

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2015 年半年度报告

2015 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：二〇一五年八月二十七日

§ 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 2015 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2015 年 01 月 01 日起至 06 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
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	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 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	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）
基金简称	东吴深证 100 指数增强（LOF）
场内简称	东吴 100
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（LOF）
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	12,528,469.22 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	2012-04-27

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	徐军	田青

	联系电话	021-50509888-8308	010-67595096
	电子邮箱	xuj@scfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	010-67595096
传真		021-50509888-8211	010-66275853
注册地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海浦东源深路 279 号	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		任少华	王洪章

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、上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	26,204,281.18
本期利润	18,157,498.55
加权平均基金份额本期利润	0.5256
本期加权平均净值利润率	40.26%
本期基金份额净值增长率	36.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,675,301.02
期末可供分配基金份额利润	0.5328
期末基金资产净值	19,203,770.24
期末基金份额净值	1.533
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.30%

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。

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①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.42%	3.58%	-7.67%	3.32%	-0.75%	0.26%
过去三个月	12.31%	2.62%	12.65%	2.51%	-0.34%	0.11%
过去六个月	36.27%	2.20%	37.97%	2.10%	-1.70%	0.10%
过去一年	94.79%	1.74%	95.95%	1.69%	-1.16%	0.05%
过去三年	65.19%	1.46%	65.53%	1.44%	-0.34%	0.02%
自基金合同 生效起至今	53.30%	1.41%	53.45%	1.42%	-0.15%	-0.01%

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、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。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，公司股东为东吴证券股份有限公司（占 70%股份）、上海兰生（集团）有限公司（占 30%股份）。

作为传统吴文化与前沿经济理念的有机结合，东吴基金崇尚“以人为本，以市场为导向，以客户为中心，以价值创造为根本出发点”的经营理念；遵循“诚而有信、稳而又健、和而有铮、勤而又专、有容乃大”的企业格言；树立了“做价值的创造者、市场的创新者和行业的思想者”

的远大理想，创造性地树立公司独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 18 只公募基金，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 6 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、东吴移动互联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。

此外，管理专户资产管理计划 27 只；子公司专项资产管理计划 79 个。

公司管理的资产总规模为 486.05 亿元，其中公募基金 131.96 亿元，专户资产 57.2 亿元，子公司 296.89 亿元。公司管理的资产规模较年初新增 182.35 亿元。

今年上半年市场迎来了牛市行情，基金业绩提升比较大。公司本着为投资者创造绝对收益的宗旨，秉持更好回报投资者的信念，积极提高基金经理对牛市行情的把握能力，加大与上市公司及机构间的沟通，上半年基金投资取得了不错的成绩。根据中国银河证券研究所基金研究中心数据显示，截至 6 月 30 日，公司 17 只基金中有 7 只基金今年以来的净值增长率排名进入同类基金前二分之一，有 1 只基金进入同类基金前四分之一。

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		
周健	本基金基金经理	2013 年 6 月 5 日	—	8 年	硕士，南开大学毕业。曾就职于海通证券；2011 年 5 月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研

					究策划部研究员，现担任东吴中证新兴指数基金基金经理、东吴深证 100 指数增强型证券投资基金基金经理（LOF）。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期为公司对外公告之日；

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，因赎回等原因，本基金 2015 年 4 月 30 日至 2015 年 6 月 30 日出现连续四十二个交易日基金资产净值低于 5000 万元的情形，除此之外，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

从上半年的数据来看，虽然地产销量创新高，但是汽车、纺织服装等其他行业的需求水平有走弱迹象，钢铁、水泥等工业品价格水平仍然疲软，这显示在货币宽松政策的推动下，需求并没有明显回暖，而且其向生产面的传导效应也并不顺畅，经济下行压力仍在。上半年沪深 300 指数上涨 26%，创业板指上涨 94%，深 100 指数的配置较为均衡，涨幅介于两者之间。报告期内，本基金主要采用复制指数配置与行业内量化选股的策略，严格控制仓位，在日常的基金操作中积极应对申购赎回，并在个股配置上进行适度偏离，力争获得超额收益。

