

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）

2012 年半年度报告摘要

2012 年 6 月 30 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：二〇一二年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。本半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根据本基金合同规定,于 2012 年 8 月 15 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。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 3 月 9 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴深证100指数增强（LOF）
基金主代码	165806
交易代码	165806
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月9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	175,233,549.69份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年4月27日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证100价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利息（税后）

风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
--------	---

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.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666 / 400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.scfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2012 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-52,138.95
本期利润	-12,791,186.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0460
本期基金份额净值增长率	-7.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0718
期末基金资产净值	162,654,165.35
期末基金份额净值	0.928

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 2012 年 3 月 9 日成立，基金合同生效起至披露时点不满六个月。

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

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-6.55%	1.10%	-7.20%	1.11%	0.65%	-0.01%
过去三个月	-7.29%	0.92%	0.79%	1.21%	-8.08%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-7.20%	0.81%	-8.50%	1.26%	1.30%	-0.45%

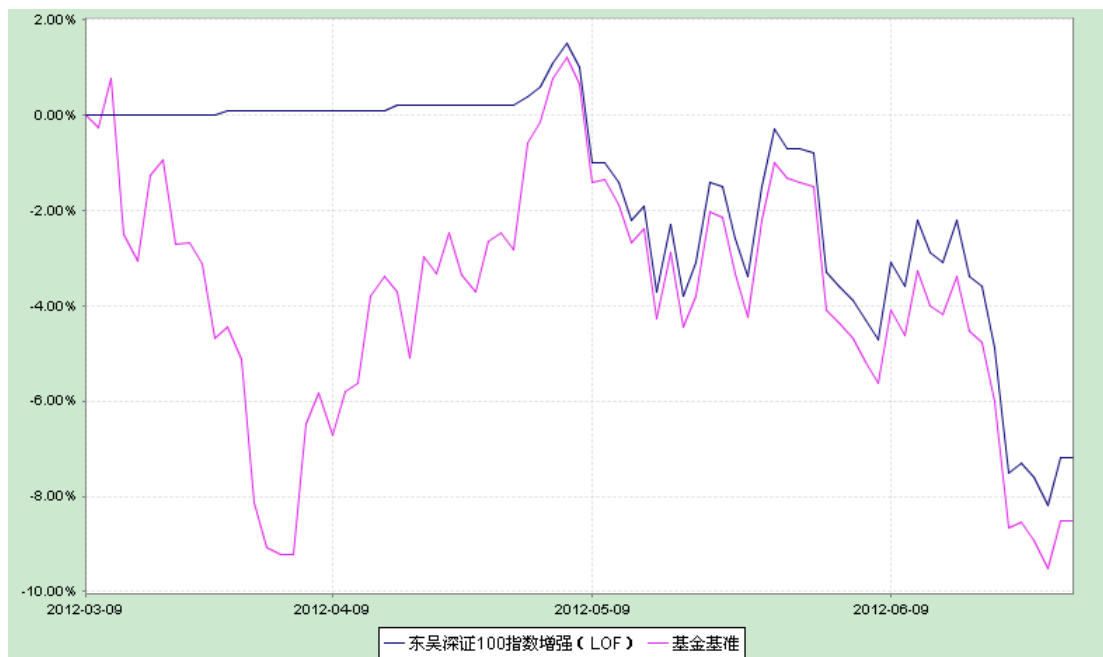
注：基金业绩比较基准=95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利息（税后）

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

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）

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

（2012 年 3 月 9 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：1、基金业绩比较基准=95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利息（税后）。

2、本基金于 2012 年 3 月 9 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金本报告期尚处在建仓期。

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。

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、和而有争、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 2012 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 12 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 5 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、东吴创业板股票型证券投资基金、东吴新兴产业精选股票型证券投资基金；指数型基金 1 只，为东吴中证新兴产业指数证券投资基金；LOF 基金一只，为东吴深证 100 指数增强型股票投资基金；债券型基金 2 只，为东吴优信稳健债券型证券投资基金、东吴增利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。

2012 年上半年，上证综指持续下跌，基金行业面临较大的经营压力，在此背景下，公司依托品牌特色和投资业绩，全面推进公司各项业务发展，取得了一系列经营成果和经营管理经验。截至 6 月底，公司基金管理份额 138.01 亿份，资产管理规模 115.53 亿元，较年初有所增长。今年上半年，公司的权益类基金业绩保持稳定，多数股票型基金业绩在同类排名中位于前 1/2 且不乏特色与亮点；公司固定收益类基金业绩则普遍好于往年，以长期稳定的收益获得投资者的青睐。

