

东吴保本混合型证券投资基金 2013 年半年 度报告

2013 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一三年八月二十九日

§ 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。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
7.7 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	39
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	39
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.10 投资组合报告附注	40
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41

§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴保本混合型证券投资基金
基金简称	东吴保本混合
基金主代码	582003
交易代码	582003
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 13 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	486,912,415.84 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资组合保险策略的运用，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳健增长。
投资策略	1、资产配置策略 本基金的资产将分为保本资产与风险资产两大类资产，以恒定组合投资保险策略（CPPI）为依据，结合东吴“M 值优化”模型，再基于基金管理人对于宏观经济运行变化的判断以及各投资品种的风险收益预期，确定基金资产在股票、债券等投资品种中的比例。 2、债券投资策略 债券投资方面，对于本基金的保本资产部分，本基金主要投资对象为交易所和银行间债券市场上的债券，其组合久期与保本周期基本匹配，以有效规避利率、收益率曲线变化、再投资等各种风险；同时综合考虑收益性、流动性和风险性，选择低估值债券进行投资，并利用市场时机、无风险套利、利率预测等，争取债券投资的超额收益；利用现券回购所得资金适时参与新股申购及配售，以获得稳定的股票一级市场超额回报。 3、股票投资策略 本基金将严格按照 CPPI 策略并结合 M 值优化模型，动态调整风险资产比例。在风险资产中，本基金将精选具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票作为投资对象，力争最大限度获取基金资产增值。

	4、权证投资策略 本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
业绩比较基准	银行三年期定期存款收益率（税后）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	李芳菲
	联系电话	021-50509888-8206	010-66060069
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95599
传真		021-50509888-8211	010-63201816
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200135	100031
法定代表人		任少华	蒋超良

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、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路 279 号
基金保证人	中国投资担保有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

§ 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,566,784.07
本期利润	9,773,332.82
加权平均基金份额本期利润	0.0172
本期加权平均净值利润率	1.67%
本期基金份额净值增长率	1.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	12,515,406.54
期末可供分配基金份额利润	0.0257
期末基金资产净值	499,427,822.38
期末基金份额净值	1.026
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.60%

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 8 月 13 日成立，基金合同生效起至披露时点不满一年。

3.2 基金净值表现

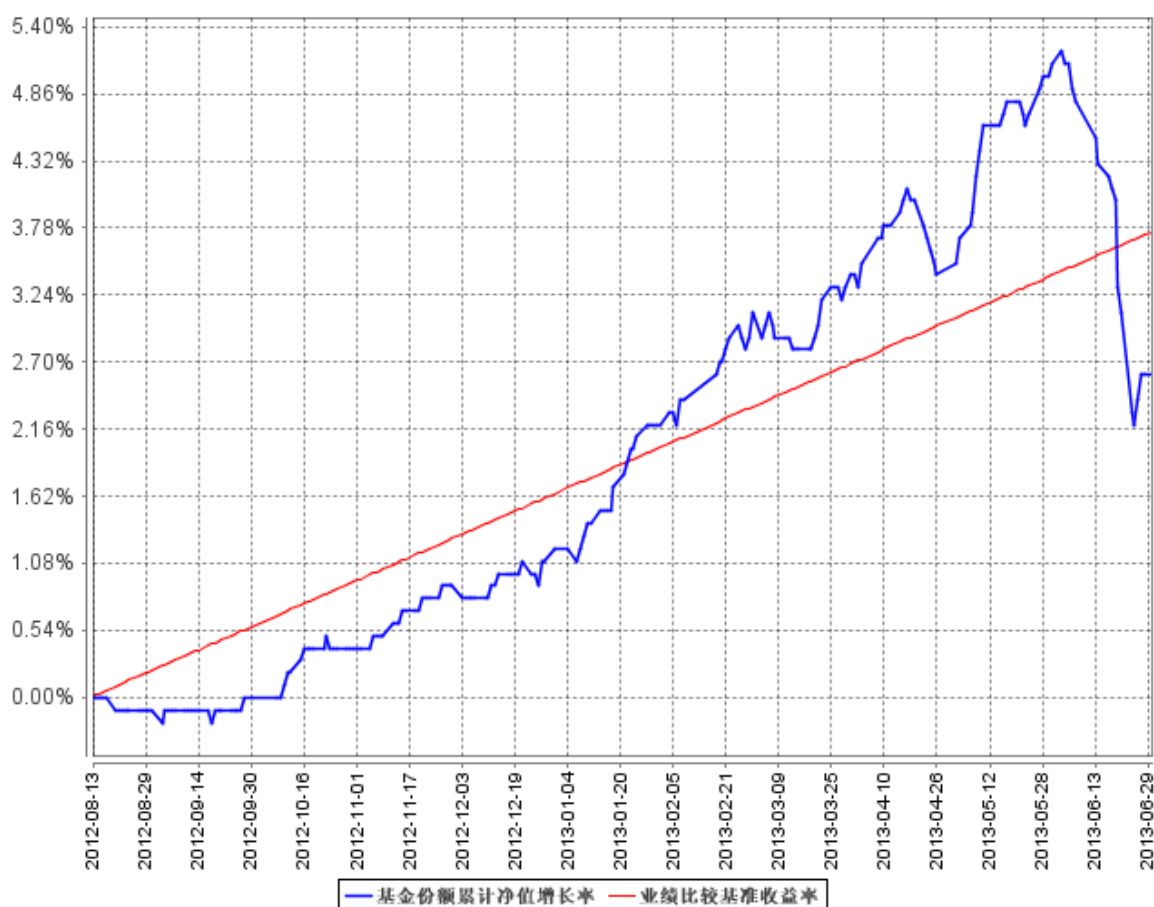
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.38%	0.25%	0.35%	0.02%	-2.73%	0.23%
过去三个月	-0.77%	0.18%	1.06%	0.01%	-1.83%	0.17%
过去六个月	1.38%	0.15%	2.11%	0.02%	-0.73%	0.13%
自基金合同 生效起至今	2.60%	0.11%	3.75%	0.01%	-1.15%	0.10%

