

东吴新产业精选股票型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014 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

送出日期：二〇一四年八月二十八日

§ 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 2014 年 8 月 22 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 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东吴新产业精选股票
基金主代码	580008
交易代码	580008
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	2011 年 9 月 28 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	45,117,376.57 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，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享新兴产业所带来的投资机会，追求超越市场的收益。
投资策略	本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。
业绩比较基准	75%*中证新兴产业指数+25%*中国债券综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的股票型基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐军	田青
	联系电话	021-50509888-8308	010-67595096
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tianqing1.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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,630,581.32
本期利润	4,270,171.38
加权平均基金份额本期利润	0.0950
本期基金份额净值增长率	6.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2990
期末基金资产净值	58,608,393.06
期末基金份额净值	1.299

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

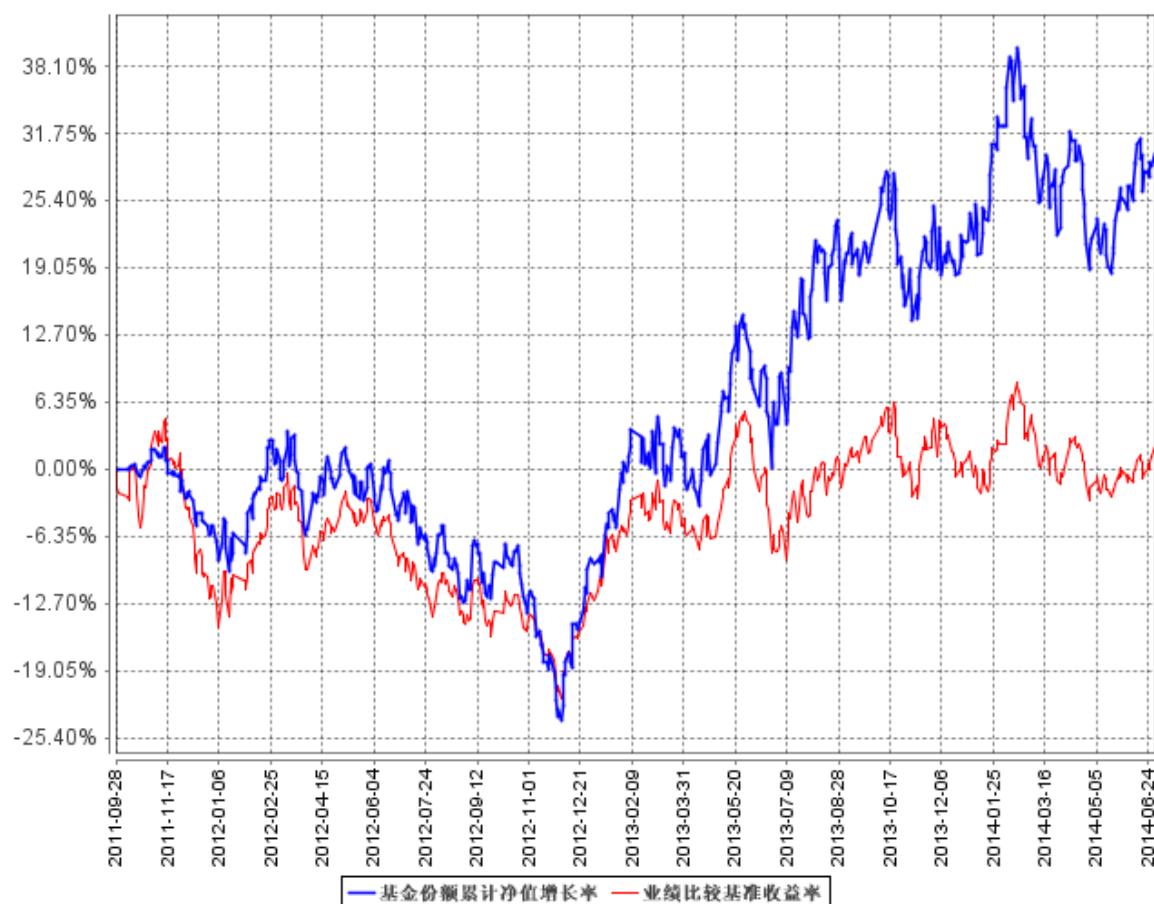
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.42%	1.11%	2.54%	0.68%	0.88%	0.43%
过去三个月	5.78%	1.22%	3.70%	0.75%	2.08%	0.47%
过去六个月	6.74%	1.39%	1.09%	0.92%	5.65%	0.47%
过去一年	24.54%	1.48%	12.72%	1.04%	11.82%	0.44%
自基金合同生效起至今	29.90%	1.39%	2.25%	1.11%	27.65%	0.28%

