

东吴行业轮动股票型证券投资基金 2013 年 半年度报告摘要

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：华夏银行股份有限公司

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

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。

基金托管人华夏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。

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 2013 年 1 月 1 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	东吴行业轮动股票
基金主代码	580003
交易代码	580003
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	2008 年 4 月 23 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,687,769,741.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。
业绩比较基准	75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕晖	郑鹏
	联系电话	021-50509888-8206	010-85238667
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	zhjjtgb@hxb.com.cn

客户服务电话	021-50509666/400-821-0588	95577
传真	021-50509888-8211	010-85238680

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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	29,151,589.84
本期利润	-338,876,146.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1179
本期基金份额净值增长率	-18.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4185
期末基金资产净值	1,562,858,854.97
期末基金份额净值	0.5815

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。

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

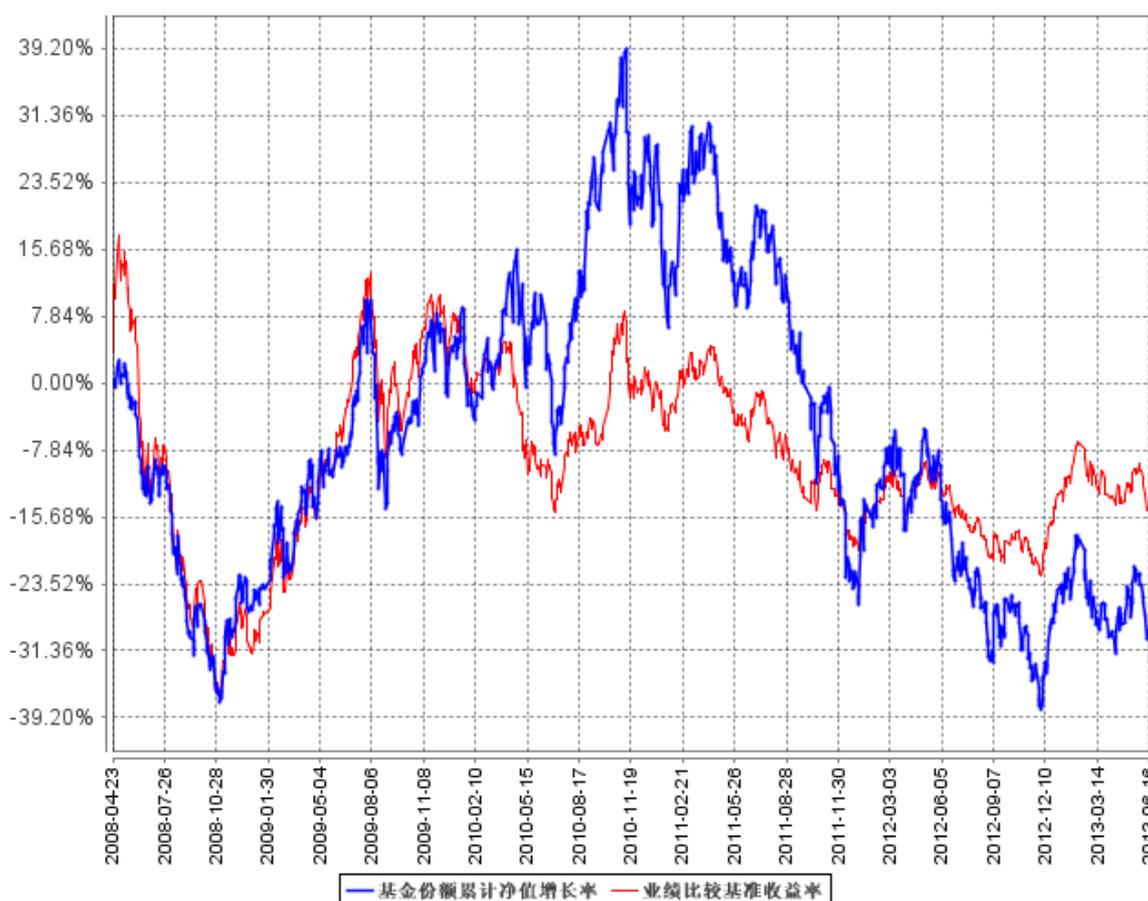
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-18.85%	2.25%	-11.75%	1.41%	-7.10%	0.84%
过去三个月	-14.31%	1.87%	-8.61%	1.10%	-5.70%	0.77%

