东吴优信稳健债券型证券投资基金
2010 年年度报告
2010 年 12 月 31 日

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）根据本基金合同规定,于 2011 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 4
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
6.1 管理层对财务报表的责任 15
6.2 注册会计师的责任 16
6.3 审计意见 16
§7 年度财务报表 16
7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
7.4 报表附注 20
§8 投资组合报告 43
8.1 期末基金资产组合情况 43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 47
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 47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 47
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 47

8.9 投资组合报告附注.....47
§9 基金份额持有人信息.....48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....49
§10 开放式基金份额变动.....49
§11 重大事件揭示.....49
11.1 基金份额持有人大会决议.....49
11.2 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.....50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....50
11.4 基金投资策略的改变.....50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....50
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....50
11.8 其他重大事件.....51
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....54
§13 备查文件目录.....55
13.1 备查文件目录.....55
13.2 存放地点.....55
13.3 查阅方式.....55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴优信稳健债券型证券投资基金	
基金简称	东吴优信稳健债券	
基金主代码	582001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 11 月 5 日	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	94,612,119.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C
下属分级基金的交易代码	582001	582201
报告期末下属分级基金的份额总额	62,190,045.57 份	32,422,074.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于债券型基金，在控制风险和保持资产流动性的前提下，在精选高信用等级债券基础上通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。
投资策略	本基金是一只债券型基金，以债券投资为主，股票投资为辅的原则构建和管理投资组合。对于债券投资，本基金通过对利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的分析，确定本基金债券组合久期和期限结构配置。债券选择上，本基金根据债券信用风险特征、到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析，并考虑债券流动性和操作策略，选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为债券投资的有益补充，主要采取自下而上的策略精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。
业绩比较基准	中信标普全债指数
风险收益特征	本基金主要投资于高信用级别、投资价值高的债券资产，属证券投资基金中的低风险品种，长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东吴基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄忠平	尹东
	联系电话	021-50509888-8219	010-67595003

	电子邮箱	huangzhp@scfund.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		021-50509666	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853
注册地址		上海浦东源深路279号	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海浦东源深路279号	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		徐建平	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	江苏公证天业会计师事务所有限公司	江苏省苏州市新市路130号
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海市浦东源深路279号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年		2009 年		2008 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日	
	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C
本期已实现收益	3,249,097.68	-160,507.53	23,301,449.13	-344,988.64	7,003,914.36	-
本期利润	2,027,341.39	-930,590.76	-5,653,287.93	183,993.44	37,318,820.18	-
加权平均基金份额本期利润	0.0279	-0.0215	-0.0110	0.0026	0.0247	-
本期加权平均净值利润率	2.74%	-2.14%	-1.08%	0.26%	2.44%	-
本期基金份	3.58%	3.14%	0.27%	0.28%	2.44%	-

额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	**2010 年末**		**2009 年末**		**2008 年末**	
	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C
期末可供分配利润	3,194,343.02	1,441,118.88	1,177,166.66	1,000,832.56	7,254,933.38	-
期末可供分配基金份额利润	0.0514	0.0444	0.0102	0.0077	0.0046	-
期末基金资产净值	65,384,388.59	33,863,193.23	117,678,960.69	132,246,571.54	1,624,447,060.09	-
期末基金份额净值	1.0514	1.0444	1.0151	1.0126	1.0244	-
3.1.3 累计期末指标	**2010 年末**		**2009 年末**		**2008 年末**	
	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C
基金份额累计净值增长率	6.39%	3.43%	2.71%	0.28%	2.44%	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上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，例如基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金于 2008 年 11 月 5 日成立。经中国证监会批准，于 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类，2009 年的指标计算期东吴优信稳健债券 A 为 2009 年 1 月 1 日-2009 年 12 月 31 日；东吴优信稳健债券 C 为 2009 年 6 月 15 日-2009 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

东吴优信稳健债券 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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

过去三个月	0.38%	0.55%	-1.77%	0.10%	2.15%	0.45%
过去六个月	6.64%	0.43%	-0.92%	0.08%	7.56%	0.35%
过去一年	3.58%	0.37%	2.00%	0.07%	1.58%	0.30%
自基金合同生效起至今	6.39%	0.29%	4.57%	0.07%	1.82%	0.22%

注：1.比较基准=中信标普全债指数。

2.本基金于 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类。

东吴优信稳健债券 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	0.28%	0.55%	-1.77%	0.10%	2.05%	0.45%
过去六个月	6.42%	0.43%	-0.92%	0.08%	7.34%	0.35%
过去一年	3.14%	0.37%	2.00%	0.07%	1.14%	0.30%
自基金合同生效起至今	3.43%	0.33%	1.81%	0.06%	1.62%	0.27%

注：1.比较基准=中信标普全债指数。

2.本基金于 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东吴优信稳健债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

