

【2010】年度報告摘要

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.4828元,基金份额总额2,524,442,353.47份。

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	747,738,796.42	592,077,382.53
利息收入	5,946,040.02	5,509,613.76
其中：存款利息收入	4,302,928.81	1,909,913.57
债券利息收入	1,643,111.21	3,599,700.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
投资收益（损失以“-”填列）	392,909,971.27	516,103,842.88
其中：股票投资收益	381,970,835.32	504,511,073.90
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,081,351.41	-649,807.91
资产支持证券投资	-	-

生产工具收益		
股利收益	9,857,784.54	12,242,576.89
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	345,995,517.89	69,702,100.04
汇兑收益(损失以“-”号填列)		
其他收入(损失以“-”号填列)	2,887,267.24	761,825.85
减:费用	105,448,240.24	93,325,783.12
管理报酬	41,357,401.52	26,218,432.70
托管费	6,892,900.14	4,369,738.75
销售服务费		
交易费用	56,702,288.73	62,198,614.69
利息支出	83,196.78	19,559.34
其中:卖出回购金融资产支出	83,196.78	19,559.34
其他费用	412,453.07	419,437.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	642,290,556.18	498,751,599.41
减:所得税费用		
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	642,290,556.18	498,751,599.41
注:所有金额均按人民币列报		

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	1,484,245,496.49	304,993,247.41	1,789,238,743.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	642,290,556.18	642,290,556.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	1,040,196,856.98	271,580,548.57	1,311,777,405.55
四、本期基金份额赎回产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	2,913,403,586.03	1,106,364,435.98	4,019,768,022.01
五、本期基金赎回费产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-1,873,206,729.05	-834,783,887.41	-2,707,990,616.46
六、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)	-	-	-
七、期末所有者权益(基金净值)	2,524,442,353.47	1,218,864,352.16	3,743,306,705.63

项目	上年可比期间		
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,877,816,477.29	-178,442,860.65	1,699,373,616.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期损益)		-498,751,599.41	498,751,599.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净申购减少以“-”号列)	-393,570,980.80	15,319,491.35	-408,886,472.15
四、本期基金份额持有人分配利润(净派红利)	402,664,390.05	20,250,131.85	422,914,521.90
五、其他所有者权益变动(净减少以“-”号列)	-796,235,370.85	-35,565,623.20	-831,800,994.05
六、本期基金份额持有人分配利润(净派红利)			
七、期末所有者权益(基金净值)	1,484,245,496.49	304,993,247.41	1,789,238,743.90

基金管理人财务负责人:张世强
基金管理人财务负责人:徐建平,主管会计工作负责人:董忠平,会计机构负责人:李健

4. 投资决策
2.4.1 基金投资
本基金的投资范围为:以股票资产投资为主,以下列“本基金”系统内其他公募基金等金融产品为辅,投资于境内和境外权益类资产及固定收益类资产等,基金合同于2006年12月31日生效。报告期内,本基金的投资范围未发生变更。
2.4.2 11月24日,本基金管理人召开投资决策委员会,审议通过《关于调整本基金资产配置比例的议案》,自2012年11月24日起,本基金资产配置比例调整为:股票资产占基金资产净值的比例不低于60%,债券资产占基金资产净值的比例不高于35%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不高于5%。
2.4.3 11月24日,本基金管理人召开投资决策委员会,审议通过《关于调整本基金资产配置比例的议案》,自2012年11月24日起,本基金资产配置比例调整为:股票资产占基金资产净值的比例不低于60%,债券资产占基金资产净值的比例不高于35%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不高于5%。
2.4.4 本基金管理人于2012年11月24日召开投资决策委员会,审议通过《关于调整本基金资产配置比例的议案》,自2012年11月24日起,本基金资产配置比例调整为:股票资产占基金资产净值的比例不低于60%,债券资产占基金资产净值的比例不高于35%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不高于5%。