过去六个月	-18.13%	1.79%	-8.93%	1.13%	-9.20%	0.66%
过去一年	-20.68%	1.82%	-7.01%	1.03%	-13.67%	0.79%
过去三年	-34.52%	1.78%	-8.16%	1.03%	-26.36%	0.75%
过去五年	-28.89%	1.75%	-10.44%	1.34%	-18.45%	0.41%
自基金合同生效起至今	-38.01%	1.74%	-19.50%	1.40%	-18.51%	0.34%

注：比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数。

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、东吴行业轮动基金于 2008 年 4 月 23 日成立。

2、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数。

§ 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，创造性地树立自己独特的文化体系，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、东吴新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		
任壮	本基金基金经理、公司权益类投资副总监	2009 年 1 月 20 日	-	8.5 年	管理学博士，中国社科院金融所博士后，副研究员；曾任兴业证券研发中心高级研究员；2007 年 9 月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司基金经理助理、研究策划部总经理助理、公司研究副总监兼研究策划部副总经理、东吴新经济股票基金基金经理等职，现担任公司权益类投资副总监兼东吴行业轮动股票型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期和离职日期均指公司对外公告之日。

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》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 年上半年，受经济指标低于预期，结构转型推进，流动性收紧等影响，市场出现分化：即以创业板为主的中小盘股票出现持续上涨，而大盘蓝筹股出现震荡下跌走势。市场出现的估值分化主要受经济转型预期的推动。本基金在上半年主要配置以下行业：一是重点配置了文化影视传媒中的个股，包括新媒体、影视制作、手机游戏等。二是重点配置了网络安全行业中的个股。三是持有煤炭、小金属、金融等为主的上游资源型行业。四是配置了与房地产产业链相关的行业，如地产、建材、建筑装饰等。

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 0.5815 元，累计净值 0.6615 元；本报告期份额净值增长率-18.13%，同期业绩比较基准收益率为-8.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年 A 股市场整体走势并不悲观：首先，中央已提出要在“稳增长”、“保下限”的基础上“调结构”，并在铁路建设、棚户区改造、4G 投资建设、拉动信息消费上加大投资力度，经济稳增长后打消了市场对经济下滑的预期，使资本市场继续下跌的空间较小。其次，下半年资金紧张状况将会缓解，流动性将会比较宽裕，未来几个月资金会逐步投向实体经济。最后，以大盘蓝筹股为主的估值仍处于历史相对底部，向上概率大于向下概率。

我们认为，下半年 A 股市场依然存在结构性机会：一是房地产相关产业链。房地产政策调控

向中长期预期转变，未来行业存在估值提升的机会，如地产、建筑建材、装饰园林等。二是看好政策推动的基建投资相关行业，如铁路基建等。三是估值较低的周期性行业将受益于下半年经济“稳增长”政策推动，存在阶段性机会，如煤炭、小金属、金融等。

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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2013 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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：东吴行业轮动股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	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	24,307,428.19	14,371,721.92
结算备付金	15,059,391.55	4,965,302.60
存出保证金	3,719,471.86	2,250,000.00
交易性金融资产	1,537,040,230.61	2,214,549,623.21
其中：股票投资	1,457,296,230.61	2,104,743,623.21
基金投资	-	-
债券投资	79,744,000.00	109,806,000.00
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	-	75,048,129.15
应收利息	1,718,401.80	939,750.17
应收股利	-	-
应收申购款	945,325.07	1,615,818.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,582,790,249.08	2,313,740,345.19
负债和所有者权益	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	-	-

卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	4,805,777.50	72,750,219.30
应付赎回款	3,885,333.10	4,875,591.88
应付管理人报酬	2,178,778.59	2,599,178.49
应付托管费	363,129.76	433,196.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,999,084.13	5,380,967.19
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	699,291.03	2,655,003.29
负债合计	19,931,394.11	88,694,156.55
所有者权益：		
实收基金	2,687,769,741.43	3,132,622,828.33
未分配利润	-1,124,910,886.46	-907,576,639.69
所有者权益合计	1,562,858,854.97	2,225,046,188.64
负债和所有者权益总计	1,582,790,249.08	2,313,740,345.19

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5815 元，基金份额总额 2687769741.43 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴行业轮动股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	-303,223,987.00	47,176,494.60
1.利息收入	1,591,649.70	2,558,182.37
其中：存款利息收入	283,108.65	144,660.53
债券利息收入	1,308,541.05	2,413,521.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	62,498,035.50	-80,604,283.07
其中：股票投资收益	49,797,176.39	-90,932,580.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,164,798.59	77,610.32
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,865,657.70	10,250,687.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-368,027,736.72	124,453,613.04