注：比较基准= 75%*中证新兴产业指数收益率 +25%*中国债券综合全价指数收益率

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= 75%*中证新兴产业指数收益率 +25%*中国债券综合全价指数收益率

2. 本基金于 2011 年 9 月 28 日成立。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，建仓期结束基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

§ 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 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 17 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 4 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、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金；混合型基金 5 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、东吴阿尔法灵活配置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。

今年上半年，宏观形势较以往更为错综复杂，我国经济仍处于增长转型和结构调整的阵痛期，资本市场持续低迷，使得整个基金行业都面临极其艰难的经营环境。面对复杂的政策和市场环境，公司上半年投资业绩取得了较好的成绩，在 70 余家基金公司中公司权益类基金投资能力位列第 16 位。截至 6 月底，公司 10 只权益类基金有 7 只基金排名进入同类基金前二分之一，有 3 只基金进入同类基金前四分之一，其中东吴嘉禾基金在混合型基金中排名第一。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。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		
刘元海	本基金基金经理、投资管理部副总经理	2011 年 10 月 26 日	-	10 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；现担任投资管理部副总经理、东吴新产业精选

					股票基金经理、东吴内需增长混合型证券投资基金经理、东吴行业轮动股票型证券投资基金基金经理。
戴斌	本基金基金经理	2013 年 12 月 24 日	-	7.5 年	硕士，英国格拉斯哥大学经济、银行与金融学专业毕业。自 2007 年 1 月起加入东吴基金管理有限公司，一直从事证券投资研究工作，曾任研究部宏观经济、金融工程研究员，产品策划部产品设计研究员，基金经理助理，现担任东吴新产业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

2014 年上半年，整体经济环境趋于复杂。调结构背景下，宏观经济正在经历去杠杆的阵痛。尤其在一季度，汇丰 PMI 数据环比连续三个月运行在荣枯线以下，显示经济有向下破位的风险。出于对经济加速下行的担忧，管理层适时出台了包括区域振兴、限购放松等系列稳增长措施，对其后二季度的经济运行产生了正面影响。中采及汇丰 PMI 数据连续改善。加上海外经济向好，出口也出现明显复苏。但投资数据并不乐观，地产投资增速继续下滑，同时企业投资增速也并未明显改善，这为下阶段经济运行增加了一丝不确定性。

流动性整体保持了较为宽松的环境。即使在 6 月末也并未出现类似去年同期一度失控的流动性紧张的局面。

管理层也对维护市场稳定运行显示出了足够的诚意。通过对沪港通等制度的前期研究，以及控制新股发行节奏等方式，稳定了市场脆弱的预期。

资本市场在上半年经历了较为明显的震荡，尤其是以创业板为代表的小市值股。创业板指数整体上涨 7.69%，但在 2 月下旬开始经历了一波明显的回调，此后虽有反弹，但整体呈现了震荡下行的态势。上证综指则始终保持在一个相对窄的区间内震荡，整体下跌 3.20%。