注：比较基准=银行三年期定期存款收益率（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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 比较基准=银行三年期定期存款收益率（税后）。

2. 本基金于 2012 年 8 月 13 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，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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、和而有锋、

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 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 15 只，其中股票型基金 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、东吴创业股票型证券投资基金、东吴新产业精选股票型证券投资基金；债券型基金 3 只，分别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、东吴鼎利分级债券型证券投资基金；混合型基金 4 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、东吴保本混合型证券投资基金、东吴内需增长混合型证券投资基金；货币型基金 1 只，为东吴货币市场证券投资基金；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 1 只，为东吴深证 100 指数增强型股票投资基金。

2013 年上半年，上证综指持续下跌，基金行业仍旧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。今年上半年以来，东吴旗下多只基金业绩稳居同类前列，其中东吴进取策略混合型证券投资基金以 23.01% 的净值增长率位列同类 71 只基金第 6 位，东吴中证新兴产业股票型投资基金以 11.11% 的净值增长率位列同类 119 只基金第 10 名，东吴新产业精选股票型证券投资基金也以 17.70% 的净值增长率位列同类型基金排名前四分之一的序列。同时，公司抓住新一轮监管政策带来的改革红利和转型红利，及时申报设立了特定资产管理业务子公司。在严控风险的基础上，大力开展专项资产管理业务，全心全意打造财富管理平台。下一步，公司将秉承“三满意一放心”的经营理念，继续以市场为导向、以客户为中心，强化服务意识，拓展发展空间，全面提高公司的核心竞争力，推进东吴基金向现代财富管理公司转型。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
丁蕙	本基金基金经理、公司固定收益部总经理	2012 年 8 月 13 日	-	13.5 年	工商管理硕士，历任中信证券上海营业部交易员，汉唐证券固定收益部债券研究主管，航天科技财务公司债券

					投资主管，平安资产管理公司投资经理；2011 年 7 月加入东吴基金管理有限公司，现担任公司固定收益部总经理兼东吴优信稳健债券基金基金经理、东吴保本混合基金基金经理、东吴鼎利分级债券型投资基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、丁蕙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。