4. 基金管理人内部控制制度及执行情况的说明
本基金管理人内部控制制度符合中国证监会的要求,真实、完整地反映了本基金的实际状况,经营成果和所有者权益变动情况,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金管理人内部控制制度符合中国证监会的要求,真实、完整地反映了本基金的实际状况,经营成果和所有者权益变动情况,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

[illegible]

关联方名称	与本基金的关系
东吴基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人、基金代销机构
华兰生(集团)有限公司	基金管理人的股东
内蒙古星实业集团有限公司	基金管理人的股东

7.4.8 本报告期内及上年度报告期内关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	7,617,903,907.29	20.15%	8,829,847,710.36	21.71%
7.4.8.1.2权证交易				
7.4.8.1.3债券交易				
7.4.8.1.4股指期货交易				
7.4.8.1.5支付关联方款项的佣金				

关联方名称	本期				金额单位:人民币
	2010年1月1日至2010年12月31日				
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例	
东吴证券股份有限公司	6,269,415.73	19.94%	115,629.44	0.98%	
关联方名称	上年度可比期间				
	2009年1月1日至2009年12月31日				
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例	
安信证券股份有限公司	7,471,753.10	21.92%	725,702.50	18.07%	

本基金为契约型开放式基金，其存续期间为不定期。除法律法规另有约定外，本基金管理人有权根据基金合同的约定或经基金份额持有人大会决议，在符合法律法规的前提下，调整基金费率、增加新的收费项目等，但此项调整应当经中国证监会核准，并应在实施前报中国证监会备案，同时通过指定信息披露媒介及时公告。

7.4.8.2 基金费用

7.4.8.2.1 基金管理费

项目	单位：人民币元	
	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基本基金应付的管理费	31,497,401.52	26,218,432.75
其中：支付销售机构的客户维护费	4,495,492.29	3,743,806.50

注：本基金管理费由东方基金管理有限责任公司按照前一日基金资产净值×1.5%的年费率计提，按日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.5%÷当年天数。

[illegible]

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限	692,923,318.52	3,953,347.17	427,859,427.80	1,653,513.88

代码	发行证券名称	买入日期	可流通日期	浦发受偿类别	认购价格	期末估值单价	数量 (股)	期末账面成本	期末估值成本	备注
300150	世纪瑞尔	2010-12-15	2011-03-22	新设网下申购锁定期间	32.99	47.80	770,000	25,402,300.00	36,806,000.00	-
002054	东光光电	2010-11-10	2011-02-18	新设网下申购锁定期间	16.00	26.85	25,616	409,856.00	687,789.60	-

7.4.9.3 期末持有到期投资公允价值变动损益明细表

本期末公允价值变动损益为 0 元。

7.4.9.3 期末持有到期投资公允价值变动损益明细表

本期末公允价值变动损益为 0 元。

<p>7.4.9.1 基金资产投资于境内上市交易的股票</p> <p>本基金未投资于境内上市交易的股票。</p> <p>7.4.9.2 基金资产投资于非上市交易的股票</p> <p>本基金未投资于非上市交易的股票。</p> <p>7.4.10 投资于资产支持证券的情况</p> <p>本基金未投资于资产支持证券。</p> <p>7.4.11 投资于股指期货的情况</p> <p>本基金未投资于股指期货。</p> <p>7.4.12 投资于国债期货的情况</p> <p>本基金未投资于国债期货。</p> <p>7.4.13 投资于商品期货的情况</p> <p>本基金未投资于商品期货。</p> <p>7.4.14 其他金融衍生品投资情况</p> <p>本基金未投资于其他金融衍生品。</p>		<p>§ 8 投资组合报告</p>	
<p>8.1 期末基金资产组合情况</p>		<p>金额单位：人民币元</p>	
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,958,323,045.78	76.84
	其中：股票	2,958,323,045.78	76.84
2	固定收益投资	148,846,960.20	3.87

	其中：债券	148,846,960.20	3.87
	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	721,952,497.76	18.75
6	其他各项资产	21,101,462.10	0.55
7	合计	3,850,223,965.84	100.00
s2	期末按行业分类的股权投资类金融资产		
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比

