

# 东方龙混合型开放式证券投资基金

## 招募说明书(更新)摘要

### (2007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：二〇〇七年七月

#### 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“基金管理人”、“管理人”或“本公司”)保证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。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本基金《招募说明书》。

本基金《招募说明书》有关财务数据和净值表现截止日为 2007 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)，其他所载内容截止日为 2007 年 6 月 20 日。

本基金《招募说明书》更新部分已经本基金托管人复核。

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：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层

法定代表人：李维雄

总经理：程红

成立日期：2004 年 6 月 11 日

注册资本：1 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：1100001704226

联系人：孙晔伟

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
东北证券有限责任公司	4600 万元	46%
四川南方希望实业有限公司	1800 万元	18%
上海市原水股份有限公司	1800 万元	18%
河北宝硕股份有限公司	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；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、投资决策委员会和研究部、基金管理部、交易部、市场部、机构理财部、信息技术部、登记清算部、金融工程部、监察稽核部、人力资源部、行政部十一个职能部门；本公司设督察长，领导监察稽核部，负责公司的监察稽核工作。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事基本情况

李维雄先生，董事长，经济学硕士，高级经济师。1988年起先后在吉林省政府办公厅、吉林省信托投资公司、吉林省财政厅工作，1999年起历任吉林证券重组领导小组组长，东北证券有限责任公司董事长兼总裁，东北证券有限责任公司总裁；现任本公司董事长。

杨树财先生，董事，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；现任东北证券有限责任公司总裁。

李晓东先生，董事，EMBA。历任中国航空油料西南公司副科长、副处长，深圳中油空港实业股份有限公司副总经理，新希望集团金融事业部总经理，四川南方希望实业有限公司总裁助理，中国民生银行董事；现任福建联华国际信托投资有限公司常务董事、总裁，北京双鹤药业股份有限公司董事，中联实业股份有限公司常务董事，方正证券有限公司独立董事。

安红军先生，董事，经济系博士。历任南方证券投资银行总部上海业务处处

长、南方证券上海分公司总经理助理、南方证券投资银行总部副总经理、总经理，天同证券总裁助理，华泰证券有限公司投资银行业务总监，上海世博土地控股有限责任公司业务总监；现任上海市原水股份有限公司总经理。

程红女士，董事，会计学硕士，高级经济师。历任中国建设银行吉林省分行房贷部业务经理，吉林省信托投资公司长春解放大路营业部副总经理，东北证券有限责任公司北京总部总经理、总裁助理，本公司副总经理、代理总经理；现任本公司总经理。

黑学彦先生，独立董事，大学本科，高级经济师。历任吉林省委财贸部基层工作处处长，吉林省经委进出口处处长，吉林省商业厅副厅长，吉林省国际信托公司董事长、总经理兼党组书记，海南省国际信托投资公司董事长、总经理、党委书记，中国证券业协会副秘书长，银华基金管理有限责任公司董事长。

宋冬林先生，独立董事，经济学博士，教授。现任长春税务学院院长，吉林大学经济学院经济学教授，博士生导师，享受国务院政府津贴。

刘锋先生，独立董事，金融学博士，教授。现任中国金融理财标准委员会副秘书长兼金融学教授，麦吉尔大学管理学院中国项目管理中心主任和金融财务学兼职教授，加中金融协会副会长，中国人民银行研究生部访问教授，中国人民大学商学院兼职教授，中央财经大学访问教授，大连理工大学客座教授，美国金融学会和加拿大管理科学学会会员。

## 2、监事情况

何俊岩先生，监事会主席，会计学学士，高级会计师。历任吉林省五金矿产进出口公司财务科长，东北证券证券有限责任公司计划财务部总经理、受托资产管理总部总经理；现任东北证券证券有限责任公司财务总监。

蒋家智先生，监事，硕士研究生，经济师。历任上海道勤企业咨询有限公司咨询顾问，上海水务资产经营发展有限公司资产经营部副经理；现任上海市原水股份有限公司资产经营部副经理。

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，10余年金融、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

程红女士，总经理，简历请参见董事介绍。

付勇先生，副总经理。北京大学金融学博士研究生，会计学硕士，数学学士。10余年金融、证券从业经历，曾先后在中国建设银行总行、华龙证券有限责任公司、东北证券有限责任公司工作；2004年加盟本公司，曾任发展规划部经理、投资总监助理、本基金基金经理助理、总经理助理；现任本公司副总经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。