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 1.533 元，累计净值 1.533 元；本报告期份额净值增长率 36.27%，同期业绩比较基准收益率为 37.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段经济和市场运行形势，个人认为国内经济下行压力仍然存在，随着城投债置换政策和财政政策的不断推进，基建投资有望回升，拉动总需求。但是股市去杠杆令实体暂时失去直接融资渠道，增加了经济结构转型的难度，拉长了经济寻底的时间。后续金融市场改革、国企改革等都将逐步进入兑现阶段，在当前股市估值水平下，会形成很多的投资机会。

深证 100 指数行业分布均衡合理，指数成分股成长性较高，流动性较好，中长期的投资价值明显。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、副总经理、运营总监、基金会计、基金投资总部总经理、监察稽核人员等组成，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

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金 2015 年 4 月 30 日至 2015 年 6 月 30 日出现连续四十二个交易日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,215,120.98	6,474,224.18
结算备付金		31,447.70	49,053.40
存出保证金		26,539.88	7,765.20
交易性金融资产	6.4.7.2	18,170,092.07	66,561,498.46
其中：股票投资		18,170,092.07	66,561,498.46
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		166,616.02	131,601.69
应收利息	6.4.7.5	297.00	1,856.37
应收股利		-	-
应收申购款		51,309.33	99,112.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		19,661,422.98	73,325,111.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		-	-
应付证券清算款		-	225,225.92
应付赎回款		155,678.61	282,566.00
应付管理人报酬		18,387.49	47,949.90
应付托管费		2,758.14	7,192.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	50,467.85	47,594.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	230,360.65	360,462.78
负债合计		457,652.74	970,991.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,528,469.22	64,287,371.15
未分配利润	6.4.7.10	6,675,301.02	8,066,749.05
所有者权益合计		19,203,770.24	72,354,120.20
负债和所有者权益总计		19,661,422.98	73,325,111.74

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.533 元，基金份额总额 12,528,469.22 份。

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		18,961,542.71	-3,493,213.88
1.利息收入		13,337.26	13,732.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,337.26	13,732.88
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,908,828.67	-3,039,751.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,771,121.40	-3,623,389.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	137,707.27	583,638.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,046,782.63	-481,548.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	86,159.41	14,353.40
减：二、费用		804,044.16	750,923.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	225,125.80	247,625.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,768.93	37,143.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	258,407.34	137,977.27
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	286,742.09	328,176.68
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		18,157,498.55	-4,244,136.99
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		18,157,498.55	-4,244,136.99

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: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	64,287,371.15	8,066,749.05	72,354,120.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,157,498.55	18,157,498.55
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)	-51,758,901.93	-19,548,946.58	-71,307,848.51
其中: 1. 基金申购款	30,295,192.01	8,584,634.87	38,879,826.88
2. 基金赎回款	-82,054,093.94	-28,133,581.45	-110,187,675.39
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)	12,528,469.22	6,675,301.02	19,203,770.24
项目	上年度可比期间 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	58,484,199.73	-8,279,135.33	50,205,064.40

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,244,136.99	-4,244,136.99
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）	676,461.47	-95,646.80	580,814.67
其中：1.基金申购款	18,134,995.48	-3,949,257.23	14,185,738.25
2.基金赎回款	-17,458,534.01	3,853,610.43	-13,604,923.58
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）	59,160,661.20	-12,618,919.12	46,541,742.08

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

沈静

会计机构负责人

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为东吴基金管理有限公司，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》、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）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与最近一期年度报告相一致，会计估计有调整。

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

根据中国证券投资基金业协会关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知，本基金自 2015 年 3 月 24 日起，对交易所市场上上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券品种以外的固定收益品种估值时，由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。本基金对该会计估计变更采用未来适用法，经测算新估值标准实施日的相关调整对前一估值日基金资产净值的影响未超过 0.5%。

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
----	-----

	2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,215,120.98
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	1,215,120.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		13,082,390.68	18,170,092.07	5,087,701.39
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		13,082,390.68	18,170,092.07	5,087,701.39

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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	271.00
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	14.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.90
合计	297.00

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 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	50,467.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	50,467.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	524.22
预提费用	179,836.43
应付指数使用费	50,000.00
合计	230,360.65

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	64,287,371.15	64,287,371.15
本期申购	30,295,192.01	30,295,192.01
本期赎回(以“-”号填列)	-82,054,093.94	-82,054,093.94

- 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	12,528,469.22	12,528,469.22