		例(%)
A	农、林、牧、渔业	26,056,135.42 0.70
B	采掘业	119,700,968.01 3.20
C	制造业	1,834,159,819.11 49.00

C0	食品、饮料	685,888,529.51	18.3
C1	纺织、服装、皮毛	103,049.89	0.0
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	51,491,980.54	1.3
C5	电子	148,790,945.71	3.9
C6	金属、非金属	16,278,390.45	0.4
C7	机械、设备、仪表	665,188,160.07	17.7
C8	医药、生物制品	266,418,562.94	7.1
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	648,610,335.44	17.3
F	交通运输、仓储业	119,329,519.10	3.1
G	信息技术业	60,292,551.56	1.6
H	批发和零售业	13,427,454.24	0.4
I	金融、保险业	51,737,007.60	1.3
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	84,909,055.30	2.2
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-

合计						2,958,323,045.78	79.00
K3和元盛公允价值占基金资产净值比例大于等于1%的前十名投资品种明细							金额单位：人民币 占基金资产净值 比例(%)
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值			
1	000996	古井贡酒	4,097,012	328,580,362.40		8.7	
2	600809	山西汾酒	4,554,587	312,125,847.11		8.3	
3	002431	棕榈油	2,900,573	263,952,143.00		7.0	
4	002223	鱼跃医疗	4,515,185	227,520,172.15		6.0	
5	002375	亚厦股份	1,966,551	180,883,360.98		4.8	
6	600690	青岛海尔	5,839,722	164,738,557.62		4.3	
7	700423	东阿阿胶	3,176,117	162,299,578.70		4.3	
8	600970	中材国际	2,278,350	111,071,128.50		2.9	
9	000968	煤气化	3,146,061	81,703,204.17		2.1	
10	600535	天士力	1,959,822	79,882,344.72		2.1	

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	金雅林, 人民币
				占期末基金资产净值比例 (%)
1	600111	方盛制药	748,335,459.50	41.86
2	000762	西药厂	468,027,996.49	26.12
3	000421	新纶科技	428,927,228.36	23.81
4	601601	中国太保	411,653,875.90	23.01
5	000568	泸州老窖	387,916,709.49	21.68
6	603438	国新国际	374,174,074.84	20.85
7	000850	兴业银行	367,334,340.00	20.43
8	601166	兴业银行	358,755,900.99	20.03
9	600690	青岛啤酒	355,170,071.24	19.85
10	600585	江铃汽车	327,637,462.57	18.27
11	000951	格力电器	309,055,081.08	17.30
12	002223	鱼跃医疗	287,341,392.17	16.06
13	000002	万科股份	277,531,007.96	15.51
14	600036	广生股份	274,197,540.01	15.21
15	600518	康美药业	272,122,276.19	15.21
16	600809	山西汾酒	262,670,401.63	14.58

19	600993	西昌电力	250,538,375.01	45.40
20	601609	紫金矿业	251,701,635.50	45.40
21	002155	豫矿矿业	251,463,361.95	14.05
22	601106	西部矿业	245,512,577.24	13.72
23	002343	明阳电气	245,227,661.69	17.31
24	000838	铜业集团	238,874,376.81	17.31
25	600267	烟台万润	212,711,488.73	11.80
26	601318	中国平安	209,390,675.35	11.80
27	600703	三友新材	208,941,567.22	11.80
28	000923	吉林敖东	206,701,882.42	11.52
29	000086	东方金钰	183,737,717.64	10.21
30	600535	天力	178,436,336.35	9.97
31	000022	江苏发展	174,555,654.90	9.97
32	000029	中航航空	173,964,701.64	9.97
33	000547	闽闽发展	166,167,482.24	9.28
34	000581	烟台高品	164,573,070.01	9.28
35	000547	三友新材	155,226,461.34	8.64
36	600547	山东黄金	153,882,654.92	8.64
37	600489	中金黄金	149,261,034.30	8.64

