元以下	1.5%

100万元(含)—500万元	1.2%
500万元(含)以上	1000元

最低申购金额：1,000元

（四）赎回费率：

赎回费率随基金份额持有人持有本基金的时间的增加而递减，如下表所示：

持有期限（日历日）	赎回费率
1天至365天	0.5%
366天（含）以上	0.25%

最低赎回份额：500份基金份额

本基金账户最低保留本基金份额余额：500份

### 十三、对招募说明书更新部分的说明

《东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）》（2012年第1号）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”中，更新了“招募说明书有关财务数据的截止日期”及“其他内容的截止日期”。

（二）在“三、基金管理人”部分，对基金管理人的相关内容进行了更新。

（三）在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的相关内容进行了更新。

（四）在“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构、会计师事务所的信息。

（五）在“七、基金份额的申购与赎回”部分，更新了“申购与赎回办理的场所”、“定期定额投资计划”等内容，并说明了开通定期定额投资的代销机构和日期。

（六）在“八、基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”的内容，截止日期更新为2012年3月31日，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。

（七）在“九、基金的业绩”部分，更新了“基金净值表现”和“本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。



（八）在“十九、基金托管协议的内容摘要”部分，更新了基金管理人、基金托管人的相关信息。

（九）在“二十、对基金份额持有人的服务”部分，更新了具体服务内容。

（十）在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了（四）从本基金2011年第2次《招募说明书（更新）》截止日2011年11月25日至本次《招募说明书（更新）》截止日2012年5月25日之间的信息披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录东方基金管理有限责任公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)。

东方基金管理有限责任公司

2012年7月6日