上半年新产业精选基金坚持了以成长股为导向的投资思路，集中配置了高景气度的 LED、消费电子、油气、软件等行业，并坚持自下而上精选个股，取得了较为明显的收益。

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 1.299 元，累计净值 1.299 元；本报告期份额净值增长率 6.74%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年的市场运行态势较之上半年可能更为复杂。一方面，政府微刺激的效果至少还需观察。考虑到去年较高的基数，三季度经济数据同比改善的可能性并不大；另一方面，落实到上市公司的业绩，企业端三季报环比大概率会回落；再次，IPO 重启可能使市场资金面短期偏紧成为常态；最后，整体流动性进一步放松的可能性并不大。换句话说，在其他变量边际改善幅度有限的情况下，经济基本面向下对股市的影响可能在未来两个月内逐步显现。

新产业精选基金始终坚持自下而上选股的投资策略，未来会坚持在景气度最确定的细分行业进行布局，坚持以成长股为投资方向。

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、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：东吴新产业精选股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	13,610,500.72	14,162,739.90
结算备付金	198,918.99	155,296.51
存出保证金	59,936.58	60,397.00
交易性金融资产	41,345,570.02	50,160,649.73
其中：股票投资	41,345,570.02	50,160,649.73
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	4,000,000.00	-

应收证券清算款	2,381,781.58	369,609.39
应收利息	2,261.54	3,195.05
应收股利	-	-
应收申购款	163,970.44	119,666.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	61,762,939.87	65,031,554.29
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2014 年 6 月 30 日	2013 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	2,300,033.42	-
应付赎回款	442,760.10	704,460.13
应付管理人报酬	71,048.98	80,758.65
应付托管费	11,841.51	13,459.76
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	138,783.54	105,749.43
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	190,079.26	282,528.02
负债合计	3,154,546.81	1,186,955.99
所有者权益：		
实收基金	45,117,376.57	52,466,949.37
未分配利润	13,491,016.49	11,377,648.93
所有者权益合计	58,608,393.06	63,844,598.30
负债和所有者权益总计	61,762,939.87	65,031,554.29

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.299 元，基金份额总额 45,117,376.57 份。

6.2 利润表

会计主体：东吴新产业精选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	5,649,846.25	9,086,410.58
1.利息收入	38,676.17	33,891.40
其中：存款利息收入	36,541.73	33,891.40

债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,134.44	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	9,939,026.31	11,888,017.56
其中：股票投资收益	9,655,153.82	11,712,700.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	283,872.49	175,316.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,360,409.94	-2,895,633.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	32,553.71	60,134.83
减：二、费用	1,379,674.87	1,445,853.38
1. 管理人报酬	424,288.23	448,456.48
2. 托管费	70,714.68	74,742.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	685,973.33	725,020.30
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	198,698.63	197,633.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,270,171.38	7,640,557.20
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,270,171.38	7,640,557.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新产业精选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	52,466,949.37	11,377,648.93	63,844,598.30
二、本期经营活动产生	-	4,270,171.38	4,270,171.38

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）	-7,349,572.80	-2,156,803.82	-9,506,376.62
其中：1.基金申购款	15,170,612.70	4,648,015.56	19,818,628.26
2.基金赎回款	-22,520,185.50	-6,804,819.38	-29,325,004.88
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）	45,117,376.57	13,491,016.49	58,608,393.06
项目	上年度可比期间 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）	67,457,214.66	-5,700,601.82	61,756,612.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,640,557.20	7,640,557.20
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）	-16,467,296.58	237,414.66	-16,229,881.92
其中：1.基金申购款	47,952,332.04	2,659,727.50	50,612,059.54
2.基金赎回款	-64,419,628.62	-2,422,312.84	-66,841,941.46
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）	50,989,918.08	2,177,370.04	53,167,288.12

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

基金管理人负责人

吕晖

主管会计工作负责人

袁渊

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东吴新产业精选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[2011]1021号《关于同意东吴新产业精选股票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2011年9月28日正式生效，首次设立募集规模为281,594,106.37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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为股票型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的60%-95%，其中，投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于股票资产的80%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，固定收益类资产投资比例为基金资产的0-35%，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%。

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》、《东吴新产业精选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，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
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

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	307,185,692.49	68.23%	102,156,594.91	21.68%

债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	14,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2014年1月1日至2014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	273,151.23	67.85%	138,783.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	90,898.14	21.36%	24,053.36	7.54%