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

公司建立了严格的投资决策内部控制：1、各投资组合投资决策保持相对独立性的同时，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司研究策划部的研究工作实行信息化管理，研究成果在统一的信息平台发布，对所有产品组合经理开放；3、坚持信息保密，禁止在除统一信息平台外的其他渠道发布研究报告，禁止在研究报告发布之前通过任何渠道泄露研究成果信息。同时，公司还建立了严格的投资交易行为监控制度，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，对公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合组合互相之间的输送金额总额、贡献度等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析未发现异常情况。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年初经济呈现弱复苏迹象，但上半年以来复苏动力持续减弱，通胀基本维持低位，基本面总体对债市较有利。1 季度外汇占款超预期增长且央行提出短期流动性操作，资金面超预期宽松推动债市收益率普降。但 2 季度在经历了各项监管措施的加码和“钱荒风暴”后，外汇占款逐步回落，甚至于 6 月出现流出，银行同业及理财业务模式也面临挑战，市场整体对流动性的担忧加剧，债市表现来看，4 月监管因素引发债市首次大幅调整后出现反弹行情，但各种流动性负面因素在 6 月底集中爆发，带来债市第二次大幅调整。

本基金资产配置：1 季度增配信用债，保本垫增厚后增加可转债、权益类投资仓位，4 月债市反弹后迅速降低仓位，为 6 月流动性紧张做好准备，6 月底股债双杀后，增加权益类、可转债的配置。

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 1.026 元，累计净值 1.026 元；本报告期份额净值增长率 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新一届政府对经济下行的容忍度已有提高，经济基本面对债市仍有支撑。目前央行货币政策目标已不仅围绕经济与通胀的基本面因素，还有对防范金融风险的考量，央行对流动性更多的是被动对冲，而不会主动引导宽松，同时 6 月“钱荒风暴”后银行等金融机构流动性管理将更趋谨慎，因此我们预计资金面的紧平衡可能将成为常态，流动性因素、机构行为等对债市走向的影响将愈发显著，之前流动性宽松催生的套利行为及监管效应的发酵也将加剧信用风险的累积，因此我们对下半年流动性及信用环境持偏谨慎态度。

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

本基金自成立以来未进行过利润分配。

§ 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

在托管东吴保本混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》、《东吴保本混合型证券投资基金托管协议》的约定，对东吴保本混合型证券投资基金管理人—东吴基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东吴基金管理有限公司在东吴保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东吴基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办

法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的东吴保本混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：东吴保本混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	8,237,774.96	17,417,541.23
结算备付金		7,547,957.32	8,746,540.67
存出保证金		56,250.58	-
交易性金融资产	6.4.7.2	709,360,947.52	1,076,133,952.08
其中：股票投资		24,922,939.84	-
基金投资		-	-
债券投资		684,438,007.68	1,076,133,952.08
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,906,839.58	1,835,278.58
应收利息	6.4.7.5	12,815,119.34	16,317,589.60
应收股利		-	-
应收申购款		3,069.13	1,385.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		741,927,958.43	1,120,452,287.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		238,999,854.30	456,499,258.55
应付证券清算款		-	49,428.49
应付赎回款		2,253,086.23	2,263,594.49
应付管理人报酬		523,009.35	685,538.25
应付托管费		87,168.23	114,256.40

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	15,641.59	7,084.25
应交税费		381,988.32	64,412.20
应付利息		100,763.70	138,704.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	138,624.33	184,676.75
负债合计		242,500,136.05	460,006,954.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	486,912,415.84	652,671,994.29
未分配利润	6.4.7.10	12,515,406.54	7,773,339.43
所有者权益合计		499,427,822.38	660,445,333.72
负债和所有者权益总计		741,927,958.43	1,120,452,287.90

注：1. 报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 486912415.84 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴保本混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		20,347,528.26	-
1.利息收入		18,139,123.11	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	227,541.47	-
债券利息收入		17,846,273.47	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		65,308.17	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,134,433.09	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,541,785.70	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	592,647.39	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-9,793,451.25	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	867,423.31	-
减：二、费用		10,574,195.44	-
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,497,193.73	-
2．托管费	6.4.10.2.2	582,865.65	-

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	47,781.13	-
5. 利息支出		6,309,324.58	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,309,324.58	-
6. 其他费用	6.4.7.19	137,030.35	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,773,332.82	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,773,332.82	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴保本混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日 至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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)	652,671,994.29	7,773,339.43	660,445,333.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,773,332.82	9,773,332.82
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)	-165,759,578.45	-5,031,265.71	-170,790,844.16
其中：1.基金申购款	2,594,198.28	98,884.16	2,693,082.44
2.基金赎回款	-168,353,776.73	-5,130,149.87	-173,483,926.60
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)	486,912,415.84	12,515,406.54	499,427,822.38
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