东吴优信稳健债券 A

（2008 年 11 月 5 日至 2010 年 12 月 31 日）

东吴优信稳健债券 C

（2009 年 6 月 15 日至 2010 年 12 月 31 日）

注：1.比较基准=中信标普全债指数。

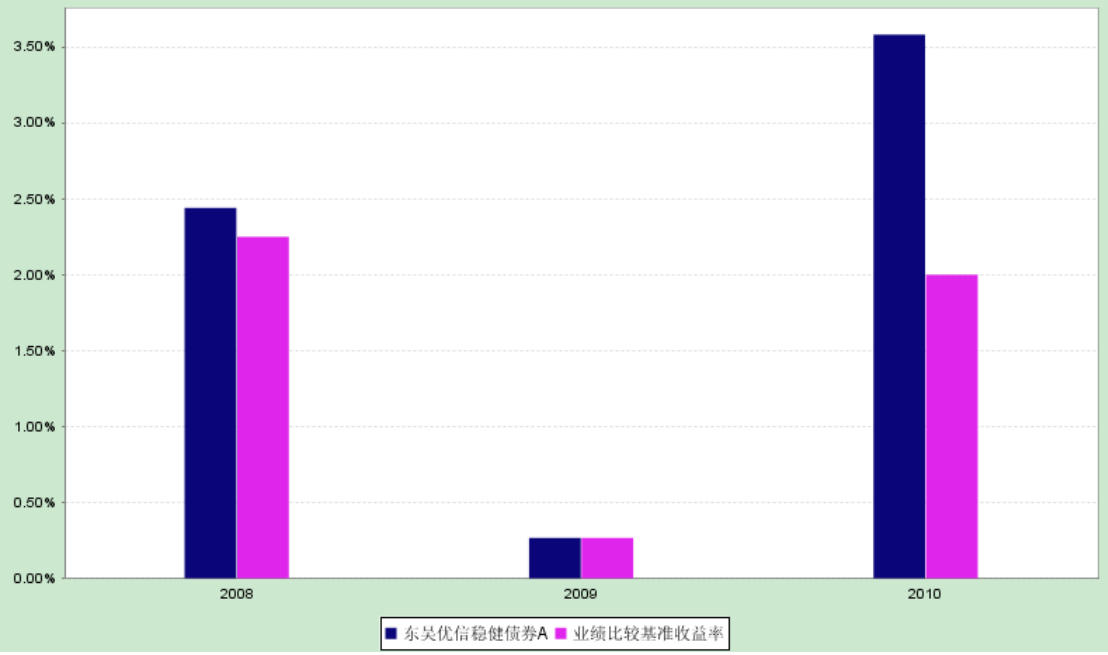
2.经中国证监会批准，本基金于 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类，具体内容详见本基金管理人于 2009 年 6 月 11 日刊登的《关于东吴优信稳健债券型证券投资基金增加 C 类收费模式并修改基金合同的公告》。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴优信稳健债券型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

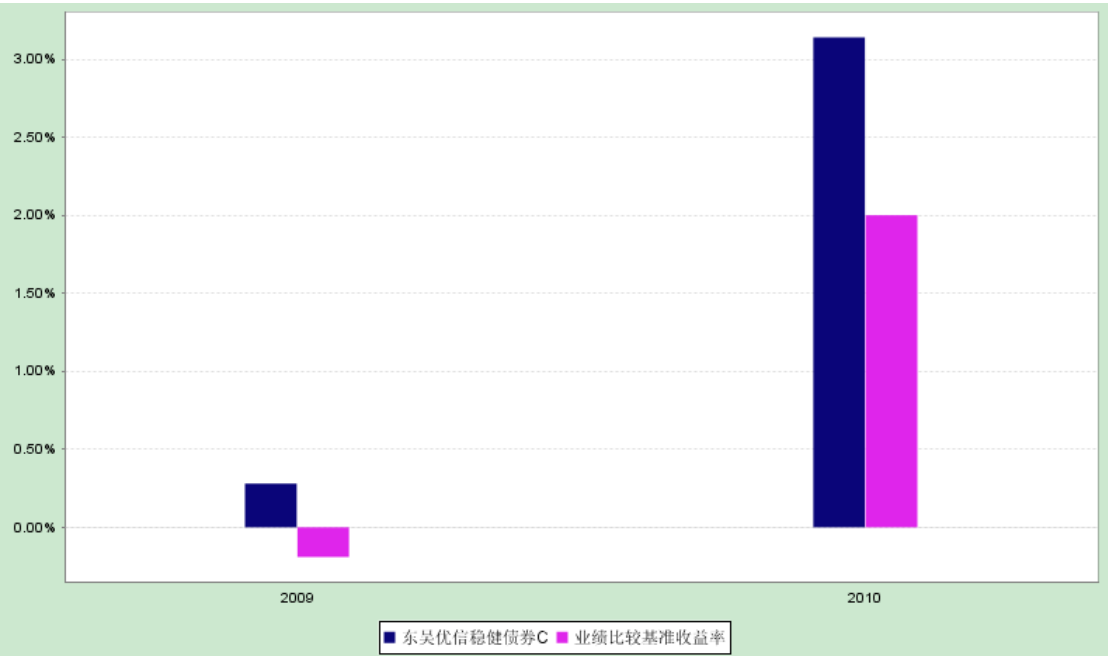
东吴优信稳健债券 A



注：1、本基金于 2008 年 11 月 5 日成立。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、经中国证监会批准，本基金于 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类，

东吴优信稳健债券 C



注：1、经中国证监会批准，本基金于 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类，

2、2009 年度按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、东吴优信稳健债券 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010 年	-	-	-	-	-
2009 年	0.120	2,992,131.31	996,067.75	3,988,199.06	-
2008 年	-	-	-	-	-
合计	0.120	2,992,131.31	996,067.75	3,988,199.06	-

2、东吴优信稳健债券 C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010 年	-	-	-	-	-
2009 年	0.120	729,618.93	-	729,618.93	-
合计	0.120	729,618.93	-	729,618.93	-

注：本基金于 2008 年 11 月 5 日成立，自 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东吴基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字【2003】82 号批准设立的证券投资基金管理公司，于 2004 年 9 月正式成立，注册资本人民币 1 亿元，由东吴证券股份有限公司、上海兰生（集团）有限公司、江阴澄星实业集团有限公司共同发起设立，分别持有 49%、30%、21%的股份。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有铮、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”的远大理想，创造性地树立公司独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金管理人旗下共管理基金 8 只，其中混合型基金 2 只，

分别为东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金；股票型基金 4 只，分别为东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、东吴新经济股票型证券投资基金、东吴新创业股票型证券投资基金；债券型基金 1 只，为东吴优信稳健债券型证券投资基金；货币型基金 1 只，为东吴货币市场证券投资基金。