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付	424,288.23	448,456.48

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	168,105.77	160,842.27

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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,714.68	74,742.81

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 0.25% 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

本基金不收取销售服务费

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

份额单位：份

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 9 月 28 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	9,999,200.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	9,999,200.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：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。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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
中国建设银行股份有限公司	13,610,500.72	33,443.21	6,625,626.31	30,231.08

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（2014 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
000547	闽福发 A	2014 年 4 月 17 日	重大事项停牌	5.97	-	-	179,929	1,077,902.29	1,074,176.13	-

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交易所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	41,345,570.02	66.94
	其中：股票	41,345,570.02	66.94
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	4,000,000.00	6.48
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,809,419.71	22.36
7	其他各项资产	2,607,950.14	4.22
8	合计	61,762,939.87	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	31,355,905.70	53.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,309,004.50	3.94
G	交通运输、仓储和邮政业	2,105,388.00	3.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,021,321.02	5.16
J	金融业	1,654,244.00	2.82

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	899,706.80	1.54
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	41,345,570.02	70.55

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	300303	聚飞光电	279,878	5,146,956.42	8.78
2	600703	三安光电	166,560	3,902,500.80	6.66
3	600261	阳光照明	329,056	3,251,073.28	5.55
4	002005	德豪润达	371,700	3,111,129.00	5.31
5	002309	中利科技	162,158	2,819,927.62	4.81
6	300219	鸿利光电	173,000	2,335,500.00	3.98
7	300309	吉艾科技	115,404	2,323,082.52	3.96
8	600175	美都控股	401,566	2,309,004.50	3.94
9	002245	澳洋顺昌	225,900	2,105,388.00	3.59
10	300232	洲明科技	88,600	2,047,546.00	3.49

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	300183	东软载波	7,848,097.21	12.29
2	300219	鸿利光电	7,461,486.82	11.69

3	600703	三安光电	5,143,040.05	8.06
4	002005	德豪润达	4,656,896.86	7.29
5	300303	聚飞光电	4,650,513.90	7.28
6	000400	许继电气	4,317,548.18	6.76
7	600261	阳光照明	4,282,221.51	6.71
8	300172	中电环保	4,130,021.65	6.47
9	000712	锦龙股份	4,064,778.00	6.37
10	600739	辽宁成大	3,723,860.98	5.83
11	002309	中利科技	3,721,591.24	5.83
12	600340	华夏幸福	3,587,108.40	5.62
13	600446	金证股份	3,498,680.75	5.48
14	600787	中储股份	3,422,274.80	5.36
15	600089	特变电工	3,403,430.19	5.33
16	300326	凯利泰	3,391,847.00	5.31
17	600270	外运发展	3,241,033.91	5.08
18	600588	用友软件	3,141,923.00	4.92
19	300070	碧水源	3,051,700.70	4.78
20	600292	中电远达	2,813,305.60	4.41
21	300337	银邦股份	2,737,603.37	4.29
22	002131	利欧股份	2,637,860.07	4.13
23	600175	美都控股	2,455,284.00	3.85
24	300309	吉艾科技	2,324,506.01	3.64
25	002402	和而泰	2,310,290.40	3.62
26	002690	美亚光电	2,247,798.80	3.52
27	300255	常山药业	2,241,468.95	3.51
28	300136	信维通信	2,201,272.19	3.45
29	002245	澳洋顺昌	2,011,862.00	3.15
30	600967	北方创业	1,947,907.00	3.05
31	300315	掌趣科技	1,929,274.81	3.02
32	002018	华星化工	1,928,079.15	3.02
33	000581	威孚高科	1,898,554.65	2.97
34	002456	欧菲光	1,861,851.32	2.92
35	300128	锦富新材	1,848,784.44	2.90
36	600284	浦东建设	1,843,162.06	2.89
37	002185	华天科技	1,833,318.45	2.87
38	600460	士兰微	1,832,756.50	2.87