报表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：

_____ 任少华	_____ 吕晖	_____ 袁渊
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012][506]号《关于同意东吴保本混合型证券投资基金募集的批复》核准，由东吴基金管理有限公司作为发起人向社会公众公开发行募集，基金合同于 2012 年 8 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 775,673,452.62 份基金份额。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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为混合型基金，投资组合中股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产投资占基金资产比例不低于 60%，其中现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：银行三年期定期存款收益率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、具体会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部发布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	8,237,774.96
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	8,237,774.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		34,360,830.30	24,922,939.84	-9,437,890.46
债券	交易所市场	371,325,544.02	370,992,007.68	-333,536.34
	银行间市场	311,716,991.61	313,446,000.00	1,729,008.39
	合计	683,042,535.63	684,438,007.68	1,395,472.05
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		717,403,365.93	709,360,947.52	-8,042,418.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,401.61
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	3,056.94
应收债券利息	12,810,638.02
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	22.77

合计	12,815,119.34
----	---------------

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,321.84
银行间市场应付交易费用	4,319.75
合计	15,641.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	34,485.98
预提费用	104,138.35
合计	138,624.33

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	652,671,994.29	652,671,994.29
本期申购	2,594,198.28	2,594,198.28
本期赎回(以“-”号填列)	-168,353,776.73	-168,353,776.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	486,912,415.84	486,912,415.84

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

2、如果本报告期间发生转换出业务，则本期赎回份额中包含该业务。

3、本基金于 2012 年 8 月 13 日成立。

6.4.7.10 未分配利润

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	6,148,735.22	1,624,604.21	7,773,339.43
本期利润	19,566,784.07	-9,793,451.25	9,773,332.82
本期基金份额交易产生的变动数	-4,321,556.73	-709,708.98	-5,031,265.71
其中：基金申购款	78,536.91	20,347.25	98,884.16
基金赎回款	-4,400,093.64	-730,056.23	-5,130,149.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,393,962.56	-8,878,556.02	12,515,406.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	116,524.45
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	110,612.22
其他	404.80
合计	227,541.47

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期末未进行股票交易。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	922,067,187.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	890,900,311.01
减：应收利息总额	20,625,090.95

债券投资收益	10,541,785.70
--------	---------------

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末持有资产支持证券。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末进行衍生工具交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	592,647.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	592,647.39

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,793,451.25
——股票投资	-9,437,890.46
——债券投资	-355,560.79
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-9,793,451.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	864,406.63
转换费收入	3,016.68
合计	867,423.31

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	40,056.13
银行间市场交易费用	7,725.00
合计	47,781.13

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	79,343.16
汇划费	14,312.00
数字证书服务费	400.00
帐户维护费	18,180.00
合计	137,030.35

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司	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。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	279,465,996.04	48.83%	-	-

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	4,406,365,000.00	33.11%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,497,193.73	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,576,504.51	-

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 1.2% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.2% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	582,865.65	-

注：支付基金托管人中国农业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 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

东吴证券股份有限公司	19,999,400.00	4.11%	19,999,400.00	3.06%
------------	---------------	-------	---------------	-------

注：本关联方投资本基金的费用是公允的，均遵照本基金公告的费用率执行。

6.4.10.5 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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公司	8,237,774.96	116,524.45	-	-

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金自成立以来未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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/增发的流通受限股票。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 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 238999854.3 元，于 2013 年 7 月 1 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。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。

本基金以本金安全为导向，基于宏观经济运行变化和阶段性市场特征，运用恒定比例投资组合保险策略（CPPI）进行大类资产配置，通过购买债券等安全资产构建本金安全垫。同时结合东吴“M 值优化模型”动态调整投资品种比例，灵活精选债券和股票，以期在不同市场环境中攻守自如，增厚收益。

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。

6.4.13.2 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。

对于与债券投资相关的信用风险，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来管理信用风险。本基金的银行存款存放于本基金的托管行 - 中国农业银行股份有限公司。本基金认为与中国农业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。

6.4.13.3 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余部分在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 40%。

除卖出回购金融资产款合约约定到期日均为一个月以内计息外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 201 3 年 6 月 30 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	8,237,774.96	-	-	-	-	-	8,237,774.96
清 算 备 付 金	7,547,957.32	-	-	-	-	-	7,547,957.32
存 出 保 证 金	56,250.58	-	-	-	-	-	56,250.58
交 易 性 金 融 资 产	16,071,480.00	9,974,000.00	40,042,000.00	556,813,819.18	61,536,708.50	24,922,939.84	709,360,947.52
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买 入 返	-	-	-	-	-	-	-