2010 年度，公司旗下基金业绩表现位居同业前列，这是继 07、08 年之后，公司基金业绩再次脱颖而出。银河证券统计数据显示，截至 2010 年 12 月 31 日，东吴基金旗下权益类投资产品排名全部在同类产品中名列前茅。在上证综指全年下跌 14.31%的环境下，东吴旗下股票型、混合型基金均实现 10%以上收益，旗下 3/4 产品挺进同类业绩前 10 位。其中，东吴双动力、东吴行业轮动分别以 23%、19.05%的年净值增长率，在标准股票型基金中排名第 6、第 13 位；东吴嘉禾优势全年净值增长率为 17.88%，在混合偏股型基金中排名第 8；东吴进取策略则以全年 21.24%的净值增长率高居灵活配置型基金榜眼之位。在优秀业绩驱动下，东吴基金 2010 年资产管理规模上升近一倍，总规模排名上升 7 名。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐嵩	本基金的基金经理	2008-11-05	-	7 年	工学学士，历任平安信托投资责任有限公司资产管理部交易员，平安保险资产营运中心银行间交易员，上投摩根基金管理有限公司基金经理助理。2008 年 3 月加入东吴基金，现担任东吴优信基金经理。
韦勇	本基金的基金经理	2009-12-23	-	15 年	香港公开大学 MBA 毕业，曾任贵州证券有限责任公司交易经理、汉唐证券有限责任公司投资经理、恒泰证券股份有限公司投资经理等职。2009 年 6 月加入东吴基金，现担任东吴优信债券、东吴货币基金经理。

注：1、徐嵩为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；其它日期均为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资决策、研究分析、投资授权、交易执行、业绩评估等环节严格把关，不断完善公平交易程序及投资、研究、交易等相关业务流程，确保了公平对待旗下不同投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年经济形势较为复杂，从年初的通胀预期到年中的经济二次探底预期，再到下半年政策放松带来的经济向好预期，期间美联储的二次量化宽松成为全球焦点，使得全球流动性充裕局面仍然持续，直至年底对通胀水平的不断上调，使得 2010 年整年的经济形势较为复杂。由于对 10 年上半年宏观经济较为乐观，加之通货膨胀上半年也是向上趋势，2010 年初我们加大了权益部分的投资力度，而债券投资方面则较为谨慎，并未充分享受到信用债市场上涨所带来的收益，权益部分投资也并不理想，我们进行了深刻的总结与反思，下半年由于海外超预期的宽松政策，使得我们对国内经济预期更为乐观，加之通胀压力一直较大，未来一段时间内中国经济将很可能出现高增长和较高通胀的局面，我们逐步缩短了债券久期，同时由于对经济基本面和资金面的逐步乐观，我们加大了对转债品种以及权益类资产的配置

力度，取得了较好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，东吴优信稳健债券 A 份额净值为 1.0514 元，累计净值 1.0634 元；本报告期份额净值增长率 3.58%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%；东吴优信稳健债券 C 份额净值为 1.0444 元，累计净值 1.0564 元；本报告期份额净值增长率 3.14%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年经济环比增速预计将前低后高，1 季度通胀水平维持高位，为对抗通胀央行预计将持续使用上调准备金率等数量调控手段并辅以利率调控，债券收益率预计将维持向上趋势不变，但由于整体资金面短期仍将维持宽裕局面，收缩的政策面以及充裕的资金面很可能使得债券市场收益率震荡上行，这也说明债券市场仍有结构性机会，最大的变数是通胀预期的变化，这也将会成为市场关注的焦点。

预计 11 年债券市场短期内难有趋势性的机会，但仍然存在阶段性以及超调后的投资机会，浮动债及票息较高的信用债仍将是首选，而转债市场也将有个券的机会。我们将维持谨慎的态度，密切关注经济数据的各项变化,并随之及时调整投资策略。与此同时将根据宏观经济情况在控制资产风险的情况下，适度参与转债和股票市场，力争为投资者创造持续、稳定地回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在完善公司治理结构、内部控制制度和流程体系的同时，从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，进一步健全了风险控制和监察稽核机制；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，采取实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况,推动内部控制机制的完善与优化。发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察重点开展的工作包括：

（1）根据基金监管法律法规的变化，公司进一步修订完善了相关规章制度及业务流程，促进公司规范化经营，有效防范和化解风险。

（2）加强合规监察力度。根据公司年度监察稽核工作计划的安排，对公司各项业务的合规性和内部管理制度及流程的执行情况进行定期与不定期地监察及提示。

（3）促进合规文化建设。2010 年对公司员工开展了较全面的业务培训，邀请公司法律顾问为员工进行专题合规培训，以加强基金从业人员对法规的认识，提升合规意识，有利于公司长远稳定地发展。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总裁、投资总监、运营总监、基金会计、金融工程人员、监察稽核人员组成，同时，督察长、相关基金经理、总裁指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；运营总监、基金会计等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、监察稽核业务相关人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，发表意见和建议，与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；公司现没有进行任何定价服务的约定。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

苏公 W[2011]A247 号

东吴优信稳健债券型基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的东吴优信稳健债券型基金（以下简称“优信基金”）财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表是优信基金的基金管理人东吴基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；(2)选择

和运用恰当的会计政策；(3)作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为, 优信基金财务报表已经按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制,在所有重大方面公允反映了优信基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和所有者权益（基金净值）变动分配情况。

江苏公证天业会计师事务所有限公司　　中国注册会计师

叶水林

中国注册会计师

中国·无锡　　吕卫星

二〇一一年三月十日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东吴优信稳健债券型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	11,109,398.92	41,765,873.13
结算备付金		366,578.62	214,165.40
存出保证金		255,821.00	357,835.22
交易性金融资产	7.4.7.2	95,929,249.03	242,417,766.84
其中：股票投资		15,473,614.00	38,284,513.04
基金投资		-	-
债券投资		80,455,635.03	204,133,253.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,051,463.23	-
应收利息	7.4.7.5	518,586.22	710,611.38
应收股利		-	-
应收申购款		23,723.08	10,000,099.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		113,254,820.10	295,466,351.33
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2010年12月31日**	**上年度末 2009年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		9,499,785.75	-
应付证券清算款		3,340,248.26	13,806,939.41
应付赎回款		606,486.14	30,904,286.85
应付管理人报酬		49,802.08	161,024.94
应付托管费		15,323.73	49,546.14
应付销售服务费		8,320.12	22,269.66
应付交易费用	7.4.7.7	214.25	155,136.05
应交税费		32,200.00	-

