

东方稳健回报债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2010年第2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：二〇一一年一月

本投资组合报告所载数据截至2010年9月30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	66,599,732.08	4.67
	其中:股票	66,599,732.08	4.67
2	固定收益投资	1,279,723,855.72	89.78
	其中:债券	1,279,723,855.72	89.78
	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:买入返售的买入返售金融资产	--	--
5	银行存款和其他货币资金	10,117,569.54	0.71
6	其他各项资产	68,887,361.35	4.83
7	合计	1,425,328,518.69	100.00

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	--	--
B	采掘业	--	--
C	制造业	63,655,832.08	4.73
CO	食品饮料	11,925.00	0.00
C1	纺织、服装、皮革	18,750.00	0.00
C2	木材、家具	--	--
C3	造纸、印刷	3,325,500.00	0.25
C4	石油、化学、塑胶、塑料	48,590.00	0.00
C5	电子	151,510.00	0.01
C6	金属、非金属	19,300.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	60,080,249.88	4.46
C8	医药、生物制品	--	--
C99	其他制造业	--	--
D	电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E	建筑业	33,030.00	0.00
F	交通运输、仓储业	60,350.00	0.00
G	信息技术业	--	--
H	批发和零售业	--	--
I	金融业	2,779,170.00	0.21
J	房地产业	--	--
K	房地产业	22,350.00	0.00
L	传播与文化产业	--	--
M	综合类	49,000.00	0.00
	合计	66,599,732.08	4.94

3.报告期末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	600115	华工股份	3,341,210	34,614,914.88	2.57
2	600089	特变电工	1,445,830	25,302,025.00	1.88
3	002117	东信软件	115,449	3,325,500.00	0.25
4	601288	农业银行	929,000	2,424,690.00	0.18
5	601818	光大银行	88,000	304,480.00	0.02
6	300124	汇川技术	1,000	94,010.00	0.01
7	601018	宁波波导	17,000	60,350.00	0.00
8	601377	兴业证券	5,000	50,000.00	0.00
9	601718	华信国际	10,000	49,000.00	0.00
10	002414	高盟新材	1,500	41,220.00	0.00

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	599,260,800.00	43.11
2	央行票据	180,298,000.00	13.13
3	金融债券	237,103,000.00	17.60
4	企业债券	177,883,000.00	13.19
5	企业短期融资券	113,380,010.70	8.42
6	可转债	239,082,044.02	17.25
7	其他	--	--
8	合计	1,279,723,855.72	95.02

5.报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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	1001074	10央行国债74	2,000,000	199,700,000.00	14.83
2	110001	央行票据17	1,162,440	122,358,434.00	9.08
3	1001060	10央行国债60	1,200,000	119,888,000.00	8.90
4	0801014	08央行国债14	700,000	70,581,000.00	5.24
5	080220	08国债20	700,000	69,566,000.00	5.17