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		
唐祝益	本基金基金经理、公司 投资副总监 兼投资管理部总经理	2012-03-09	-	13 年	经济学硕士，南京大学毕业，曾任上海证券综合研究有限公司证券分析师、华鑫证券投资经理、海通证券投资经理等职；2009 年 8 月加入东吴基金管理有限公司，现担任投资副总监兼投资管理部总经理、东吴嘉禾优势精选混合基金经理、东吴进取策略混合基金经理、东吴深证 100 指数增强（LOF）基金经理
刘元海	本基金基金经理	2012-03-14	-	9 年	博士，同济大学毕业。2004 年 2 月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理等职务；现担任东吴新产业精选股票基金经理、东吴深证 100 指数增强（LOF）基金经理。

注：1、唐祝益为该基金的首任基金经理，此处的任职日期为基金成立日；
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》相关规定。
3、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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。

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,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,中国经济出现了类似衰退的迹象,前六个月 GDP 增速回落到 7.8%,六月份 CPI 同比回落到 2.2%,固定资产投资和工业增加值仍然在低位徘徊,出口受欧美经济不景气制约,进口疲软,这些不利因素令投资者对经济底部位置和时点的预期无法明朗化,市场也陷入无方向状态。虽然股票市场估值水平已经处于历史低位,但是企业盈利下滑的杀伤力是巨大的,当前估值水平仍将面临考验。报告期内,本基金净值跟随业绩比较基准出现较大波动,在日常的基金操作中积极应对申购赎回,尽量减少了跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为 0.928 元,累计净值 0.928 元;本报告期份额净值增长率-7.2%,同期业绩比较基准收益率为-8.5%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经济增速和 CPI 下行的衰退周期里,微观层面遇到了前所未有的困难。行业竞争加剧,内外部需求下滑,供给端被动调整,令企业收入增速和盈利能力都面临巨大压力。而通过宏观经济调控难以在短期内有效解决这些问题,预计这种情况可能将会持续一段时间。展望未来一段时间宏观经济和资本市场的运行,依靠房地产拉动经济的简单粗放式增长已经不可持续,政策面无疑还是关注的焦点,实现“稳增长、调结构”都需要实实在在的措施,伴随经济体制改革的深入,将会为资本市场不断带来新的投资主题。

在经济着陆过程中,资本市场的风险偏好出现系统性下降,一方面体现在估值水平上,一方面体现在大类资产轮动中,当前债券的到期收益率已经下滑到 09 年的水平,流动性又进一步推动了二级市场信用利差回落,而股市还在经历最艰难的估值盈利“双杀”阶段,个

股的非系统风险要远高于系统性风险。当前市场整体估值水平处于相对偏低区域,同时深证 100 指数行业分布均衡合理,指数成分股成长性较高,中长期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金,本基金将继续坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对基准指数的跟踪偏离、主动增强获取超额收益为投资目标,努力为投资者实现单位风险收益上的最优化。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

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关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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	14,789,710.35
结算备付金	1,724,193.41
存出保证金	-
交易性金融资产	156,828,851.58
其中：股票投资	153,798,851.58

基金投资	-
债券投资	3,030,000.00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	3,871,161.47
应收利息	36,223.31
应收股利	-
应收申购款	2,179.08
递延所得税资产	-
其他资产	51,380.86
资产总计	177,303,700.06
负债和所有者权益	本期末 2012 年 6 月 30 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	2,000,000.00
应付证券清算款	967,064.08
应付赎回款	11,084,351.76
应付管理人报酬	147,418.58
应付托管费	22,112.79
应付销售服务费	-
应付交易费用	213,874.65
应交税费	-
应付利息	522.22
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	214,190.63
负债合计	14,649,534.71
所有者权益：	
实收基金	175,233,549.69
未分配利润	-12,579,384.34
所有者权益合计	162,654,165.35
负债和所有者权益总计	177,303,700.06

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.928 元，基金份额总额 175,233,549.69 份。

本基金于 2012 年 3 月 9 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

6.2 利润表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2012 年 3 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012 年 3 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	-11,281,076.76
1.利息收入	1,361,870.85
其中：存款利息收入	189,759.04
债券利息收入	7,548.49
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,164,563.32
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-244,988.92
其中：股票投资收益	-1,312,520.44
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收 益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,067,531.52
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	-12,739,047.62
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	341,088.93
减：二、费用	1,510,109.81
1．管理人报酬	865,833.64
2．托管费	129,875.03
3．销售服务费	-
4．交易费用	307,507.28
5．利息支出	4,644.44
其中：卖出回购金融资产支出	4,644.44
6．其他费用	202,249.42
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)	-12,791,186.57
减：所得税费用	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-12,791,186.57
--------------------------	----------------