应付利息		12,125.60	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	442,732.35	441,616.05
负债合计		14,007,238.28	45,540,819.10
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	94,612,119.92	246,528,618.33
未分配利润	7.4.7.10	4,635,461.90	3,396,913.90
所有者权益合计		99,247,581.82	249,925,532.23
负债和所有者权益总计		113,254,820.10	295,466,351.33

注：本基金为分级基金，报告截止日 2010 年 12 月 31 日，份额总额为 94,612,119.92 份，其中东吴优信稳健债券 A 基金份额净值 1.0514 元，基金份额总额 62,190,045.57 份；东吴优信稳健债券 C 基金份额净值 1.0444 元，基金份额总额 32,422,074.35 份。

7.2 利润表

会计主体：东吴优信稳健债券型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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		**3,141,151.79**	**1,641,753.68**
1.利息收入		2,021,296.92	18,375,037.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	61,405.74	391,953.92
债券利息收入		1,955,552.99	17,983,083.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,338.19	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,088,534.60	11,281,740.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	480,409.79	-659,109.65
债券投资收益	7.4.7.13	2,598,674.99	11,694,600.83
基金投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	169,478.86
股利收益	7.4.7.15	9,449.82	76,770.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,991,839.52	-28,425,754.98
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	23,159.79	410,731.03
减：二、费用		**2,044,401.16**	**7,111,048.17**
1．管理人报酬		771,034.69	3,771,580.48
2．托管费		237,241.39	1,160,486.35
3．销售服务费		177,299.06	155,532.14
4．交易费用	7.4.7.18	562,753.65	1,077,124.71
5．利息支出		78,660.08	728,668.69
其中：卖出回购金融资产支出		78,660.08	728,668.69
6．其他费用	7.4.7.19	217,412.29	217,655.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**1,096,750.63**	**-5,469,294.49**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		1,096,750.63	-5,469,294.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴优信稳健债券型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

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）	246,528,618.33	3,396,913.90	249,925,532.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,096,750.63	1,096,750.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-151,916,498.41	141,797.37	-151,774,701.04
其中：1.基金申购款	76,922,806.97	3,357,662.91	80,280,469.88
2.基金赎回款	-228,839,305.38	-3,215,865.54	-232,055,170.92
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	94,612,119.92	4,635,461.90	99,247,581.82
项目	**上年度可比期间** 2009年1月1日至2009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）	1,585,781,017.32	38,666,042.77	1,624,447,060.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,469,294.49	-5,469,294.49

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,339,252,398.99	-25,082,016.39	-1,364,334,415.38
其中：1. 基金申购款	382,577,278.15	5,848,877.73	388,426,155.88
2. 基金赎回款	-1,721,829,677.14	-30,930,894.12	-1,752,760,571.26
四、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）	-	-4,717,817.99	-4,717,817.99
五、期末所有者权益（基金净值）	246,528,618.33	3,396,913.90	249,925,532.23

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：徐建平，主管会计工作负责人：黄忠平，会计机构负责人：金婕

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东吴优信稳健债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1048 号文《关于核准东吴优信稳健债券型证券投资基金募集的批复》的核准向社会公开发行募集，募集期为 2008 年 10 月 6 日至 2008 年 10 月 31 日。经江苏公证天业会计师事务所有限公司验资，首次募集的净认购金额为 1,481,291,890.04 人民币元，利息为 439,198.30 人民币元，首次募集有效认购户数为 8722 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本息合计募集基金份额总额为 1,481,731,088.34 份。经向中国证监会备案，本基金合同于 2008 年 11 月 5 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益品种，债券投资比例为 80%-95%，股票投资比例为 0%-20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准=中信标普全债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则——基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、《东吴优信稳健债券型证券投资基金基金合同》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金声明：本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况，经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告编制期间为 2010 年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计

入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实

现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于确认当日全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)由于本基金的 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(2)收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配十二次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；

(4)若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5)本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7) 基金当期收益应先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(8)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2)重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自 2009 年 6 月 16 日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局批准，自 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税率，对出让方按 0.1%的税率征收，对受让方不再征税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税，基金向个人投资者分配股息、红利、利息时，不再代扣个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50％计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	11,109,398.92	41,765,873.13
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	11,109,398.92	41,765,873.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		15,432,565.35	15,473,614.00	41,048.65
债券	交易所市场	65,542,582.36	65,465,635.03	-76,947.33
	银行间市场	15,056,790.00	14,990,000.00	-66,790.00
	合计	80,599,372.36	80,455,635.03	-143,737.33
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		96,031,937.71	95,929,249.03	-102,688.68
项目		上年度末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		36,875,055.56	38,284,513.04	1,409,457.48
债券	交易所市场	23,435,018.39	24,101,753.80	666,735.41
	银行间市场	180,218,542.05	180,031,500.00	-187,042.05
	合计	203,653,560.44	204,133,253.80	479,693.36
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		240,528,616.00	242,417,766.84	1,889,150.84

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年末未持有衍生金融资产、负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	2,342.58	6,624.65
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	141.13	82.50
应收债券利息	514,890.65	700,301.90
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	1,211.86	3,602.33
其他	-	-
合计	518,586.22	710,611.38

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年末无其他资产

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	151,683.55
银行间市场应付交易费用	214.25	3,452.50
合计	214.25	155,136.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	2,732.35	11,616.05
预提审计费	90,000.00	80,000.00
预提信息披露费	100,000.00	100,000.00
合计	442,732.35	441,616.05