孙晔伟先生，督察长，经济学博士，副研究员。历任吉林省社会科学院助理研究员，吉林省光华律师事务所执业律师，东北证券有限责任公司北京投资银行部总经理、北京总部总经理；现任本公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
杜位移（先生）	2006年3月3日至今	中国人民银行总行金融研究所金融学专业研究生，经济学硕士，8年金融、证券从业经历。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年加盟本公司，曾任研究部经理，现任基金管理部经理。2006年3月3日至今任本基金基金经理。
季雷（先生）	2007年3月16日至今	经济学博士、MBA、物理学士。6年证券从业经历，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年加盟本公司，曾任本基金基金经理

		助理，研究部经理，现任金融工程部经理。2007年3月16日至今任本基金基金经理。
宋炳山（先生）	2004年11月25日至2006年3月3日	

### 5、投资决策委员会成员

付勇先生：副总经理，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员。

杜位移先生：本基金基金经理，基金管理部经理，投资决策委员会委员。

季雷先生：本基金基金经理，金融工程部经理，投资决策委员会委员。

钱斌先生：机构理财部经理。经济学硕士，9年投资研究经验，曾先后在上海申华实业股份有限公司、长盛基金管理有限公司、深圳今日投资管理有限公司和诺德基金管理有限公司工作；现任本公司机构理财部经理。

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：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

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 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史，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：HK0939）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。截至2006年6月30日止，中国建设银行总资产为人民币51,662.42亿元，客户存款为人民币44,915.66亿元，2006年上半年实现税前利润人民币328.14亿元。中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约设有代表处。2006年8月24日，中国建设银行在香港与美国银行签署协定，收购美国银行在香港的全资子公司美国银行（亚洲）股份有限公司100%的股权。中国建设银行在《银行家》2006年公布的全球银行按一级资本排名中，名列中国银行业榜首，在世界大银行中列第11位。中国建设银行在《福布斯》2006年全球领先企业榜中为第65名，列中国第二位。在《亚洲周刊》2006年7月公布的亚洲银行300强排名中，中国建设银行在“利息收入净值最高的银行”和“纯利最高的银行”两项排名中均列第一位，被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外，在2006年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中，中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司管治”、“最佳派息承诺”排行榜。

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、监督稽核处和投资委托托管团队等8个职能处室，现有员工80余人。

## （二）主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部工作，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

## （三）基金托管业务经营情况

截止到2006年12月31日，中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉博、通宝、通乾、鸿飞、银丰等11只封闭式证券投资基金，以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列（包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金）、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华一道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长等44只开放式证券投资基金。

#### 四、相关服务机构

##### （一）销售机构

###### 1、直销机构：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

法定代表人：李维雄

直销中心：东方基金管理有限责任公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

联系人：侯思媛

电话：010-66295907

传真：010-66578700

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

###### 2、代销机构

###### （1）代销机构：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：郭树清



客户服务统一咨询电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 代销机构：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：福州市湖东路154号中山大厦

法定代表人：高建平

联系电话：0591-87839338-302526

传真：0591-83317786

联系人：陈丹

客户服务电话：95561

公司网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(3) 代销机构：东北证券有限责任公司

住所：长春市人民大街138-1号

办公地址：长春市自由大路1138号1007室

法定代表人：李树

电话：0431-5096710

传真：0431-5680032

联系人：高新宇

客户服务热线：0431-5096733

公司网站：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(4) 代销机构：广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

法定代表人：王志伟

开放式基金咨询电话：020-87555888-875

开放式基金业务传真：020-87557985

联系人：肖中梅

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

(5) 代销机构：国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市延平路135号

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

联系人：芮敏祺

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

(6) 代销机构：东方证券有限责任公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22-29层

法定代表人：王益民

电话：021-63325888

联系人：盛云

客户服务号：021-962506

公司网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(7) 代销机构：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：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

传真：021-53858549

联系人：金芸

客户服务咨询电话：021-962503

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

(8) 代销机构：中国银河证券有限责任公司

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：朱利

电话：010-66568587-8536

传真： 010—66568532

联系人： 郭京华

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

(9) 代销机构： 华泰证券有限责任公司

住所： 南京市中山东路90号

办公地址： 南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人： 吴万善

电话： 025—84457777—721

传真： 025—84579879

联系人： 张雪瑾

客户服务电话： 025—84579897

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

(10) 代销机构： 中信建投证券有限责任公司

住所： 北京市东城区新中街68号

办公地址： 北京市东城区朝内大街188号

法定代表人： 黎晓宏

电话： 400—8888—108； 010—65186758

传真： 010—65182261

联系人： 权唐

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

(11) 代销机构： 金通证券股份有限公司

住所： 杭州凤起路108号国信房产大厦8-12层

办公地址： 杭州凤起路108号国信房产大厦8-12层

法定代表人： 应士歌

电话： 0571—96598

传真： 0571—85783748

联系人： 何燕华

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

(12) 代销机构： 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：上海市浦东陆家嘴东路166号中国保险大厦18层  
法定代表人：兰荣  
电话：021-68419974  
传真：021-68419867  
联系人：杨盛芳  
网址：www.xyzq.com.cn