36	000958	美尚生态	129,597,116.53	7.74
37	000968	美都能源	139,072,210.18	7.74
38	000972	美的电器	138,405,547.91	7.74
39	002080	神州科技	136,082,527.13	7.61
40	000481	双箭股份	135,767,822.18	7.56
41	000931	神开股份	129,307,841.86	7.56
42	002017	东方雨虹	126,461,026.65	7.53
43	600036	招商银行	123,971,605.94	7.40
44	000006	中国国贸	121,936,014.86	7.39
45	002375	普华永道	120,133,138.02	7.31
46	600425	晋亿纺织	118,944,544.74	7.26
47	600406	国电南瑞	118,669,403.73	7.26
48	600660	大华股份	118,278,879.54	7.26
49	601111	中国国航	117,148,298.68	6.95
50	002241	聚光科学	117,059,720.33	6.94
51	601899	紫光股份	115,300,286.86	6.54
52	000800	一汽轿车	114,328,585.44	6.54
53	600031	三一重工	110,715,983.46	6.16
54	000157	中联重科	107,804,834.32	6.03

57	000015	吉林敖东	103,213,541.65	5.77
57	000096	吉西药业	105,697,644.78	5.77
58	000070	中国华联	105,490,578.03	5.73
59	000079	酒花股份	96,554,050.00	5.32
60	600015	华鲁能源	95,125,048.00	5.32
61	600315	上海家化	94,941,073.54	5.31
62	002073	联益股份	94,883,717.79	5.30
63	600468	华信国际	93,168,286.23	5.27
64	000661	长春高新	90,996,344.22	5.19
65	002032	苏泊尔	90,045,433.19	5.03
66	000869	冠城大通	89,791,797.19	5.02
67	000431	金宇制药	84,284,836.19	4.71
68	000059	江苏江大	83,294,584.09	4.71
69	600050	中国联通	83,690,694.10	4.68
70	000418	小天鹅A	81,596,294.10	4.59
71	000670	江苏华联	81,290,240.63	4.58
72	000536	闽东电力	80,050,553.81	4.58
73	000456	宝通股份	79,035,183.82	4.42
74	000528	顺鑫农业	77,553,628.88	4.42

75	000509	万向钱潮	73,929,849.19	4.13
76	002362	思摩尔药业	71,477,365.06	3.96
77	002290	荣泰新材	67,092,992.92	3.75
78	200802	沧州明珠	66,330,358.16	3.71
79	000069	华鲁恒升	65,135,788.11	3.62
80	000551	佰利科技	63,982,912.32	3.58
81	600588	爱康医疗	63,581,233.22	3.55
82	601212	美利纸业	61,654,009.66	3.49
83	601099	招商局港	59,166,172.18	3.31
84	600183	生益科技	58,748,366.25	3.28
85	002344	诺德股份	58,198,262.28	3.25
86	000415	*ST 中农	57,925,195.44	3.24
87	600522	中农科技	57,890,230.04	3.24
88	600540	宏达电子	56,405,008.99	3.15
89	600570	恒生电子	56,283,058.13	3.14
90	000115	东方集团	56,052,036.76	3.13
91	600537	海通集团	55,944,036.96	3.13
92	600585	海康光电	55,612,761.41	3.11
93	600579	汇通能源	51,161,867.87	3.01

94	002350	世纪科技	53,029,827.87	2.96
95	600104	上海汽车	53,004,253.54	2.96
96	000858	五洲药业	52,696,608.43	2.96
97	600583	八一钢铁	52,520,007.77	2.96
98	600312	赛迪电气	51,881,516.56	2.96
99	000962	东方集团	51,348,290.21	2.87
100	006760	东方集团	51,083,199.88	2.87
101	600284	浦东建设	50,430,290.00	2.86
102	601269	中国铝业	50,143,428.18	2.86
103	600053	东方地产	50,115,541.35	2.86
104	600525	长海集团	49,725,983.44	2.86
105	000024	招商地产	49,382,412.08	2.76
106	000820	山东钢铁	48,800,253.30	2.73
107	002336	大众软件	46,685,009.97	2.72
108	600963	华联发展	48,216,774.54	2.66
109	600844	丹化科技	47,648,772.54	2.66
110	600276	恒顺发展	47,337,029.82	2.57
111	600465	东方医药	45,753,427.46	2.57
112	002041	中航地产	45,730,877.28	2.57