7.4.7.9 实收基金

东吴优信稳健债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	115,925,535.33	115,925,535.33
本期申购	39,137,598.50	39,137,598.50
本期赎回（以“-”号填列）	-92,873,088.26	-92,873,088.26
本期末	62,190,045.57	62,190,045.57

东吴优信稳健债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	130,603,083.00	130,603,083.00
本期申购	37,785,208.47	37,785,208.47
本期赎回（以“-”号填列）	-135,966,217.12	-135,966,217.12
本期末	32,422,074.35	32,422,074.35

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

7.4.7.10 未分配利润

东吴优信稳健债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,177,166.66	576,258.70	1,753,425.36
本期利润	3,249,097.68	-1,221,756.29	2,027,341.39
本期基金份额交易产生的变动数	-706,969.47	120,545.74	-586,423.73
其中：基金申购款	1,149,833.77	511,396.60	1,661,230.37
基金赎回款	-1,856,803.24	-390,850.86	-2,247,654.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,719,294.87	-524,951.85	3,194,343.02

东吴优信稳健债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,000,832.56	642,655.98	1,643,488.54
本期利润	-160,507.53	-770,083.23	-930,590.76
本期基金份额交易产生的	873,978.39	-145,757.29	728,221.10

变动数			
其中：基金申购款	1,455,540.96	240,891.58	1,696,432.54
基金赎回款	-581,562.57	-386,648.87	-968,211.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,714,303.42	-273,184.54	1,441,118.88

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

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
活期存款利息收入	54,295.71	370,049.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,772.44	7,641.48
其他	3,337.59	14,263.19
合计	61,405.74	391,953.92

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

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
卖出股票成交总额	188,108,329.09	331,727,218.67
减：卖出股票成本总额	187,627,919.30	332,386,328.32
买卖股票差价收入	480,409.79	-659,109.65

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	486,477,416.40	3,166,193,238.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	481,071,670.79	3,104,543,444.97
减：应收利息总额	2,807,070.62	49,955,192.88
债券投资收益	2,598,674.99	11,694,600.83

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

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

卖出权证成交总额	-	469,161.82
减：卖出权证成本总额	-	299,682.96
买卖权证差价收入	-	169,478.86

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

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
股票投资产生的股利收益	9,449.82	76,770.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,449.82	76,770.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-1,991,839.52	-28,425,754.98
——股票投资	-1,368,408.83	1,409,457.48
——债券投资	-623,430.69	-29,835,212.46
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,991,839.52	-28,425,754.98

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

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
基金赎回费收入	19,251.62	404,939.12
转换费	3,908.17	5,791.91
合计	23,159.79	410,731.03

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

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
交易所市场交易费用	559,153.65	1,051,399.71
银行间市场交易费用	3,600.00	25,725.00
合计	562,753.65	1,077,124.71

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

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
审计费用	90,000.00	80,000.00
信息披露费	100,000.00	92,171.57
银行汇划费用	9,052.29	30,484.23
帐户维护费	18,000.00	15,000.00
其他	360.00	-
合计	217,412.29	217,655.80

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东吴证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海兰生（集团）有限公司	基金管理人的股东
江阴澄星实业集团有限公司	基金管理人的股东

注：本报告期基金关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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		上年度可比期间 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	349,626,910.38	100.00%	697,968,326.61	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

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		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	469,161.82	100.00%

7.4.10.1.3 债券交易

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		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	611,740,014.47	95.87%	500,672,226.68	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

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		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	32,100,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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			
	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	293,040.66	100.00%	-	-
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
东吴证券股份有限公司	581,053.81	100.00%	151,683.55	100.00%

注：股票交易佣金为成交金额的 1‰扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、买（卖）证管费等）；证券公司不向本基金收取国债现券及国债回购和企业债券的交易佣金，但交易的经手费和证管费由本基金交纳。佣金的比率是公允的，符合证监会有关

规定。管理人因此从关联方获得的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的管理费	771,034.69	3,771,580.48
其中：支付销售机构的客户维护费	48,016.02	235,641.25

注：支付基金管理人东吴基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.65% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	237,241.39	1,160,486.35

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C	合计
东吴基金管理有限公司	-	156,503.85	156,503.85
中国建设银行股份有限公司	-	13,799.83	13,799.83
东吴证券股份有限公司	-	244.62	244.62

合计	-	170,548.30	170,548.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C	合计
东吴基金管理有限公司	-	146,094.52	146,094.52
中国建设银行股份有限公司	-	4,754.71	4,754.71
东吴证券股份有限公司	-	1,510.44	1,510.44
合计	-	152,359.67	152,359.67

注：本基金自 2009 月 6 月 15 日实施 A、C 分类，其中 A 类不收取销售服务费，C 类收取销售服务费。C 类销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X0.4%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	-	60,475,639.63	-	-	5,000,000.00	1,536.07
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	40,414,916.56	26,103,537.20	-	-	1,838,000,000.00	380,916.53

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：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	
	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C	东吴优信稳健债券A	东吴优信稳健债券C
期初持有的基金份额	-	-	-	-

期间申购/买入总份额	7,915,099.94	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	7,915,099.94	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.73%	-	-	-

注：1、本关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

2、本基金于 2008 年 11 月 5 日成立，自 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

东吴优信稳健债券 A

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未持有本基金份额。

东吴优信稳健债券 C

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未持有本基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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		上年度可比期间 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
中国建设银行股份有限公司	11,109,398.92	54,295.71	41,765,873.13	370,049.25

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发等流通受限股票。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,499,785.75 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
080223	08 国开 23	2011-01-05	98.66	50,000	4,933,000.00
090407	09 农发 07	2011-01-05	101.02	50,000	5,051,000.00
合计		-	-	100,000	9,984,000.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种以及部分股票、权证等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。利率风险是本基金市场风险的重要组成部分。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险和保持资产流动性的前提下，精选高信用等级债券,通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。

本基金投资目标为通过对利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的分析，确定本基金债券组合久期和期限结构配置。债券选择上，本基金根据债券信用风险特征、到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析，并考虑债券流动性和操作策略，选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为债券投资的有益补充，主要采取自下而上的策略精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。