4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	714,064.52	768,982.26
减：二、费用	35,652,159.88	29,951,366.64
1. 管理人报酬	14,952,508.73	21,030,101.77
2. 托管费	2,492,084.74	3,505,016.97
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,994,875.97	5,205,415.98
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	212,690.44	210,831.92
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-338,876,146.88	17,225,127.96
减：所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-338,876,146.88	17,225,127.96

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：东吴行业轮动股票型证券投资基金

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)	3,132,622,828.33	-907,576,639.69	2,225,046,188.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-338,876,146.88	-338,876,146.88
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)	-444,853,086.90	121,541,900.11	-323,311,186.79
其中：1. 基金申购款	907,269,018.71	-277,073,714.84	630,195,303.87
2. 基金赎回款	-1,352,122,105.61	398,615,614.95	-953,506,490.66
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)	2,687,769,741.43	-1,124,910,886.46	1,562,858,854.97

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)	3,446,840,965.51	-926,545,416.12	2,520,295,549.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,225,127.96	17,225,127.96
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)	-30,652,302.69	-2,414,900.08	-33,067,202.77
其中：1.基金申购款	833,668,525.82	-146,519,065.92	687,149,459.90
2.基金赎回款	-864,320,828.51	144,104,165.84	-720,216,662.67
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)	3,416,188,662.82	-911,735,188.24	2,504,453,474.58

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

东吴行业轮动股票型证券投资基金(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[2008]296号文《关于核准东吴行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》的核准,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2008年4月23日正式生效,首次设立募集规模为3,171,531,068.11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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本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。本基金投资组合中股票

投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，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%。本基金业绩比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中信标普全债指数。

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》、《东吴行业轮动股票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

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，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 0.1%调整为 0.3%。

经国务院批准，财政部、国家税务总局批准，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 0.3%调整为 0.1%。

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 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
华夏银行股份有限公司	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。

6.4.8 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 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	3,282,073,599.47	28.02%	230,166,471.96	6.77%

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	45,864,771.62	62.61%	-	-

债券回购交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

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			
	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	2,954,396.96	27.94%	1,728,298.93	21.61%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1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	193,090.03	6.77%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用，包括但不限于买（卖）经手费、证券
 结算风险基金和上海证券交易所买（卖）证管费等。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 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 的管理费	14,952,508.73
其中：支付销售机构的客 户维护费	3,242,488.98	3,919,198.21

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 1.5%的费率
 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 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

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托管费	2,492,084.74	3,505,016.97

注：支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 × 0.25% / 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。

6.4.8.4 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

本基金管理人本报告期内及上年度可比期间未持有本基金份额。

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

本基金本报告期末及上年度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 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
华夏银行股份有限公司	24,307,428.19	154,163.89	47,551,330.02	113,870.58

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2013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/增发而流通受限的证券。

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
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项临时停牌	28.55	2013年7月24日	34.55	20,000	642,000.00	571,000.00	-
601886	江河创建	2013年6月20日	重大事项临时停牌	12.20	2013年7月16日	13.78	2,759,823	39,080,003.63	33,669,840.60	-

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

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。

6.4.10 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	1,457,296,230.61	92.07
	其中：股票	1,457,296,230.61	92.07
2	固定收益投资	79,744,000.00	5.04
	其中：债券	79,744,000.00	5.04
	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	39,366,819.74	2.49
6	其他各项资产	6,383,198.73	0.40

7	合计	1,582,790,249.08	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	570,955,527.93	36.53
C	制造业	223,457,017.60	14.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	323,262,651.16	20.68
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	86,744,816.94	5.55
J	金融业	60,783,192.01	3.89
K	房地产业	127,502,024.97	8.16
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	64,591,000.00	4.13
S	综合	-	-
	合计	1,457,296,230.61	93.25

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

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	600348	阳泉煤业	14,599,938	131,983,439.52	8.45
2	600157	永泰能源	20,600,000	120,510,000.00	7.71
3	600403	大有能源	10,209,260	86,982,895.20	5.57

4	601699	潞安环能	6,199,941	74,151,294.36	4.74
5	300251	光线传媒	2,000,000	64,020,000.00	4.10
6	002375	亚厦股份	1,884,974	58,057,199.20	3.71
7	600366	宁波韵升	3,500,000	55,265,000.00	3.54
8	603000	人民网	1,239,954	54,446,380.14	3.48
9	002482	广田股份	2,439,922	51,238,362.00	3.28
10	000024	招商地产	2,060,000	50,016,800.00	3.20