(13) 代销机构：国元证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市寿春路179号  
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号  
法定代表人：凤良志  
电话：0551-2634400-1112  
传真：0551-2634400-1171  
联系人：李蔡  
客户服务电话：0551-96888、400-8888-777  
网址：www.gyzq.com.cn

(14) 代销机构：山西证券有限责任公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心  
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心  
法定代表人：吴晋安  
电话：0351-8686708、8686766  
传真：0351-8686709  
联系人：刘文康、邹连星  
客户服务电话：0351-8686868  
网址：www.i618.com.cn

(15) 代销机构：光大证券股份有限公司

住所：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼  
办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼  
法定代表人：王明权

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：刘晨

客户服务电话：021-68823685

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

(16) 代销机构：国信证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦21层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：林建闽

客户服务电话：800-810-8868

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

(17) 代销机构：中信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

电话：010-84588266

传真：010-84865560

联系人：陈忠

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

(18) 代销机构：申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

法定代表人：王明权

电话：021-54033888

传真：021-54030294

联系人：李清怡

客户服务电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

(19) 代销机构：东海证券股份有限公司

住所：常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址：上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

联系人：邵一明

客户服务电话：400-888-8588

网址：<http://www.longone.com.cn>

(二) 注册登记机构：东方基金管理有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼16层

法定代表人：李维雄

电话：010-66295871

传真：010-66578680

联系人：肖向辉

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

(三) 律师事务所和经办律师

名称：北京市君泽君律师事务所

住所：北京市东城区东四十条68号平安发展大厦3层

法定代表人：陶修明

联系电话：010-84085858

传真：010-84085338

联系人：钟向春

经办律师：钟向春

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：北京天华中兴会计师事务所有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦17层

法定代表人：夏执东

联系电话：010-68315858

传真：010-88395050

联系人：朱锦梅

经办注册会计师：杨贵鹏、朱锦梅

## 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) 基金的投资目标

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) 基金的投资方向

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。

(一) 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，并依据上述报告对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见；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，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划，包括资产配置、行业配置、股票/债券选择，以及买卖时机。

4、交易部依据基金经理小组的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，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程序做出调整。

## （二）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。

### 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、基金的投资组合报告

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2007年3月31日（财务数据未经审计）。

#### （一）基金资产组合情况

项目名称	金额（元）	占基金资产总值比例
股票	1,116,962,402.60	84.07%
债券	33,685,604.10	2.54%
权证	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	136,043,965.30	10.24%
其他资产	41,979,792.58	3.15%
资产总值	1,328,671,764.58	100.00%

（二）按行业分类的股票投资组合

行业	金额（元）	市值占净值比
A 农、林、牧、渔业	340,225.33	0.03%
B 采掘业	19,860,000.00	1.54%
C 制造业	419,545,849.60	32.46%
C0 食品、饮料	47,712,360.87	3.69%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	19,790,568.32	1.53%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	65,342,781.74	5.06%
C6 金属、非金属	113,529,007.08	8.78%
C7 机械、设备、仪表	139,111,663.51	10.76%
C8 医药、生物制品	18,568,972.08	1.44%
C99 其他制造业	15,490,496.00	1.20%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	5,663,817.30	0.44%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	154,335,049.02	11.94%
G 信息技术业	143,457,829.96	11.10%
H 批发和零售贸易	98,028,754.34	7.58%
I 金融、保险业	96,356,831.74	7.45%
J 房地产业	30,413,468.62	2.35%
K 社会服务业	141,450,942.94	10.94%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	7,509,633.75	0.58%
合计	1,116,962,402.60	86.41%

（三）基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	市 值（元）	市值占净值比	数 量（股）
1	600258	首旅股份	70,270,697.74	5.44%	3,099,722
2	601006	大秦铁路	68,490,500.00	5.30%	5,330,000
3	600100	同方股份	62,034,592.26	4.80%	2,599,941
4	600835	上海机电	53,784,738.60	4.16%	3,609,714
5	600386	北京巴士	53,536,189.30	4.14%	4,465,070
6	000063	中兴通讯	52,638,075.50	4.07%	1,199,045
7	000666	经纬纺机	52,325,890.00	4.05%	6,199,750
8	600584	长电科技	39,186,538.56	3.03%	3,139,947
9	601166	兴业银行	34,950,612.80	2.70%	1,284,949
10	600019	宝钢股份	34,656,009.30	2.68%	3,500,607