本基金管理人根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的三级风险控制组织体系。董事会层面主要负责公司的风险管理战略和控制政策等事项；公司经营管理层下设投资决策委员会、风险管理委员会和监察稽核部对经营风险进行预防和控制,制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他应收类款项。报告期内，本基金持有的金融资产均未发生逾期与减值的情况。

对于与债券投资的信用风险，本基金管理人的投资部门及交易部门建立了经审批的交易对手名单，并通过限定被投资对象的信用等级范围及各类投资品种比例上来管理信用风险。报告期末，本基金所持债券为央票、金融债，以及占基金净资产比例较低的企业债和公司债，信用风险程度极低。

本基金的银行存款存放于本基金的托管行－中国建设银行股份有限公司。本基金认为与中国建设银行股份有限公司相关的信用风险程度较低。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金与应收证券清算款相关的信用风险程度较低。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。作为开放式基金，存在兑付赎回资金的流动性风险。本基金流动风险亦来源于因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

本基金报告期末持仓组合平均流通股本略低于 A 股市场平均流通股本。与此同时，基金持仓组合的换手率为 1.89%（剔除未上市流通股）。总体上看，持仓组合投资对象流动性较好。另外，本基金持仓市值占本基金组合流通市值和 A 股市场流通市值比例分别为 0.002%和 0.0001%，比例很低，对市场冲击有限。根据以上流动性指标判断，本基金流动性风险很低。本基金管理人通过对投资品种的流动性指标监控来评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。本基金管理人通过基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

表1　东吴优信基金持仓组合流动性结果表

日期	平均流通股本（亿股）	A股平均流通股本（亿股）	持仓组合日均换手率	持仓市值占组合流通市值比	占A股市场流通市值比例

				例	
2010.12.31	54.46	9.39	1.89%	0.002%	0．0001%

注：数据来源为根据 Wind 系统计算得到。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

从风险表现看，报告期内东吴优信 A 日标准差为 0.37%，同期基金基准为 0.07%，衡量系统风险的 Beta 系数为 1.69。在报告期内，东吴优信 A 风险略高于基金基准。

从经总体风险调整后收益表现看，东吴优信 A Sharpe 比率为 0.33，同期基金基准为 0.32，东吴优信 A 基金的 Sharpe 比率高于基金基准。

表2　东吴优信A 2010年风险指标

	东吴优信A基金	基金基准
日标准差	0.37%	0.07%
Beta	1.69	
Sharpe Ratio	0.33	0.32

注：比较基准=中信标普全债指数。

从 VAR 风险指标来看，采用历史模拟法计算基金的 VAR，样本为报告期间东吴优信 A 基金单位净值的日收益率，样本容量为 242。报告期末不同置信水平下基金的 VAR 为：

90%的置信水平　　VAR 值为 0.41%；

95%的置信水平　　VAR 值为 0.57%；

99%的置信水平　　VAR 值为 0.84%。

从风险表现看，报告期内东吴优信 C 日标准差为 0.37%，同期基金基准为 0.07%，衡量系统风险的 Beta 系数为 1.68。在报告期内，东吴优信 C 风险略高于基金基准。

从经总体风险调整后收益表现看，东吴优信 C Sharpe 比率为 0.25，同期基金基准为 0.32，东吴优信 C 基金的 Sharpe 比率低于基金基准。

表3　东吴优信C 2010年风险指标

	东吴优信C基金	基金基准
日标准差	0.37%	0.07%
Beta	1.68	

Sharpe Ratio	0.25	0.32

注：比较基准=中信标普全债指数。

从 VAR 风险指标来看，采用历史模拟法计算基金的 VAR，样本为报告期间东吴优信 C 基金单位净值的日收益率，样本容量为 242。报告期末不同置信水平下基金的 VAR 为：

90%的置信水平　　VAR 值为 0.41%；

95%的置信水平　　VAR 值为 0.58%；

99%的置信水平　　VAR 值为 0.84%。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,109,398.92	-	-	-	-	-	11,109,398.92
结算备付金	366,578.62	-	-	-	-	-	366,578.62
存出保证金	-	-	-	-	-	255,821.00	255,821.00
交易性金融资产	-	12,003,292.00	8,858,200.00	31,060,231.83	28,533,911.20	15,473,614.00	95,929,249.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,051,463.23	5,051,463.23
应收利息	-	-	-	-	-	518,586.2	518,586.2

						2	2
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	23,723.08	-	-	-	-	-	23,723.08
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,499,700.62	12,003,292.00	8,858,200.00	31,060,231.83	28,533,911.20	21,299,484.45	113,254,820.10
负债							
卖出回购金融资产款	9,499,785.75	-	-	-	-	-	9,499,785.75
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,340,248.26	3,340,248.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	606,486.14	606,486.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,802.08	49,802.08
应付托管费	-	-	-	-	-	15,323.73	15,323.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,320.12	8,320.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	214.25	214.25
应交税费	-	-	-	-	-	32,200.00	32,200.00
应付利息	-	-	-	-	-	12,125.60	12,125.60
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	442,732.35	442,732.35
负债总计	9,499,785.75	-	-	-	-	4,507,452.53	14,007,238.28
利率敏感度缺口	1,999,914.87	12,003,292.00	8,858,200.00	31,060,231.83	28,533,911.20	16,792,031.92	99,247,581.82
上年度末 2009年12	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