113	002252	上海重宇	44,241,999.44	2.47
114	600221	海南航空	44,201,272.66	2.47
115	600921	青岛啤酒	43,980,927.51	2.46
116	600090	青岛啤酒	42,677,214.60	2.43
117	601248	信达地产	42,007,147.64	2.34
118	600557	康缘药业	40,701,696.17	2.27
119	000978	开山股份	40,597,079.98	2.27
120	600488	烽火通信	39,510,922.08	2.21
121	002049	国星光电	38,642,890.18	2.16
122	300020	银江股份	38,393,850.51	2.15
123	600857	伊泰煤炭	37,968,641.17	2.14
124	000063	中兴通讯	37,839,474.49	2.11
125	600223	鲁商置业	36,500,842.66	2.06
126	600139	青岛城投	36,352,470.25	2.05
127	000788	中航机电	36,276,976.32	2.03
128	600580	东方电机	36,114,973.41	2.01
129	002214	天孚科技	36,099,087.50	2.02
130	600020	九龙电力	35,844,636.66	2.02
131	002145	华信国际	35,803,963.92	2.00

A.2.2.2 入围企业入围人数及入围企业入围人数与入围企业入围人数之比				入围企业入围人数与入围企业入围人数之比	
序号	入围企业	入围企业	入围企业入围人数	入围企业入围人数与入围企业入围人数之比	入围企业入围人数与入围企业入围人数之比
1	601111	包钢集团	838,461,546.09	25	25
2	007062	西矿集团	454,923,587.07	21	21
3	005568	中国铝业	382,669,585.64	21	21
4	601601	中国铝业	356,864,131.91	20	20
5	601166	兴发集团	353,195,328.89	20	20
6	603048	中国铝业	344,429,596.65	20	20
7	000050	东阿集团	334,394,122.67	20	20
8	004283	东阿集团	338,816,779.39	20	20
9	801679	江化集团	316,435,866.89	17	17
10	000776	广汇集团	274,717,411.00	16	16
11	000983	中国铝业	271,804,963.37	15	15
12	002155	中国铝业	271,764,185.38	15	15
13	000518	康美药业	262,010,914.06	14	14
14	603906	康美药业	260,783,598.16	14	14

15	000538	贵州茅台	254,097,250.11	14
16	000651	格力电器	232,439,934.47	14
17	000600	青岛啤酒	226,701,821.49	13
18	601166	兴业银行	244,076,645.50	13
19	000267	海正药业	243,639,260.63	13
20	000541	天仪空间	238,564,354.48	13
21	601699	潞安环能	217,203,689.61	12
22	601318	中国平安	213,328,919.12	11
23	002038	双鸭山铜	209,243,358.38	11
24	000033	荣信股份	195,055,283.78	11
25	000703	三友药业	193,275,378.08	10
26	600547	山东黄金	177,890,088.35	9
27	000425	鲁轻建设	164,931,297.91	9
28	000062	汇川技术	161,067,488.27	9
29	000015	上海钢联	163,342,277.92	9
30	000386	东方金钰	157,048,094.06	8
31	000489	中金黄金	156,581,831.74	8
32	000547	顺鑫农业	154,492,833.63	8
33	000807	中国国旅	144,266,800.00	8