（四）债券各券种投资组合信息披露

债券类别	债券市值（元）	市值占净值比
交易所国债投资	3,664,964.10	0.28%
银行间国债投资	0.00	0.00%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	0.00	0.00%
国家政策金融债券	30,020,640.00	2.32%
合计	33,685,604.10	2.60%

（五）债券投资持仓前五名

债券名称	市值（元）	市值占净值比
06 进出 03	30,020,640.00	2.32%
05 国债(7)	3,664,964.10	0.28%

（六）投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产的构成

项目名称	项目市值（元）
------	---------

交易保证金	621,080.43
应收证券清算款	22,316,340.84
应收利息	634,233.75
应收申购款	18,408,137.56
合计	41,979,792.58

4、本基金在本期间未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内，本基金无权证投资。

6、本报告期内，本基金无资产支持证券投资。

（七）开放式基金份额变动

期初基金份额	213,688,819.30
期间总申购份额	1,457,658,935.07
期间总赎回份额	447,824,475.42
期末基金份额	1,223,523,278.95

十一、基金的业绩

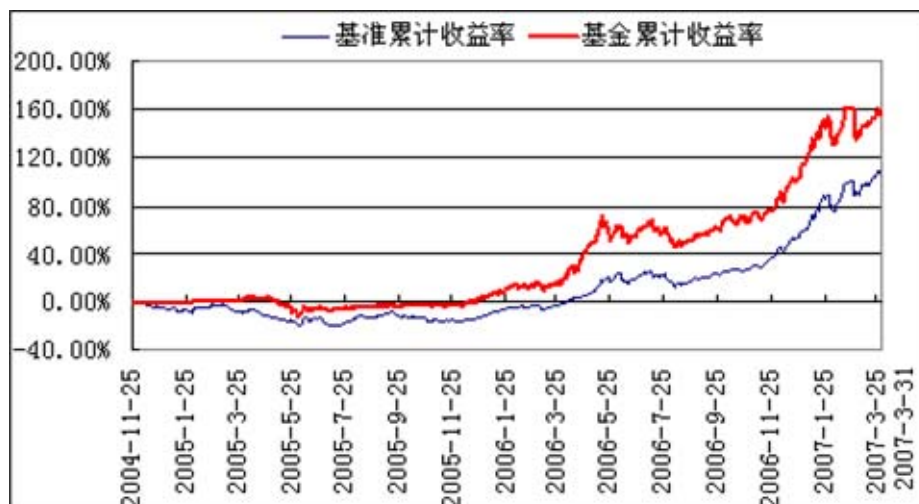
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金净值增长率如下：

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%
2007/1/1-2007/3/31	19.41%	2.12%	30.60%	1.86%	-11.19%	0.26%

（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 2007 年 3 月 31 日，本基金成立不满三年。

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。

（三）本报告期内，本着及时回报基金份额持有人的宗旨，本公司分别以截至 2006 年 12 月 29 日、2007 年 1 月 11 日和 2007 年 1 月 26 日的可分配收益为基准，向本基金份额持有人进行了第五次、第六次和第七次收益分配。上述分红方案已于 2007 年 1 月 4 日、2007 年 1 月 12 日和 2007 年 1 月 30 日公告。

1、收益分配方案为：

第五次收益分配：每 10 份基金份额派发现金红利 2.50 元。

第六次收益分配：每 10 份基金份额派发现金红利 0.87 元。

第七次收益分配：每 10 份基金份额派发现金红利 1.045 元。

2、收益分配时间为：

第五次收益分配

（1）权益登记日、除息日：2007 年 1 月 8 日；

（2）红利发放日：2007 年 1 月 9 日；

(3) 选择红利再投资的投资者,其红利将按2007年1月8日的基金份额净值转换为基金份额;