月31日							
资产							
银行存款	41,765,873.13	-	-	-	-	-	41,765,873.13
结算备付金	214,165.40	-	-	-	-	-	214,165.40
存出保证金	-	-	-	-	-	357,835.22	357,835.22
交易性金融资产	-	34,884,500.00	50,083,000.00	88,624,293.25	30,541,460.55	38,284,513.04	242,417,766.84
应收利息	-	-	-	-	-	710,611.38	710,611.38
应收申购款	10,000,099.36	-	-	-	-	-	10,000,099.36
资产总计	51,980,137.89	34,884,500.00	50,083,000.00	88,624,293.25	30,541,460.55	39,352,959.64	295,466,351.33
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,806,939.41	13,806,939.41
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,904,286.85	30,904,286.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	161,024.94	161,024.94
应付托管费	-	-	-	-	-	49,546.14	49,546.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,269.66	22,269.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	155,136.05	155,136.05
其他负债	-	-	-	-	-	441,616.05	441,616.05
负债总计	-	-	-	-	-	45,540,819.10	45,540,819.10
利率敏感	51,980,13	34,884,50	50,083,00	88,624,29	30,541,46	-6,187,85	249,925,5

度缺口	7.89	0.00	0.00	3.25	0.55	9.46	32.23

注：1、铜陵有色已在 2011 年 2 月 23 日公布提前赎回铜陵转债的公告。

2、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	737,276.68	1,170,090.84
	利率上升 25 个基点	-714,168.12	-1,139,074.06

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

本基金投资于债券类资产（包括含权债券）的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票等中国证监会允许基金投资的其它金融工具比例合计不超过基金资产净值的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	15,473,614.00	15.59	38,284,513.04	15.32

交易性金融资产-债券投资	80,455,635.03	81.07	204,133,253.80	81.68
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	95,929,249.03	96.66	242,417,766.84	97.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

东吴优信稳健债券 A

假设	1.本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2.选用报告期间统计所得beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	业绩基准下跌1%	-1,104,996.17	-1,247,396.98
	业绩基准下跌5%	-5,524,980.84	-6,236,984.92
	业绩基准下跌10%	-11,049,961.67	-12,473,969.83

注：报告期内，本基金 beta 值为 1.69,，09 年 beta 值为 1.06。

东吴优信稳健债券 C

假设	1.本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2.选用报告期间统计所得beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	业绩基准下跌1%	-568,901.65	-647,628.34
	业绩基准下跌5%	-2,844,508.23	-3,238,141.71
	业绩基准下跌10%	-5,689,016.46	-6,476,283.41

注：报告期内，本基金 beta 值为 1.68,，09 年 beta 值为 0.49。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无其他需要说明的重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,473,614.00	13.66

	其中：股票	15,473,614.00	13.66
2	固定收益投资	80,455,635.03	71.04
	其中：债券	80,455,635.03	71.04
	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	11,475,977.54	10.13
6	其他各项资产	5,849,593.53	5.16
7	合计	113,254,820.10	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采掘业	9,439,114.00	9.51
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
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	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	6,034,500.00	6.08
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	15,473,614.00	15.59

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601168	西部矿业	150,000	2,826,000.00	2.85
2	000983	西山煤电	100,000	2,669,000.00	2.69
3	601166	兴业银行	110,000	2,645,500.00	2.67
4	601628	中国人寿	100,000	2,130,000.00	2.15
5	601001	大同煤业	80,000	1,680,800.00	1.69
6	600547	山东黄金	31,000	1,634,010.00	1.65
7	600030	中信证券	100,000	1,259,000.00	1.27
8	600489	中金黄金	15,600	629,304.00	0.63

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600267	海正药业	11,963,621.54	4.79
2	601166	兴业银行	11,819,659.70	4.73
3	600111	包钢稀土	7,855,056.37	3.14
4	002214	大立科技	7,115,753.86	2.85
5	600844	丹化科技	6,742,105.70	2.70
6	600869	三普药业	5,343,090.00	2.14
7	600478	科力远	5,336,163.00	2.14
8	601318	中国平安	4,978,680.00	1.99
9	600815	厦工股份	4,360,737.80	1.74
10	600383	金地集团	4,125,000.00	1.65
11	600307	酒钢宏兴	4,086,000.00	1.63
12	002146	荣盛发展	3,983,894.00	1.59
13	601989	中国重工	3,970,482.00	1.59
14	000961	中南建设	3,957,806.79	1.58
15	600030	中信证券	3,933,328.70	1.57
16	000568	泸州老窖	3,895,105.61	1.56
17	000596	古井贡酒	3,575,220.00	1.43
18	000983	西山煤电	3,537,749.15	1.42
19	600582	天地科技	3,493,591.00	1.40

20	600048	保利地产	2,897,705.82	1.16

注：本项的 “买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600267	海正药业	12,126,056.46	4.85
2	600111	包钢稀土	10,940,134.49	4.38
3	601318	中国平安	10,141,502.63	4.06
4	600869	三普药业	9,638,238.12	3.86
5	600664	哈药股份	9,202,759.50	3.68
6	601166	兴业银行	8,998,496.62	3.60
7	600844	丹化科技	7,576,206.20	3.03
8	002214	大立科技	6,673,666.00	2.67
9	002024	苏宁电器	5,542,608.00	2.22
10	000792	盐湖钾肥	5,413,293.61	2.17
11	600478	科力远	5,127,726.41	2.05
12	600815	厦工股份	4,313,962.25	1.73
13	600383	金地集团	4,185,000.00	1.67
14	002146	荣盛发展	4,084,230.00	1.63
15	000961	中南建设	4,054,500.00	1.62
16	600307	酒钢宏兴	4,019,146.16	1.61
17	601989	中国重工	3,801,500.00	1.52
18	000596	古井贡酒	3,547,914.62	1.42
19	600582	天地科技	3,301,999.60	1.32
20	000568	泸州老窖	3,193,669.00	1.28

注：本项的 “卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	166,185,429.09
卖出股票的收入（成交）总额	188,108,329.09

注：本项的 “买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,581,300.00	11.67
2	央行票据	5,006,000.00	5.04
3	金融债券	9,984,000.00	10.06
	其中：政策性金融债	9,984,000.00	10.06
4	企业债券	17,456,418.80	17.59
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	36,427,916.23	36.70
7	其他	-	-
8	合计	80,455,635.03	81.07