注：投资者欲了解本报告期末基金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。

7.4 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	000731	四川美丰	179,709,868.61	8.08
2	300251	光线传媒	160,659,864.26	7.22
3	601336	新华保险	153,704,335.74	6.91
4	600157	永泰能源	145,095,074.09	6.52
5	000933	神火股份	138,467,059.06	6.22
6	600585	海螺水泥	134,315,040.58	6.04
7	600403	大有能源	116,117,963.13	5.22
8	600459	贵研铂业	111,599,641.07	5.02
9	000001	平安银行	110,596,369.14	4.97
10	600028	中国石化	108,937,147.70	4.90
11	300291	华录百纳	107,669,203.49	4.84
12	000060	中金岭南	102,840,805.02	4.62
13	002428	云南锗业	94,999,508.25	4.27
14	300315	掌趣科技	93,504,164.97	4.20
15	601857	中国石油	93,290,852.02	4.19
16	000024	招商地产	84,997,800.33	3.82
17	000049	德赛电池	78,582,559.85	3.53
18	002106	莱宝高科	78,347,375.84	3.52
19	600456	宝钛股份	75,360,958.84	3.39
20	002273	水晶光电	74,920,610.79	3.37
21	002146	荣盛发展	74,344,187.64	3.34

22	603000	人民网	73,767,585.92	3.32
23	601928	凤凰传媒	73,330,681.36	3.30
24	002466	天齐锂业	68,624,363.61	3.08
25	002375	亚厦股份	68,480,652.24	3.08
26	000970	中科三环	66,596,780.08	2.99
27	600633	浙报传媒	66,267,830.04	2.98
28	000525	红太阳	65,275,956.17	2.93
29	600837	海通证券	64,781,273.43	2.91
30	600366	宁波韵升	64,446,170.10	2.90
31	600720	祁连山	64,294,634.41	2.89
32	600143	金发科技	64,115,581.81	2.88
33	600373	中文传媒	63,871,596.74	2.87
34	300104	乐视网	63,644,882.41	2.86
35	600410	华胜天成	63,332,117.57	2.85
36	002663	普邦园林	62,092,978.04	2.79
37	002482	广田股份	60,866,036.80	2.74
38	300352	北信源	59,628,880.17	2.68
39	600362	江西铜业	58,862,701.33	2.65
40	002620	瑞和股份	58,481,932.41	2.63
41	600067	冠城大通	56,830,944.03	2.55
42	601965	中国汽研	56,555,318.95	2.54
43	002385	大北农	54,455,500.26	2.45
44	600395	盘江股份	53,292,933.15	2.40
45	000063	中兴通讯	53,073,369.39	2.39
46	000762	西藏矿业	52,441,958.50	2.36
47	002292	奥飞动漫	50,459,584.86	2.27
48	601390	中国中铁	49,898,961.41	2.24
49	000878	云南铜业	48,737,311.76	2.19
50	000686	东北证券	48,070,842.57	2.16
51	600889	南京化纤	47,858,726.68	2.15
52	002431	棕榈园林	47,538,647.38	2.14
53	002325	洪涛股份	46,430,029.54	2.09
54	600348	阳泉煤业	46,388,309.36	2.08
55	600528	中铁二局	46,057,160.09	2.07
56	601186	中国铁建	45,794,559.52	2.06
57	000960	锡业股份	44,816,688.76	2.01