售金融资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,906,839.58	3,906,839.58
应收利息	-	-	-	-	-	12,815,119.34	12,815,119.34
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	3,069.13	3,069.13
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,913,462.86	9,974,000.00	40,042,000.00	556,813,819.18	61,536,708.50	41,647,967.89	741,927,958.43
负债							
卖出回购证券款	238,999,854.30	-	-	-	-	-	238,999,854.30
应付证	-	-	-	-	-	-	-

券清算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,253,086.23	2,253,086.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	523,009.35	523,009.35
应付托管费	-	-	-	-	-	87,168.23	87,168.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,641.59	15,641.59
应交税费	-	-	-	-	-	381,988.32	381,988.32
应付利息	-	-	-	-	-	100,763.70	100,763.70
应付利	-	-	-	-	-	-	-

润							
其他 负债	-	-	-	-	-	138,624.33	138,624.33
负债 总计	238,999,854.30	-	-	-	-	3,500,281.75	242,500,136.05
利率 敏感 度缺 口	-207,086,391.44	9,974,000.00	40,042,000.00	556,813,819.18	61,536,708.50	38,147,686.14	499,427,822.38
上 年 度 末 201 2 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	17,417,541.23	-	-	-	-	-	17,417,541.23
结 算 备 付 金	8,746,540.67	-	-	-	-	-	8,746,540.67
存 出 保 证 金	-	-	-	-	-	-	-
交 易 性	15,238,144.00	57,249,600.00	319,678,060.00	665,438,248.08	18,529,900.00	-	1,076,133,952.08

金融资产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,835,278.58	1,835,278.58
应收利息	-	-	-	-	-	16,317,589.60	16,317,589.60
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,385.74	1,385.74
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	41,402,225.90	57,249,600.00	319,678,060.00	665,438,248.08	18,529,900.00	18,154,253.92	1,120,452,287.90

计							
负债							
卖出回购金融资产款	456,499,258.55	-	-	-	-	-	456,499,258.55
应付证券清算款	-	-	-	-	-	49,428.49	49,428.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,263,594.49	2,263,594.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	685,538.25	685,538.25
应付托管费	-	-	-	-	-	114,256.40	114,256.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	7,084.25	7,084.25

交易费用							
应付税费	-	-	-	-	-	64,412.20	64,412.20
应付利息	-	-	-	-	-	138,704.80	138,704.80
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	184,676.75	184,676.75
负债总计	456,499,258.55	-	-	-	-	3,507,695.63	460,006,954.18
利率敏感度缺口	-415,097,032.65	57,249,600.00	319,678,060.00	665,438,248.08	18,529,900.00	14,646,558.29	660,445,333.72

6.4.13.4.1.2 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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	4,563,400.00	4,619,900.00

	利率上升 25 个基点	-4,513,300.00	-4,580,400.00
--	-------------	---------------	---------------

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	24,922,939.84	4.99	-	-
交易性金融资产 - 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产 - 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,922,939.84	4.99	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准 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		
	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）	
分析		本期末（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	1. 业绩基准下跌 1	-799,100.00	-1,152,400.00
	2. 业绩基准下跌 5	-3,995,400.00	-5,762,100.00
	3. 业绩基准下跌 10	-7,990,800.00	-11,524,200.00

注：报告期内，本基金 beta 值为 0.16，12 年 beta 为 0.17

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	24,922,939.84	3.36
	其中：股票	24,922,939.84	3.36
2	固定收益投资	684,438,007.68	92.25
	其中：债券	684,438,007.68	92.25
	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	15,785,732.28	2.13
6	其他各项资产	16,781,278.63	2.26
7	合计	741,927,958.43	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,272,000.00	1.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,650,939.84	3.93
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,922,939.84	4.99

7.3 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	600098	广州发展	3,898,996	19,650,939.84	3.93
2	600276	恒瑞医药	200,000	5,272,000.00	1.06

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	600098	广州发展	29,314,852.28	4.44
2	600276	恒瑞医药	5,045,978.02	0.76

注：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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

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

买入股票成本（成交）总额	34,360,830.30
卖出股票收入（成交）总额	-

注：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	19,980,000.00	4.00
2	央行票据	9,974,000.00	2.00
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	466,569,052.98	93.42
5	企业短期融资券	20,062,000.00	4.02
6	中期票据	131,550,000.00	26.34
7	可转债	36,302,954.70	7.27
8	其他	-	-
9	合计	684,438,007.68	137.04