注：本基金于 2012 年 3 月 9 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 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）	385,199,023.48	-	385,199,023.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,791,186.57	-12,791,186.57
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）	-209,965,473.79	211,802.23	-209,753,671.56
其中：1. 基金申购款	51,635,751.09	-575,590.48	51,060,160.61
2. 基金赎回款	-261,601,224.88	787,392.71	-260,813,832.17
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）	175,233,549.69	-12,579,384.34	162,654,165.35

注：本基金于 2012 年 3 月 9 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）以下简称“本基金”，本基金根据 2011 年 8 月 12 日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴深证 100 指数增强型证券投资基金

（LOF）募集的批复》（证监基金字【2011】【1278】号）的核准，进行募集。基金合同于 2012 年 3 月 9 日正式生效，首次设立募集规模为 385,199,023.48 份基金份额。本基金根据深圳证券交易所《上市通知书》（深证上【2012】99 号），于 2012 年 4 月 27 日正式挂牌交易。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中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为股票型指数增强基金，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，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%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部于 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>》、《东吴深证 100 指数增强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。

6.4.3 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。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本报告期自 2012 年 3 月 9 日起至 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份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它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,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额;

(3) 本基金收益每年最多分配 8 次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%;

(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除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认为的收益分配方式是现金分红;

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日;

(7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 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。

(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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期基金关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30日

	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	232,773,619.76	89.37%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期无权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	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	3,018,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	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	306,000,000.00	13.80%

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30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	191,386.70	89.49%	191,386.70	89.49%

注：1、上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金。

2、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）证管费和证券结算风险基金等）；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，其所计提的证券结算风险基金从支付给证券公司的股票交易佣金中扣除。佣金比率是公允，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。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	865,833.64
其中：支付销售机构的客户维护费	312,693.48

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1%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 × 1% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	129,875.03

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0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.8.5 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 2012年3月9日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	14,789,710.35	171,120.70

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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、增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000059	辽通化工	2012-06-26	重大 事项 停牌 公告	7.91	2012-07-03	8.15	86,058	825,984.89	680,718.78	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券清算款余额 2000000 元,于 2012 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	153,798,851.58	86.74
	其中：股票	153,798,851.58	86.74

2	固定收益投资	3,030,000.00	1.71
	其中：债券	3,030,000.00	1.71
	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	16,513,903.76	9.31
6	其他各项资产	3,960,944.72	2.23
7	合计	177,303,700.06	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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	731,647.35	0.45
B	采掘业	9,861,011.40	6.06
C	制造业	88,089,132.54	54.16
C0	食品、饮料	20,630,107.46	12.68
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	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,324,208.05	3.27
C5	电子	5,459,892.77	3.36
C6	金属、非金属	18,162,305.37	11.17
C7	机械、设备、仪表	30,247,494.00	18.60
C8	医药、生物制品	8,265,124.89	5.08
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,244,584.71	0.77
E	建筑业	1,224,056.00	0.75
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	3,714,104.28	2.28
H	批发和零售贸易	5,380,177.25	3.31
I	金融、保险业	14,375,789.15	8.84
J	房地产业	15,826,802.58	9.73
K	社会服务业	2,674,342.88	1.64
L	传播与文化产业	1,098,654.98	0.68
M	综合类	2,030,632.22	1.25
	合计	146,250,935.34	89.92

7.2.2 积极投资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	383,783.40	0.24
B	采掘业	495,855.36	0.30
C	制造业	1,514,904.44	0.93
C0	食品、饮料	507,168.64	0.31
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	292,531.80	0.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	715,204.00	0.44
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	346,317.00	0.21
I	金融、保险业	1,319,310.00	0.81
J	房地产业	2,018,588.04	1.24
K	社会服务业	808,828.00	0.50
L	传播与文化产业	660,330.00	0.41
M	综合类	-	-
	合计	7,547,916.24	4.64

7.3 期末按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

7.3.1 期末指数投资按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

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	000002	万 科 A	861,879	7,679,341.89	4.72
2	000858	五 粮 液	227,572	7,455,258.72	4.58
3	000651	格力电器	287,341	5,991,059.85	3.68
4	000157	中联重科	532,661	5,342,589.83	3.28

5	000001	深发展 A	333,475	5,055,481.00	3.11
6	002024	苏宁电器	546,935	4,588,784.65	2.82
7	002304	洋河股份	30,490	4,102,429.50	2.52
8	000568	泸州老窖	88,168	3,730,388.08	2.29
9	000024	招商地产	137,526	3,373,512.78	2.07
10	000063	中兴通讯	236,767	3,305,267.32	2.03

