

37	600456	宝钛股份	49,075,312.82	4.86
38	600425	晋控煤化	48,874,953.80	4.80
39	000898	鞍钢股份	47,406,714.29	4.70
40	601857	中国铝业	45,876,326.67	4.55
41	600537	海康威视	45,688,521.67	4.52
42	000880	潍柴动力	45,482,862.34	4.51
43	600609	三友化工	44,875,747.67	4.45
44	600383	金地集团	43,700,723.35	4.35
45	600170	天瑞光电	42,180,149.48	4.22
46	600176	招商局A	42,634,677.60	4.20

8,679,170.99	5,876,868.53	7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券
3,797,282.70	1,347,984.82	7.4.9.3.1银行间市场债券正回购
632,880.47	224,664.13	本基金本报告期末未持有银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。
7.4.9.3.2交易所市场债券正回购		7.4.9.3.2交易所市场债券正回购
		本基金本报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。
3,643,703.77	2,117,391.66	7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

51	600570	恒生银行	29,824,183.37	3.95
52	600050	中国联通	38,874,183.37	3.85
53	600000	浦发银行	38,031,343.41	3.77
54	002155	汇川信息	37,265,936.85	3.69
55	600081	八一五药	37,217,642.79	3.69
56	000058	五洲药业	37,087,397.00	3.68
57	000538	云南白药	36,834,144.75	3.65
58	000661	海南银行	36,260,731.94	3.53
59	000238	内蒙新华	36,113,902.57	3.50
60	000739	辽宁广新	35,666,394.12	3.53

61	002024	苏宁电器	35,078,866.02	3.48
62	600231	凌钢股份	34,953,719.37	3.46
63	601169	北京银行	34,792,633.63	3.45
64	002161	沃龙股份	34,664,461.78	3.44
65	000911	南宁糖业	34,489,777.64	3.42
66	600118	康美药业	34,270,193.66	3.40
67	600598	西安饮食	33,433,526.10	3.31
68	600196	顺荣股份	33,143,922.23	3.28
69	601006	大秦铁路	32,416,432.96	3.21
70	600115	东方航空	32,301,067.67	3.20

71	00059	万润科技	30,970,363.30	3.07
72	600606	云天化	30,966,739.93	3.07
73	600197	伊力特	30,824,760.38	3.03
74	600195	中牧股份	30,625,463.51	3.03
75	601299	中国北车	30,295,399.29	3.00
76	600308	中航锂电	30,234,439.99	3.00
77	02364	华峰铝业	29,966,027.70	2.97
78	000568	泸州老窖	29,523,826.24	2.93

79	600619	贵州茅台	29,369,974.30	2,590
80	002007	华三生物	29,261,366.71	2,590
81	600307	酒钢宏兴	29,213,857.24	2,689
82	600055	东方能源	28,483,935.21	2,882
83	000024	招商局A	28,388,094.29	2,881
84	600362	江西铜业	28,340,200.34	2,881
85	601999	海螺水泥	28,312,714.13	2,881
86	601168	西部矿业	28,237,171.00	2,880
87	002708	西药股份	28,220,372.00	2,880

87	000000	中材科技	28,590.33	2.19
88	002080	华星光电	27,593.33	2.77
89	002262	星华新材	27,823.91	2.76
90	600054	黄山旅游	27,645.60	2.74
91	000759	武汉中百	27,453.78	2.72
92	002104	航天股份	27,336.16	2.71
93	002261	拓维信息	27,297.67	2.70
94	000983	西山煤电	26,270.18	2.60
95	600583	金地工程	25,871.67	2.57

96	002138	顺络电子	25,499,102.37	2.53
97	000623	吉林敖东	25,390,749.20	2.52
98	000460	顺鑫农业	24,856,732.05	2.46
99	600089	特变电工	24,158,721.35	2.39
100	600410	华神天成	24,072,026.89	2.39
101	000867	盛化东宝	23,987,329.60	2.38
102	000999	华冠三九	23,663,684.05	2.34
103	601111	中国国航	23,533,751.10	2.33

104	600536	中国软件	23,186,017.47	2.30
105	000961	中南建设	22,831,503.00	2.26
106	000933	神火股份	22,797,408.30	2.26
107	600117	西宁特钢	22,547,264.55	2.23
108	000609	华信天成	22,170,012.87	2.20
109	002148	北纬通信	21,853,896.81	2.17
110	600527	江南高纤	21,793,940.00	2.16
111	000977	浪潮信息	21,507,873.26	2.13

112	600521	华海药业	21,138,922.28	2.09
113	600087	长航油运	21,113,307.25	2.09
114	600376	首开股份	20,783,401.20	2.06
115	002355	神州矿业	20,690,365.25	2.05
116	601328	交通银行	20,305,735.40	2.01
117	000878	云南铜业	20,122,129.89	2.00

注：本表的“买入金额”按卖出成交金额，按交易比例以成交数量/现列，不考虑相关交易费用。
8.4.3 买入金额的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本(成交总额)	7,842,797,967.80
卖出股票的收入(成交总额)	6,249,233,735.65

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按美国交金净额(成交金额)减期间利息、不考虑相关费用。

8.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	国债(含央行票据)		

1	国家债券	-	-
2	央行票据	90,222,000.00	3.03
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	-	-
6	可转债	148,914,411.30	5.01
7	其他	-	-

8	期末公允价值占基金资产净值比例大于5%的小计			239,136,411.30	8.04
8.6 期末公允价值占基金资产净值比例大于5%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	126630	铜陵转债	738,846	148,914,411.30	5.01
2	0801044	08荣安44	300,000	30,108,000.00	1.01
3	0801032	08荣安32	300,000	30,078,000.00	1.01