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

金额单位：人民币元

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	113001	中行转债	79,670	8,752,546.20	8.82
2	113002	工行转债	74,000	8,742,360.00	8.81
3	110009	双良转债	44,950	5,741,014.00	5.78
4	126729	燕京转债	42,361	5,714,922.51	5.76
5	090407	09 农发 07	50,000	5,051,000.00	5.09

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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、处罚的情形。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	255,821.00
2	应收证券清算款	5,051,463.23
3	应收股利	-
4	应收利息	518,586.22
5	应收申购款	23,723.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,849,593.53

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	8,752,546.20	8.82
2	110009	双良转债	5,741,014.00	5.78
3	125709	唐钢转债	109,520.00	0.11
4	110003	新钢转债	11,523.00	0.01

8.9.5 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中不存在流通受限情况。

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 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			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
东吴优信稳健债券 A	2,865	21,706.82	32,862,813.40	52.84%	29,327,232.17	47.16%

东吴优信稳健债券 C	451	71,889.30	27,905,991.37	86.07%	4,516,082.98	13.93%
合计	3,316	28,532.00	60,768,804.77	64.23%	33,843,315.15	35.77%

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东吴优信稳健债券 A	东吴优信稳健债券 C
基金合同生效日(2008 年 11 月 5 日)基金份额总额	1,481,731,088.34	-
本报告期期初基金份额总额	115,925,535.33	130,603,083
本报告期基金总申购份额	39,137,598.50	37,785,208.47
减：本报告期基金总赎回份额	92,873,088.26	135,966,217.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	62,190,045.57	32,422,074.35

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

3、本基金于 2008 年 11 月 5 日成立，自 2009 年 6 月 15 日分为 A、C 两类。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内仍聘用江苏公证天业会计师事务所，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，本报告期审计费为 90000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本基金本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		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	349,626,910.38	100.00%	293,040.66	100.00%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：证券公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；证券公司研究能力评价（报告质量、及时性和数量）；证券公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。

租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成考评指标，然后根据综合评分进行选择基金专用交易单元。

2、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期本基金新增交易单元 1 个，为中信建投证券交易单元。

11.7.2 基金租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	611,740,014.47	95.87%	32,100,000.00	100.00%	-	-
中信建投	15,036,551.75	2.36%	-	-	-	-
中银国际	11,311,626.63	1.77%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海证券有限责任公司为代销机构并开通转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-14
2	《东吴优信稳健债券型证券投资基金 2009 年第 4 季度报告》	中国证券报	2010-01-20
3	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-28
4	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在深圳发展银行股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-28
5	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在部分代销机构开通基金转换业务的公告季度报告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-25
6	《东吴优信稳健债券型证券投资基金 2009	中国证券报	2010-03-27

	年年度报告摘要》		
7	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司延长网上银行基金申购费率及定投申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-01
8	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司延长“金融@家”电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-01
9	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在东方证券股份有限公司网上交易、电话、手机交易系统委托申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-06
10	《东吴优信稳健债券型证券投资基金 2010 年第 1 季度报告》	中国证券报	2010-04-22
11	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在深圳发展银行股份有限公司推出基金申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-29
12	《东吴优信稳健债券型证券投资基金更新招募说明书摘要》	中国证券报	2010-06-18
13	《东吴基金管理有限公司关于在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-06
14	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在南京证券有限责任公司网上交易、电话委托、手机委托系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-20
15	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中信银行股份有限公司推出定期定额业务同时参与个人网银申购开放式基金费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-01
16	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-02
17	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在申银万国证券股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-03
18	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券股份有限公司推出定期定额投资业务同时参与网上交易申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-24
19	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国邮政储蓄银行网上交易系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-25
20	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参	中国证券报、上海证	2010-06-30

	加交通银行股份有限公司延长网上银行基金申购费率优惠活动的公告》	券报、证券时报	
21	《东吴优信稳健债券型证券投资基金 2010 年第 2 季度报告》	中国证券报	2010-07-20
22	《东吴基金关于运用固有资金投资旗下东吴优信稳健债券型证券投资基金的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-30
23	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在海通证券股份有限公司推出定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-05
24	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在信达证券股份有限公司推出定期定额投资业务同时参与非现场委托方式交易申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-05
25	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增烟台银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-12
26	《东吴优信稳健债券型证券投资基金 2010 年半年度报告摘要》	中国证券报	2010-08-24
27	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额及转换业务同时参与网上交易费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-25
28	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行延长基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-26
29	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在齐鲁证券有限公司网上交易系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-30
30	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在财富证券有限公司开通基金转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-20
31	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在华泰证券股份有限公司推出定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-20
32	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在爱建证券有限公司网上交易系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-28
33	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在东吴证券有限公司网上交易系统申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-28
34	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加广州证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额及转换业务同时参与网上交易	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-10-14

	费率优惠的公告》		
35	《东吴优信稳健债券型证券投资基金 2010 年第 3 季度报告》	中国证券报	2010-10-26
36	《东吴优信稳健债券型基金 C 类开通定投和转换业务的公告》	中国证券报	2010-11-11
37	《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴优信稳健债券型证券投资基金 C 类增加华夏银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额及转换业务的公告》	中国证券报	2010-11-29
38	《东吴优信稳健债券型证券投资基金更新招募说明书摘要》	中国证券报	2010-12-17
39	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增厦门证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-20
40	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国工商银行股份有限公司推出定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
41	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行延长基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
42	《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳发展银行股份有限公司延长基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
43	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上交易系统延长基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
44	《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加中国交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

2010 年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010 年 7 月 1 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

2010 年 9 月 15 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010 年 11 月 2 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准东吴优信稳健债券型证券投资基金设立的文件；

2、《东吴优信稳健债券型证券投资基金基金合同》；

3、《东吴优信稳健债券型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

5、报告期内东吴优信稳健债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站：http：//www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 （021）50509666

东吴基金管理有限公司

二〇一一年三月三十一日