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	122899	10 杨浦 01	464,960	46,496,000.00	9.31
2	1380175	13 鸥交投债	400,000	40,240,000.00	8.06
3	1280143	12 乌国资债	300,000	30,810,000.00	6.17
4	1080051	10 大连装备 债 01	300,000	29,997,000.00	6.01
5	1382102	13 用友 MTN1	300,000	29,991,000.00	6.01

7.7 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。

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投资。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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	56,250.58
2	应收证券清算款	3,906,839.58
3	应收股利	-
4	应收利息	12,815,119.34
5	应收申购款	3,069.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,781,278.63

7.10.4 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	110022	同仁转债	16,552,454.70	3.31

7.10.5 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。

7.10.6 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
4,891	99,552.73	54,061,452.88	11.10%	432,850,962.96	88.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	99,014.00	0.0203%

注：高级管理人员、基金投资和研究部负责人及本基金经理本期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月13日）基金份额总额	775,673,452.62
本报告期期初基金份额总额	652,671,994.29
本报告期基金总申购份额	2,594,198.28
减：本报告期基金总赎回份额	168,353,776.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	486,912,415.84

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

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司聘任王炯同志为东吴基金管理有限公司常务副总经理。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第四次临时会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2013 年 3 月 12 日进行了披露。

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司聘任徐军同志为东吴基金管理有限公司督察长。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第六次临时会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2013 年 3 月 29 日进行了披露，自 2013 年 3 月 29 日起，公司总经理任少华同志不再代为履行公司督察长职务。

报告期内，基金管理人东吴基金管理有限公司原副总经理胡玉杰同志因个人原因辞去副总经理职务，离任日期 2013 年 4 月 13 日。此事项经东吴基金管理有限公司第二届董事会第二十次会议审议通过，已按规定向中国证监会和上海证监局报告，并已于 2013 年 4 月 13 日进行了披露。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内聘用江苏天衡会计师事务所担任本基金会计师事务所。

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	

平安证券	1	21,924,852.28	63.81%	19,960.57	63.81%	-
爱建证券	1	7,390,000.00	21.51%	6,728.00	21.51%	-
齐鲁证券	1	5,045,978.02	14.69%	4,593.84	14.69%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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

本基金本报告期新增 2 个交易单元：东北证券、国海股份；退租 3 个交易单元：国信证券、中信证券、申银万国。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
平安证券	10,346,569.90	1.81%	998,000,000.00	7.50%	-	-
爱建证券	115,013,344.17	20.10%	2,262,000,000.00	17.00%	-	-
齐鲁证券	40,105,348.41	7.01%	2,687,000,000.00	20.19%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	127,415,026.03	22.26%	2,780,000,000.00	20.89%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	175,000,000.00	1.31%	-	-
东吴证券	279,465,996.04	48.83%	4,406,365,000.00	33.11%	-	-

10.8 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证券投资基金估值调整情况的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 1 月 5 日
2	东吴保本混合型证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 1 月 19 日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 2 月 22 日
4	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 2 月 23 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在浙江同花顺基金销售有限公司网上交易系统申购费率优惠的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 2 月 26 日
6	东吴基金管理有限公司关于设立上海新东吴优胜资产管理有限公司的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 2 月 26 日
7	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 12 日
8	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 26 日

	业务及转换业务的公告		
9	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海天天基金销售有限公司网上申购费率及定投申购费率优惠的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 26 日
10	东吴保本混合型证券投资基金 2012 年年度报告及摘要	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 26 日
11	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 28 日
12	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 29 日
13	东吴保本混合型证券投资基金招募说明书更新及摘要	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 29 日
14	东吴基金管理有限公司关于赎回固有资金所投资旗下部分基金的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 3 月 30 日
15	东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 4 月 13 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 4 月 17 日
17	东吴保本混合型证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 4 月 22 日
18	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 4 月 25 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下	中证报、证券时报、	2013 年 5 月 29 日

	证券投资基金估值方法变更的公告	公司网站	
20	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 6 月 15 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 6 月 26 日
22	东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告	中证报、证券时报、公司网站	2013 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴保本混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东吴保本混合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、报告期内东吴保本混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 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 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司
2013 年 8 月 29 日