4	0801017	08 丧失 17	300,000	30,036,000	1.01
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				
8.9	本基金报告期内未持有资产支持证券				
8.10	本基金报告期内未持有权证				
8.11	投资组合报告附注				
8.12	本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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				
8.13	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				
8.9.2	期末其他各项资产构成				

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,000,000.00
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	3,428,334.29
5	应收申购款	18,849,984.46
6	其他应收款	

7	待摊费用		
8	其他		
9	合计		24,278,318.75

8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券余额

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5前10名权证中属于在流通股范围内持有的权证情况

本基金本报告期末前十名流通股中不存在流通股受限情况。

8.9.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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 期末基金份额持有人户数及持有人结构		持有人结构			
持有人户数(户)	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
97,078	26,294.76	638,363,680.31	25.01%	1,914,279,009.81	74.99%

项 目	持有份额总额(份)	占基金份额总额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	-	-

注：本基金本报告期末基金管理人从业人员未持有本开放式基金。

910 开放式基金份额变动

	单位：
基金合同生效日(2008年4月23日)基金份额总额	3,173,064,234.06
本报告期初基金份额总额	967,010,645.83
本报告期基金份额总额	3,995,092,724.18

减：本报告期基金总赎回份额	2,409,460,179.89
本报告期基金份额变动总额	
本报告期末基金份额总额	2,552,642,690.12

本报告期内本基金未发生申购、赎回及转入、转出等业务，期间申购赎回中涉及业务份额：

2、如果本报告期间内发生转出业务，则期间赎回份额中包含业务份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 报告期内召开基金份额持有人大会决议

12.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

1.3 报告期内基金管理人及基金重大人事变动：本报告期内基金管理人及基金无重大人事变动。
1.3.9 报告期内基金管理人、基金管理人、基金托管人的办公
1.4 基金本报告期涉及基金管理人、基金管理人、基金托管人的评论。
1.4.1 基金投资策略的改变
1.4.2 基金本报告期涉及基金投资策略未改变。
1.5 为基金设计审计的会计师事务所情况
1.5.1 基金本报告期涉及基金会计师事务所情况
本报告期内基金会计师事务所为北京正业会计师事务所，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今
本报告期内基金会计师事务所为900007。
1.6 管理人、托管人及其他高级管理人员是否发生或存在等情况
1.6.1 基金本报告期涉及基金管理人、托管人及其他高级管理人员是否受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金	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	
东吴证券	2	2,750,952,450.81	19.57%	2,325,329.89	19.79%
华泰联合证券	1	2,138,427,192.67	15.22%	1,737,488.25	14.79%

平安证券	1,438,827,841.51	10.24%	1,223,004.34	10.41%
国元证券	1,346,927,523.91	9.58%	1,144,891.22	9.74%
光大证券	1,300,872,472.15	9.26%	1,056,967.74	8.89%
湖南证券	1,222,280,187.01	8.70%	1,038,936.08	8.94%
中投证券	996,036,411.23	7.09%	846,630.59	7.20%
中债国际	755,022,439.85	5.37%	613,458.62	5.22%
长城证券	684,045,861.04	4.81%	548,812.20	4.67%
华泰证券	575,093,633.40	4.14%	406,401.64	4.23%

中信证券	1	404,401,975.53	2.88%	343,739.32	2.93%
招商证券	1	250,119,837.69	1.78%	212,600.60	1.81%
新时代证券	1	101,875,534.65	0.72%	86,593.13	0.74%
财富证券	1	89,232,338.63	0.63%	75,847.25	0.65%
华泰证券	1	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-

合计	19,104,454,434.698.97	100.00%	11,750,700.877	100.00%
注1：租用证券基金专用交易单元的证券标的和程序				
租用证券基金专用交易单元的证券标的主要包括：证券公司基本信用评级、财务状况、资信情况、经营情况以及证券公司研发能力评价、报告质量、及时性以及准确性；证券公司信息服务评价：客观性、及时性和高性价比。等方面。				
租用证券基金专用交易单元的证券标的，首先根据租用证券基金专用交易单元的证券标的基准库构建考核指标，然后根据考核评分进行租用证券基金专用交易单元的变更情况。				
承租期限自基金专用交易单元交易之日起至到期止。				
本报告期内基金新增交易单元5个，为“浦发、东证资管、国君证券各有1个交易单元，新时代证券2个交易单元”。				
1.2.2.2.除基金租用证券基金专用交易单元外其他证券标的的情况				

金额单位:人民币						
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	20,913,314.20	7.20%	200,000,000.00	100.00%	--	--
华泰联合证券	135,884,225.34	32.07%	--	--	--	--
平安证券	36,955,745.30	8.72%	--	--	--	--
国信证券	58,323,183.20	14.72%	--	--	--	--

光大证券	24,542,098.06	5.79%
渤海证券	45,788,739.10	10.81%
中投证券	—	—
中银国际	48,831,275.05	11.53%
长城证券	—	—
广发证券	32,325,236.30	7.63%
中信证券	—	—
招商证券	10,111,168.50	2.39%

07	新時代證券	-	-	-	-
08	財富證券	-	-	-	-
09	華泰證券	-	-	-	-
10	東海證券	-	-	-	-
11	國泰君安	-	-	-	-
12	合計	423,674,953.55	100.00%	200,000,000.00	100.00%
13	§12 影响投资者决策的其他重要信息				
14	无。				

92 东兴基金管理有限公司
二〇一一年三月三十一日