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.scfund.com.cn 的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按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

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	600048	保利地产	178,006	2,018,588.04	1.24
2	600837	海通证券	137,000	1,319,310.00	0.81
3	000826	桑德环境	35,320	808,828.00	0.50
4	002241	歌尔声学	19,600	715,204.00	0.44
5	300291	华录百纳	11,500	660,330.00	0.41
6	000596	古井贡酒	10,736	507,168.64	0.31
7	600395	盘江股份	18,447	495,855.36	0.30
8	002041	登海种业	18,460	383,783.40	0.24
9	002269	美邦服饰	14,370	346,317.00	0.21
10	002292	奥飞动漫	13,970	292,531.80	0.18

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	11,718,029.24	7.20
2	000858	五粮液	9,724,591.70	5.98
3	000651	格力电器	7,696,089.08	4.73
4	000001	深发展 A	6,873,538.65	4.23
5	002024	苏宁电器	6,830,473.10	4.20
6	000157	中联重科	6,707,958.79	4.12
7	600048	保利地产	5,832,027.85	3.59
8	002304	洋河股份	5,354,909.12	3.29
9	000063	中兴通讯	5,180,478.01	3.18

10	000568	泸州老窖	4,963,893.40	3.05
11	000983	西山煤电	4,713,545.00	2.90
12	000024	招商地产	4,442,177.63	2.73
13	000596	古井贡酒	4,076,226.80	2.51
14	000527	美的电器	3,986,408.39	2.45
15	000776	广发证券	3,910,351.72	2.40
16	000338	潍柴动力	3,559,440.49	2.19
17	000423	东阿阿胶	3,112,025.38	1.91
18	000629	攀钢钒钛	3,021,825.00	1.86
19	000792	盐湖股份	3,014,750.30	1.85
20	000895	双汇发展	2,914,238.18	1.79

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	3,946,193.02	2.43
2	600048	保利地产	3,842,452.95	2.36
3	000596	古井贡酒	3,502,550.23	2.15
4	000858	五粮液	1,484,848.67	0.91
5	000651	格力电器	1,314,666.46	0.81
6	002024	苏宁电器	1,307,157.10	0.80
7	000001	深发展A	1,285,833.28	0.79
8	000024	招商地产	1,233,310.27	0.76
9	000157	中联重科	1,183,442.48	0.73
10	002304	洋河股份	1,093,606.65	0.67
11	000063	中兴通讯	1,084,114.78	0.67
12	000983	西山煤电	1,040,545.92	0.64
13	000568	泸州老窖	1,011,539.88	0.62
14	000623	吉林敖东	988,077.51	0.61
15	000522	白云山A	876,447.88	0.54
16	601098	中南传媒	795,744.34	0.49
17	600703	三安光电	788,727.81	0.48
18	000400	许继电气	738,357.80	0.45
19	600406	国电南瑞	695,467.87	0.43
20	000031	中粮地产	687,657.28	0.42

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。

7.4.3 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	214,156,725.92
卖出股票的收入（成交）总额	46,294,306.28

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。

7.5 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	3,030,000.00	1.86
2	央行票据	-	-
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,030,000.00	1.86

7.6 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	019202	12 国债 02	30,000	3,030,000.00	1.86

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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

编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	3,871,161.47
3	应收股利	-
4	应收利息	36,223.31
5	应收申购款	2,179.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	51,380.86
8	其他	-
9	合计	3,960,944.72

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,304	134,381.56	108,997,460.40	62.20%	66,236,089.29	37.80%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	昆山明诚投资有限公司	490,020.00	10.34%
2	陈莉萍	200,025.00	4.22%
3	邹明	198,057.00	4.18%
4	张安琴	198,016.00	4.18%
5	于长根	196,016.00	4.14%
6	华文琴	150,041.00	3.17%
7	周礼孙	140,038.00	2.96%
8	王添	120,013.00	2.53%
9	朱新毅	100,018.00	2.11%
10	龚林芬	100,012.00	2.11%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 3 月 9 日）基金份额总额	385,199,023.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	51,635,751.09
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	261,601,224.88
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	175,233,549.69

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。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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	232,773,619.76	89.37%	191,386.70	89.49%	-
中银国际	1	27,677,412.44	10.63%	22,487.95	10.51%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-

第一创业证券	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

本基金于 2012 年 3 月 9 日成立，所有证券公司交易单元均为新增。

10.7.2 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	3,018,000.00	100.00%	306,000,000.00	13.80%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,910,900,000.00	86.20%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自 2012 年 1 月 16 日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

东吴基金管理有限公司
二〇一二年八月二十五日