34	000906	吉首药业	142,782,649.02	7
35	000527	美的电器	141,887,085.87	7
36	000029	南方航空	134,757,155.53	7
37	600263	三友材料	133,334,349.94	7
38	002080	中国科健	132,001,209.72	7
39	604481	双箭股份	130,971,344.18	7
40	001888	中国国旅	129,495,246.86	7
41	002017	东方和平	128,627,609.00	7
42	600046	国统集团	118,799,369.02	7
43	001899	紫金矿业	118,56,340.80	7
44	002041	歌华有线	117,996,276.25	7
45	000026	招商局行	117,641,286.28	7
46	002223	鑫茂股份	116,080,347.21	7
47	000800	一汽轿车	114,961,665.61	7
48	001017	中国嘉陵	112,994,855.85	7
49	000762	通商集团	112,927,606.04	7
50	000933	神火股份	112,474,260.06	7
51	600033	三一重工	109,412,856.46	7

52	600694	大同股份	108,208,368.97	6
53	300015	爱尔眼科	107,304,628.13	6
54	002032	苏泊尔	100,836,461.08	5
55	002262	惠华药业	98,138,512.82	5
56	600535	天士力	98,095,146.74	5

57	600799	通威股份	96,486,042.54	5.39
58	000661	长春高新	95,256,124.32	5.36
59	600198	大唐电信	93,078,530.43	5.20
60	600015	华夏银行	89,078,302.71	4.98
61	000536	国际实业	88,883,293.63	4.85
62	600660	青岛啤酒	86,173,016.83	4.97
63	000660	山东黄金	85,632,973.69	4.79
64	600060	海信电器	83,937,162.69	4.69
65	000869	张裕A	83,565,758.91	4.69
66	601111	中国国航	82,939,265.74	4.64
67	600050	中国联通	82,692,247.10	4.62
68	600570	山东电子	80,143,237.28	4.48
69	002073	世纪佳缘	79,671,118.80	4.45
70	000929	江中药业	76,186,258.21	4.26
71	600750	江中药业	73,343,550.84	4.09
72	600881	八一钢铁	72,767,865.58	4.07
73	002344	海宁皮城	72,648,424.33	4.06
74	004036	宝钛股份	69,865,574.47	3.96
75	000559	万润科技	66,349,271.07	3.71
76	600549	厦门钨业	63,599,718.75	3.55
77	002336	大华股份	62,363,833.62	3.53
78	600122	宏图高科	62,171,026.02	3.53
79	000415	*ST汇通	62,131,677.26	3.53
80	002151	国药控股	62,187,698.73	3.48
81	600183	生益科技	61,504,117.71	3.44
82	600143	金发科技	60,753,865.54	3.40
83	600115	东方航空	59,470,203.81	3.32
84	000969	安泰科技	58,575,221.03	3.27
85	601999	出版传媒	58,533,775.80	3.27
86	600537	海通证券	58,326,473.53	3.26
87	000016	兴源滤业A	52,866,727.10	3.06

88	600585	海螺水泥	57,599,509.99	3.22
89	600522	中天科技	56,762,179.26	3.17
90	000968	德化行	56,590,142.17	3.16
91	600588	用友软件	56,397,255.38	3.15
92	002250	联华科技	55,804,452.61	3.12
93	600569	华菱钢铁	55,596,204.69	3.11
94	000629	天海集团	55,182,745.77	3.08
95	601299	中国北车	53,429,961.18	2.99
96	600837	海通证券	52,799,794.04	2.95
97	600760	长安汽车	52,388,243.45	2.93
98	600104	上汽汽车	52,364,867.53	2.93
99	000024	招商地产	50,858,611.34	2.84
100	600844	丹化科技	50,595,539.39	2.83
101	000088	东方集团	50,546,573.74	2.83
102	600858	五粮液	49,440,507.85	2.76
103	000059	华联控股	49,356,273.98	2.75