(4) 红利再投资的基金份额可查询或可赎回起始日: 2007年1月10日。

#### 第六次收益分配

(1) 权益登记日、除息日: 2007年1月15日。

(2) 红利发放日: 2007年1月16日。

(3) 选择红利再投资的投资者,其红利将按 2007年1月15日的基金份额净值转换为基金份额。

(4) 红利再投资的基金份额可查询或赎回起始日: 2007年1月17日。

#### 第七次收益分配

(1) 权益登记日、除息日: 2007年1月29日

(2) 红利分配日: 2007年1月30日

(3) 选择红利再投资的投资者, 其现金红利将按 2007年1月29日除息后的基金份额净值转换为基金份数。

(4) 选择红利再投资方式的投资者, 再投资所得的基金份额将于 2007年1月30日直接计入其基金账户, 2007年1月31日起可以查询、赎回。

3、收益分配对象: 权益登记日在本公司登记在册的本基金全体份额持有人。

## 十二、费用概览

(一) 管理费率:

按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。

(二) 托管费率:

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

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

本招募说明书依据《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”部分，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

1、更新（一）基金管理人概况内容，包括基金管理人住所、经营范围信息；更新内部组织结构内容，增加机构理财部为本公司职能部门。

2、更新（二）基金管理人主要人员情况，包括：

（1）董事会成员信息：李树先生、吴守培先生和周山先生不再担任本公司董事；杨树财先生、安红军先生新任本公司董事。

（2）监事会成员信息：白磊先生不再担任本公司监事；蒋家智先生新任本公司监事；何俊岩先生任监事会主席。

（3）其他高级管理人员信息：付勇先生任本公司副总经理。

（4）对本基金基金经理信息进行更新；并根据《基金管理公司投资管理人員管理指导意见》，披露本基金历任基金经理信息。

（5）对投资决策委员会成员信息进行了更新。

（三）更新（五）基金管理人的内部控制制度内容。

（四）在“四、基金托管人”部分，对基金托管人情况进行了相应的更新。

（五）在“五、相关服务机构”部分，更新了基金管理人住所信息；更新了直销机构住所、联系人和电话信息；更新了代销机构信息，包括东方证券有限责任公司各项信息；新增中信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司和东海证券股份有限公司为代销机构；更新了注册登记机构住所信息；更新了会计师事务所和经办注册会计师内容。

（六）在“七、基金份额的申购与赎回”部分，更新了申购和赎回的数额、余额的处理方式和申购份额的计算方式。

（七）在“八、基金的投资”部分，更新了（七）基金投资组合报告的内容，截止日期更新为2007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。

（八）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；更新了本基金的分红信息。

（九）在“十三、基金的费用与税收”部分，更新了申购份额的计算方式。

（十）在“十九、基金托管协议的内容摘要”部分，更新了（一）托管协议当事人信息，包括基金管理人住所信息，经营范围信息。

（十一）在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了自上次《招募说明书（更新）》截止日2006年12月20日到本次《招募说明书（更新）》截止日2007年6月20日之间的信息披露事项。

公告名称	发布日期
东方龙混合型开放式证券投资基金资产净值公告	2006-12-30
东方龙混合型开放式证券投资基金第五次分红公告	2007-01-04
东方龙混合型开放式证券投资基金招募说明书（更新）（2006年第2号）	2007-01-08
东方龙混合型开放式证券投资基金第六次分红公告	2007-01-12
东方基金管理有限责任公司关于增加开放式证券投资基金代销机构的公告	2007-01-15
东方龙混合型开放式证券投资基金季度报告（2006年第4季度）	2007-01-22
东方龙混合型开放式证券投资基金第七次分红预告	2007-01-23
东方龙混合型开放式证券投资基金第七次分红权益登记日、除息日提示性公告	2007-01-29
东方龙混合型开放式证券投资基金第七次分红公告	2007-01-30
东方基金管理有限责任公司关于开通中国建设银行龙卡储蓄	2007-02-01



卡基金网上交易的公告	
东方基金管理有限责任公司关于东方龙混合型开放式证券投资基金变更审计机构的公告	2007-02-10
东方基金管理有限责任公司关于变更高级管理人员的公告	2007-03-06
东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理任职公告	2007-03-16
关于增加开放式证券投资基金代销机构的公告	2007-03-28
东方龙混合型开放式证券投资基金 2006 年年度报告	2007-03-30
东方龙混合型开放式证券投资基金 07 年 1 季度季度报告	2007-04-20
关于开展中国建设银行龙卡储蓄卡基金网上交易费率优惠活动的公告	2007-05-16
东方基金管理有限责任公司关于旗下基金采用外扣法计算前端申购费用和申购份额及修改基金合同相关条款的公告	2007-06-01
东方基金管理有限责任公司关于调整东方龙混合型开放式证券投资基金单次最低赎回份额及最低持有份额的公告	2007-06-04

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。预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)。

#### 十四、签署日期

本招募说明书（更新）于 2007 年 7 月签署。

东方基金管理有限责任公司

2007 年 7 月 5 日