39	600880	博瑞传播	1,817,483.00	2.85
40	002148	北纬通信	1,781,996.28	2.79
41	300232	洲明科技	1,745,337.12	2.73
42	002219	恒康医疗	1,662,706.65	2.60
43	300133	华策影视	1,660,064.00	2.60
44	601700	风范股份	1,640,248.55	2.57
45	600016	民生银行	1,635,624.00	2.56
46	600030	中信证券	1,633,784.00	2.56
47	600729	重庆百货	1,622,247.00	2.54
48	300347	泰格医药	1,619,629.16	2.54
49	300155	安居宝	1,615,484.55	2.53
50	000513	丽珠集团	1,612,914.67	2.53
51	600436	片仔癀	1,608,253.95	2.52
52	002449	国星光电	1,586,551.60	2.49
53	300217	东方电热	1,580,406.84	2.48
54	603000	人民网	1,536,782.56	2.41
55	300334	津膜科技	1,488,190.42	2.33
56	300339	润和软件	1,482,495.00	2.32
57	300275	梅安森	1,471,824.07	2.31
58	600633	浙报传媒	1,436,387.66	2.25
59	000802	北京旅游	1,434,139.00	2.25
60	300306	远方光电	1,429,137.95	2.24
61	002115	三维通信	1,421,389.00	2.23
62	000823	超声电子	1,410,740.40	2.21
63	300170	汉得信息	1,407,188.53	2.20
64	600312	平高电气	1,401,838.00	2.20
65	002658	雪迪龙	1,390,189.80	2.18
66	600804	鹏博士	1,382,319.00	2.17
67	300077	国民技术	1,360,100.85	2.13
68	600571	信雅达	1,350,698.00	2.12
69	300084	海默科技	1,340,788.00	2.10
70	600266	北京城建	1,333,282.00	2.09
71	002007	华兰生物	1,310,290.82	2.05
72	601311	骆驼股份	1,307,269.00	2.05
73	600335	国机汽车	1,304,293.98	2.04
74	300190	维尔利	1,301,259.14	2.04

75	300058	蓝色光标	1,299,766.00	2.04
76	601126	四方股份	1,295,345.00	2.03
77	002643	烟台万润	1,283,241.61	2.01

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	300183	东软载波	6,351,105.32	9.95
2	300219	鸿利光电	6,230,450.49	9.76
3	600703	三安光电	5,964,716.00	9.34
4	000400	许继电气	4,558,424.11	7.14
5	002415	海康威视	4,059,380.69	6.36
6	600340	华夏幸福	3,796,574.19	5.95
7	002185	华天科技	3,754,702.66	5.88
8	300128	锦富新材	3,716,403.36	5.82
9	600739	辽宁成大	3,491,165.40	5.47
10	300326	凯利泰	3,444,801.37	5.40
11	600270	外运发展	3,433,113.07	5.38
12	300347	泰格医药	3,369,989.11	5.28
13	600787	中储股份	3,298,968.42	5.17
14	600089	特变电工	3,231,875.00	5.06
15	300172	中电环保	3,228,909.90	5.06
16	600588	用友软件	3,126,318.84	4.90
17	000581	威孚高科	3,111,534.64	4.87
18	600446	金证股份	3,068,305.38	4.81
19	002241	歌尔声学	2,876,104.71	4.50
20	300070	碧水源	2,813,624.75	4.41
21	002131	利欧股份	2,807,437.77	4.40
22	000712	锦龙股份	2,750,350.63	4.31
23	300155	安居宝	2,694,425.44	4.22
24	600292	中电远达	2,639,762.98	4.13
25	300334	津膜科技	2,420,561.62	3.79
26	002690	美亚光电	2,368,253.64	3.71
27	300255	常山药业	2,323,662.85	3.64
28	600867	通化东宝	2,304,150.60	3.61