104	600511	国药股份	48,852,262.62	2.73
105	600055	东方医药	47,848,513.94	2.67
106	600271	航天信息	47,042,468.09	2.63
107	600557	康缘药业	46,146,400.57	2.58
108	000541	博山钢明	44,904,678.16	2.51
109	600221	海南机场	43,803,809.39	2.51
110	600026	京沪高铁	42,229,040.09	2.49
111	600102	华鲁化工	41,856,869.18	2.34
112	002252	上海莱士	41,307,788.75	2.31
113	000418	小天鵝A	40,839,472.41	2.28
114	600292	九龙电力	40,787,937.88	2.28
115	002449	国星光电	40,348,743.94	2.26
116	000758	中色股份	39,469,383.70	2.21
117	600498	烽火通信	39,229,730.84	2.19
118	000726	国定通信	39,151,102.14	2.18

120	600887	伊利股份	37,464,801.14	2.99
121	600223	鲁商置业	37,392,673.99	2.99
122	002148	北纬通信	36,806,679.71	2.96
123	600686	信达股份	36,148,847.40	2.02
124	600239	云南城投	35,996,762.35	2.01
注：本报告期内，基金投资过程中未发生股票、权证买入和卖出以及权证认购、赎回，不考虑相关交易费用。				
8.4.3 期末按公允价值计量的权益类投资明细				
买入股票的成本(成交)总额			19,392,502,502.50	值(元)
卖出股票的收入(成交)总额			18,463,414,915.61	
注：本报告期内，基金投资过程中未发生股票买入、卖出股票买入、卖出股票卖出、买入权证及卖出权证、权证买入和卖出以及权证认购、赎回，不考虑相关交易费用。				
8.5 期末按公允价值计量的权益类投资组合				
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)	金额单位：人民币元
1	国家债券			
2	央行票据			
3	金融债券	138,457,500.00	3.70	

4	其中：政策性金融债	-	-	-	
5	企业债券	-	-	-	
6	企业短期融资券	-	-	-	
7	可转债	10,389,460.20	0.28	-	
8	其他	-	-	-	
9	合计	148,846,960.20	3.98	-	
8.6 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					
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	0801017	08央行票17	659,000	65,078,000.00	1.74
2	1001019	10央行票19	400,000	39,132,000.00	1.05
3	1001017	10央行票17	350,000	34,247,500.00	0.91
4	113001	中行转债	94,570	38,329,560.00	0.28
8.7 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					
8.8 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					

8.1	基金投资组合报告	
8.1.1	本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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、处罚的情况	
8.1.2	本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。	
8.1.3	期末无前十名债券持有明细	
		单位:人民币元
序号	名称	金额
1	存出保证金	7,262,878.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,869,872.16
5	应收申购款	9,968,711.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,101,462.10
8.2	基金投资资产公允价值变动分析	
8.2.1	报告期内买入并卖出投资资产公允价值变动损益明细	
金额单位:人民币元		

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	113001	中行转债	10,389,460.20	0.28	
9.1 期末基金持有的有息债务情况如下表所示： 本基金报告期内无不良信用资产持仓，报告期内未发生违约或受罚情况。 9.1.1 报告期末按信用评级分类的有息债务情况 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。					
9.1 期末基金持有的有息债务及持有结构					
				单位：人民币元	
			持有人结构		
持有人户数(户)	均持有的基金份额	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
177,789	21,431,901	926,011,341.55	36.68%	1,598,431,011.92	63.32%
9.2 期末基金持有的非以摊余成本计量的有价证券明细					
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		-		-	

[illegible][illegible][illegible]

11.7.2 基金利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
东吴证券	--	--	--	--	--	--
中信证券	--	--	--	--	--	--
中金公司	--	--	--	--	--	--
银华万国	--	--	--	--	--	--
国金证券	--	--	--	--	--	--
东方证券	--	--	--	--	--	--
国信证券	--	--	--	--	--	--
招商证券	--	--	--	--	--	--
东海证券	--	--	--	--	--	--
中银国际	--	--	--	--	--	--
申银万国	--	--	--	--	--	--

平安证券	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-

合计	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---

无。

§ 12影响投资者决策的其他重要信息

东吴基金管理有限公司
二〇一一年三月三十一日

[illegible]