6.报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

8.本基金报告期内没有持有资产支持证券。

9.本基金报告期内没有持有股指期货合约。

10.本基金报告期内没有持有国债期货合约。

11.本基金报告期内没有持有远期合约。

12.本基金报告期内没有持有结构性理财产品。

13.本基金报告期内没有持有贵金属。

14.本基金报告期内没有持有大宗商品。

15.本基金报告期内没有持有其他衍生品。

16.本基金报告期内没有持有其他资产。

17.本基金报告期内没有持有其他资产。

18.本基金报告期内没有持有其他资产。

19.本基金报告期内没有持有其他资产。

20.本基金报告期内没有持有其他资产。

21.本基金报告期内没有持有其他资产。

22.本基金报告期内没有持有其他资产。

23.本基金报告期内没有持有其他资产。

24.本基金报告期内没有持有其他资产。

25.本基金报告期内没有持有其他资产。

26.本基金报告期内没有持有其他资产。

27.本基金报告期内没有持有其他资产。

28.本基金报告期内没有持有其他资产。

29.本基金报告期内没有持有其他资产。

30.本基金报告期内没有持有其他资产。

31.本基金报告期内没有持有其他资产。

32.本基金报告期内没有持有其他资产。

33.本基金报告期内没有持有其他资产。

34.本基金报告期内没有持有其他资产。

35.本基金报告期内没有持有其他资产。

36.本基金报告期内没有持有其他资产。

37.本基金报告期内没有持有其他资产。

38.本基金报告期内没有持有其他资产。

39.本基金报告期内没有持有其他资产。

40.本基金报告期内没有持有其他资产。

41.本基金报告期内没有持有其他资产。

42.本基金报告期内没有持有其他资产。

43.本基金报告期内没有持有其他资产。

44.本基金报告期内没有持有其他资产。

45.本基金报告期内没有持有其他资产。

46.本基金报告期内没有持有其他资产。

47.本基金报告期内没有持有其他资产。

48.本基金报告期内没有持有其他资产。

49.本基金报告期内没有持有其他资产。

50.本基金报告期内没有持有其他资产。

51.本基金报告期内没有持有其他资产。

52.本基金报告期内没有持有其他资产。

53.本基金报告期内没有持有其他资产。

54.本基金报告期内没有持有其他资产。

55.本基金报告期内没有持有其他资产。

56.本基金报告期内没有持有其他资产。

57.本基金报告期内没有持有其他资产。

58.本基金报告期内没有持有其他资产。

59.本基金报告期内没有持有其他资产。

60.本基金报告期内没有持有其他资产。

61.本基金报告期内没有持有其他资产。

62.本基金报告期内没有持有其他资产。

63.本基金报告期内没有持有其他资产。

64.本基金报告期内没有持有其他资产。

65.本基金报告期内没有持有其他资产。

66.本基金报告期内没有持有其他资产。

67.本基金报告期内没有持有其他资产。

68.本基金报告期内没有持有其他资产。

69.本基金报告期内没有持有其他资产。

70.本基金报告期内没有持有其他资产。

71.本基金报告期内没有持有其他资产。

72.本基金报告期内没有持有其他资产。

73.本基金报告期内没有持有其他资产。

74.本基金报告期内没有持有其他资产。

75.本基金报告期内没有持有其他资产。

76.本基金报告期内没有持有其他资产。

77.本基金报告期内没有持有其他资产。

78.本基金报告期内没有持有其他资产。

79.本基金报告期内没有持有其他资产。

80.本基金报告期内没有持有其他资产。

81.本基金报告期内没有持有其他资产。

82.本基金报告期内没有持有其他资产。

83.本基金报告期内没有持有其他资产。

84.本基金报告期内没有持有其他资产。

85.本基金报告期内没有持有其他资产。

86.本基金报告期内没有持有其他资产。

87.本基金报告期内没有持有其他资产。

88.本基金报告期内没有持有其他资产。

89.本基金报告期内没有持有其他资产。

90.本基金报告期内没有持有其他资产。

91.本基金报告期内没有持有其他资产。

92.本基金报告期内没有持有其他资产。

93.本基金报告期内没有持有其他资产。

94.本基金报告期内没有持有其他资产。

95.本基金报告期内没有持有其他资产。

96.本基金报告期内没有持有其他资产。

97.本基金报告期内没有持有其他资产。

98.本基金报告期内没有持有其他资产。

99.本基金报告期内没有持有其他资产。

100.本基金报告期内没有持有其他资产。

101.本基金报告期内没有持有其他资产。

102.本基金报告期内没有持有其他资产。

103.本基金报告期内没有持有其他资产。

104.本基金报告期内没有持有其他资产。

105.本基金报告期内没有持有其他资产。

106.本基金报告期内没有持有其他资产。

107.本基金报告期内没有持有其他资产。

108.本基金报告期内没有持有其他资产。

109.本基金报告期内没有持有其他资产。

110.本基金报告期内没有持有其他资产。

111.本基金报告期内没有持有其他资产。

112.本基金报告期内没有持有其他资产。

113.本基金报告期内没有持有其他资产。

114.本基金报告期内没有持有其他资产。

115.本基金报告期内没有持有其他资产。

116.本基金报告期内没有持有其他资产。

117.本基金报告期内没有持有其他资产。

118.本基金报告期内没有持有其他资产。

119.本基金报告期内没有持有其他资产。

120.本基金报告期内没有持有其他资产。

121.本基金报告期内没有持有其他资产。

122.本基金报告期内没有持有其他资产。

123.本基金报告期内没有持有其他资产。

124.本基金报告期内没有持有其他资产。

125.本基金报告期内没有持有其他资产。

126.本基金报告期内没有持有其他资产。

127.本基金报告期内没有持有其他资产。

128.本基金报告期内没有持有其他资产。

129.本基金报告期内没有持有其他资产。

130.本基金报告期内没有持有其他资产。

131.本基金报告期内没有持有其他资产。

132.本基金报告期内没有持有其他资产。

133.本基金报告期内没有持有其他资产。

134.本基金报告期内没有持有其他资产。

135.本基金报告期内没有持有其他资产。

136.本基金报告期内没有持有其他资产。

137.本基金报告期内没有持有其他资产。

138.本基金报告期内没有持有其他资产。

139.本基金报告期内没有持有其他资产。

140.本基金报告期内没有持有其他资产。

141.本基金报告期内没有持有其他资产。

142.本基金报告期内没有持有其他资产。

143.本基金报告期内没有持有其他资产。

144.本基金报告期内没有持有其他资产。

145.本基金报告期内没有持有其他资产。

146.本基金报告期内没有持有其他资产。

147.本基金报告期内没有持有其他资产。

148.本基金报告期内没有持有其他资产。

149.本基金报告期内没有持有其他资产。

150.本基金报告期内没有持有其他资产。

151.本基金报告期内没有持有其他资产。

152.本基金报告期内没有持有其他资产。

153.本基金报告期内没有持有其他资产。

154.本基金报告期内没有持有其他资产。

155.本基金报告期内没有持有其他资产。

156.本基金报告期内没有持有其他资产。

157.本基金报告期内没有持有其他资产。

158.本基金报告期内没有持有其他资产。

159.本基金报告期内没有持有其他资产。

160.本基金报告期内没有持有其他资产。

161.本基金报告期内没有持有其他资产。

162.本基金报告期内没有持有其他资产。

163.本基金报告期内没有持有其他资产。

164.本基金报告期内没有持有其他资产。

165.本基金报告期内没有持有其他资产。

166.本基金报告期内没有持有其他资产。

167.本基金报告期内没有持有其他资产。

168.本基金报告期内没有持有其他资产。

169.本基金报告期内没有持有其他资产。

170.本基金报告期内没有持有其他资产。

171.本基金报告期内没有持有其他资产。

172.本基金报告期内没有持有其他资产。

173.本基金报告期内没有持有其他资产。

174.本基金报告期内没有持有其他资产。

175.本基金报告期内没有持有其他资产。

176.本基金报告期内没有持有其他资产。

177.本基金报告期内没有持有其他资产。

178.本基金报告期内没有持有其他资产。