29	002465	海格通信	2,249,022.28	3.52
30	600460	士兰微	2,226,550.47	3.49
31	300203	聚光科技	2,218,013.58	3.47
32	300136	信维通信	2,214,113.20	3.47
33	002402	和而泰	2,209,524.85	3.46
34	600872	中炬高新	2,169,702.47	3.40
35	300115	长盈精密	2,069,548.00	3.24
36	002309	中利科技	2,034,224.17	3.19
37	300315	掌趣科技	2,033,933.08	3.19
38	002456	欧菲光	1,967,418.72	3.08
39	600880	博瑞传播	1,949,498.94	3.05
40	600967	北方创业	1,925,061.40	3.02
41	002148	北纬通信	1,896,271.60	2.97
42	002018	华星化工	1,867,430.00	2.92
43	300217	东方电热	1,825,664.37	2.86
44	600261	阳光照明	1,816,705.25	2.85
45	600312	平高电气	1,760,635.00	2.76
46	600284	浦东建设	1,760,581.06	2.76
47	300133	华策影视	1,758,375.74	2.75
48	000513	丽珠集团	1,728,133.78	2.71
49	002005	德豪润达	1,692,610.16	2.65
50	002064	华峰氨纶	1,681,018.72	2.63
51	300337	银邦股份	1,658,902.94	2.60
52	002219	恒康医疗	1,657,546.78	2.60
53	601700	风范股份	1,655,936.22	2.59
54	002104	恒宝股份	1,625,260.96	2.55
55	600335	国机汽车	1,587,962.00	2.49
56	600016	民生银行	1,579,654.19	2.47
57	601311	骆驼股份	1,574,146.12	2.47
58	300339	润和软件	1,573,046.84	2.46
59	002063	远光软件	1,537,395.50	2.41
60	002449	国星光电	1,528,454.00	2.39
61	600266	北京城建	1,519,000.00	2.38
62	000915	山大华特	1,505,812.34	2.36
63	600030	中信证券	1,493,317.95	2.34
64	603000	人民网	1,486,879.26	2.33
65	300190	维尔利	1,474,524.49	2.31
66	300084	海默科技	1,468,474.80	2.30

67	600571	信雅达	1,454,862.10	2.28
68	600436	片仔癀	1,449,962.64	2.27
69	300077	国民技术	1,428,693.10	2.24
70	300170	汉得信息	1,400,490.97	2.19
71	300058	蓝色光标	1,398,781.55	2.19
72	000823	超声电子	1,393,981.50	2.18
73	300275	梅安森	1,387,829.02	2.17
74	601012	隆基股份	1,364,405.63	2.14
75	600633	浙报传媒	1,363,887.68	2.14
76	600729	重庆百货	1,356,716.00	2.13
77	002007	华兰生物	1,353,556.87	2.12
78	002115	三维通信	1,351,098.00	2.12
79	000063	中兴通讯	1,345,105.60	2.11
80	000802	北京旅游	1,341,886.55	2.10
81	002658	雪迪龙	1,339,452.94	2.10
82	600804	鹏博士	1,327,172.00	2.08
83	600887	伊利股份	1,307,610.00	2.05
84	601965	中国汽研	1,305,002.55	2.04

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

买入股票成本（成交）总额	218,143,192.06
卖出股票收入（成交）总额	232,253,015.65

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末持有股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	59,936.58
2	应收证券清算款	2,381,781.58
3	应收股利	-
4	应收利息	2,261.54

5	应收申购款	163,970.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,607,950.14

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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
2,971	15,185.92	0.00	0.00%	45,117,376.57	100.00%

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	809.00	0.0018%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-

本基金基金经理持有本开放式基金	-
-----------------	---

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（ 2011 年 9 月 28 日 ）基金份额总额	281,594,106.37
本报告期期初基金份额总额	52,466,949.37
本报告期基金总申购份额	15,170,612.70
减：本报告期基金总赎回份额	22,520,185.50
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	45,117,376.57

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

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为江苏天衡会计师事务所（特殊普通合伙）。

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	307,185,692.49	68.23%	273,151.23	67.85%	-
国信证券	1	113,396,313.46	25.19%	103,235.37	25.64%	-
中银国际	1	29,618,572.96	6.58%	26,209.51	6.51%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期退租 1 个交易单元：第一创业。

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	-	-	14,000,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

§ 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
2014 年 8 月 28 日