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

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	000001	平安银行	238,970,171.03	10.74
2	300251	光线传媒	222,128,815.72	9.98
3	000731	四川美丰	201,315,715.83	9.05
4	601336	新华保险	186,283,340.35	8.37
5	600362	江西铜业	172,508,360.00	7.75
6	601601	中国太保	136,825,950.96	6.15
7	600585	海螺水泥	130,093,820.86	5.85
8	600036	招商银行	127,865,732.05	5.75
9	601318	中国平安	125,373,459.14	5.63
10	300315	掌趣科技	118,736,441.51	5.34
11	300291	华录百纳	118,044,570.50	5.31
12	000933	神火股份	114,987,401.41	5.17
13	600028	中国石化	109,282,534.14	4.91
14	000983	西山煤电	108,486,529.94	4.88
15	000060	中金岭南	106,544,280.00	4.79
16	600395	盘江股份	104,906,071.17	4.71
17	601101	昊华能源	94,831,393.04	4.26
18	601166	兴业银行	91,944,986.30	4.13
19	000960	锡业股份	90,917,425.06	4.09
20	601857	中国石油	90,896,158.87	4.09
21	000049	德赛电池	90,040,011.24	4.05
22	002428	云南锗业	84,187,475.42	3.78
23	002273	水晶光电	79,606,522.11	3.58
24	600123	兰花科创	76,722,594.11	3.45
25	600497	驰宏锌锗	75,091,103.05	3.37
26	300104	乐视网	74,803,186.22	3.36
27	600016	民生银行	74,795,443.23	3.36
28	601928	凤凰传媒	70,945,782.43	3.19
29	600456	宝钛股份	69,107,217.22	3.11
30	002106	莱宝高科	68,697,799.04	3.09
31	600000	浦发银行	68,678,360.46	3.09
32	000525	红太阳	68,215,469.57	3.07

33	300352	北信源	66,993,202.10	3.01
34	601628	中国人寿	66,820,570.72	3.00
35	600633	浙报传媒	66,523,794.42	2.99
36	002142	宁波银行	65,144,840.01	2.93
37	601965	中国汽研	63,087,128.64	2.84
38	600373	中文传媒	62,989,567.45	2.83
39	600143	金发科技	62,625,733.72	2.81
40	300113	顺网科技	60,004,555.16	2.70
41	000063	中兴通讯	51,263,812.89	2.30
42	002385	大北农	50,363,920.18	2.26
43	601390	中国中铁	49,853,782.00	2.24
44	600157	永泰能源	48,690,012.17	2.19
45	002292	奥飞动漫	47,728,362.72	2.15
46	600459	贵研铂业	47,297,816.22	2.13
47	601186	中国铁建	46,105,823.55	2.07
48	601009	南京银行	45,562,752.50	2.05
49	000686	东北证券	45,416,359.84	2.04
50	600528	中铁二局	44,620,273.15	2.01

注：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

买入股票成本（成交）总额	5,737,150,890.43
卖出股票收入（成交）总额	6,066,490,992.70

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	-	-
2	央行票据	79,744,000.00	5.10
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	79,744,000.00	5.10
---	----	---------------	------

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	1001079	10 央行票据 79	800,000	79,744,000.00	5.10

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

本基金报告期末未持有权证。

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末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	3,719,471.86
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,718,401.80
5	应收申购款	945,325.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,383,198.73

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末无处于转股期的可转换债券。

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
96,343	27,897.92	532,101,211.78	19.80%	2,155,668,529.65	80.20%

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	-	-

注：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（ 2008 年 4 月 23 日 ）基金份额总额	3,173,064,234.06
本报告期期初基金份额总额	3,132,622,828.33
本报告期基金总申购份额	907,269,018.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,352,122,105.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,687,769,741.43

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

本基金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

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。

10.4 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。

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	
东吴证券	2	3,282,073,596.33	28.02%	2,954,396.96	27.94%	-
中信证券	2	1,578,042,674.35	13.47%	1,432,465.88	13.55%	-
申银万国	1	1,108,149,149.11	9.46%	1,008,853.67	9.54%	-
国泰君安	1	1,033,351,837.22	8.82%	919,895.20	8.70%	-
光大证券	1	972,250,439.48	8.30%	865,840.03	8.19%	-
广发证券	1	842,609,147.70	7.19%	767,111.30	7.26%	-
招商证券	1	712,388,251.12	6.08%	648,552.35	6.13%	-
天源证券	1	538,142,728.78	4.59%	489,922.70	4.63%	-
华泰联合	1	442,624,880.29	3.78%	394,315.14	3.73%	-
民生证券	1	399,439,687.47	3.41%	358,052.74	3.39%	-
中投证券	1	322,903,352.38	2.76%	293,968.58	2.78%	-
平安证券	-	293,691,303.92	2.51%	267,377.50	2.53%	-
安信证券	1	189,055,102.54	1.61%	172,114.67	1.63%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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

本基金本报告期新增 9 个交易单元，退租 1 个交易单元。

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
东吴证券	45,864,771.62	62.61%	-	-	-	-
中信证券	17,546,545.37	23.95%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	2,700,369.38	3.69%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
民生证券	7,148,699.90	9.76%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

东吴基金管理有限公司
2013 年 8 月 29 日