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；

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。

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	-11,560,581.16	19,627,330.21	8,066,749.05
本期利润	26,204,281.18	-8,046,782.63	18,157,498.55
本期基金份额交易产生的变动数	-4,040,031.73	-15,508,914.85	-19,548,946.58
其中：基金申购款	780,693.11	7,803,941.76	8,584,634.87
基金赎回款	-4,820,724.84	-23,312,856.61	-28,133,581.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,603,668.29	-3,928,367.27	6,675,301.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,394.54
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	790.04
其他	152.68
合计	13,337.26

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

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	109,338,445.10
减：卖出股票成本总额	82,567,323.70
买卖股票差价收入	26,771,121.40

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券交易。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未进行资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具交易。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期未进行其他衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	137,707.27
基金投资产生的股利收益	—
合计	137,707.27

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,046,782.63
——股票投资	-8,046,782.63
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,046,782.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	86,159.41
合计	86,159.41

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	258,407.34
银行间市场交易费用	-
合计	258,407.34

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	120,330.87
上市费	29,752.78

汇划费	2,405.66
指数使用费	100,000.00
帐户维护费	4,500.00
合计	286,742.09

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。

6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	123,750,444.33	82.72%	72,024,192.17	77.27%

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

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回购交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	110,036.19	82.78%	50,467.85	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	63,993.22	76.98%	29,315.22	70.05%

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。

6.4.10.2 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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	225,125.80	247,625.31
其中：支付销售机构的客户维护费	41,330.00	65,235.27

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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,768.93	37,143.85

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% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值 X 0.15% / 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。

6.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 3 月 9 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	6,303,909.21	-
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	-	-
期末持有的基金份额	6,303,909.21	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	50.3167%	-

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。

6.4.10.4.2 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

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。

6.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	1,215,120.98	12,394.54	3,164,939.22	12,200.46

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。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 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/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.2 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
000709	河北钢铁	2015 年 6 月 30 日	临时停牌	7.00	2015 年 8 月 24 日	6.30	62,794	254,027.86	439,558.00	-
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	临时停牌	20.75	-	-	8,896	116,441.29	184,592.00	-
000839	中信国安	2015 年 6 月 29 日	临时停牌	23.57	-	-	5,697	68,456.08	134,278.29	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	临时停牌	71.48	2015 年 8 月 5 日	69.20	1,669	97,264.12	119,300.12	-
000878	云南铜业	2015 年 6 月 8 日	临时停牌	24.50	-	-	3,905	54,167.07	95,672.50	-
002353	杰瑞股份	2015 年 5 月 27 日	临时停牌	44.35	-	-	1,120	40,511.10	49,672.00	-
002001	新 和 成	2015 年 6 月 30 日	临时停牌	17.09	2015 年 7 月 13 日	18.49	2,780	44,478.07	47,510.20	-
002069	獐 子 岛	2015 年 6 月 1 日	临时停牌	19.76	-	-	1,700	25,869.65	33,592.00	-

		日								
002292	奥飞动漫	2015 年 5 月 18 日	重大事项停牌	37.29	-	-	2,358	42,886.93	87,929.82	-
002106	莱宝高科	2015 年 4 月 6 日	重大事项停牌	18.93	-	-	7,738	108,559.37	146,480.34	-
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项停牌	30.81	-	-	5,793	111,230.98	178,482.33	-
000778	新兴铸管	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	10.16	-	-	20,095	110,762.40	204,165.20	-
000630	铜陵有色	2015 年 3 月 9 日	重大事项停牌	10.32	-	-	37,230	264,129.05	384,213.60	-
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大事项停牌	36.50	-	-	16,823	329,470.33	614,039.50	-

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

本基金本报告期末未持有无交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票、债券、权证和法律法规或中国证监会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。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。公司经营管理层下设风险管理委员会，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，公司具体的风险管理职责由风险管理部负责，组织、协调并与监察稽核部及其他各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的

管理，并定期向公司的风险管理委员会报告公司风险状况。监察稽核部与风险管理部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

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

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。本基金所持交易性金融资产均在证券交易所上市，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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	1,215,120.98	-	-	-	-	-	1,215,120.98
清算备付金	31,447.70	-	-	-	-	-	31,447.70
存出保证金	26,539.88	-	-	-	-	-	26,539.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	18,170,092.07	18,170,092.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	166,616.02	166,616.02
应收利息	-	-	-	-	-	297.00	297.00
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	51,309.33	51,309.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,273,108.56	-	-	-	-	18,388,314.42	19,661,422.98
负债							

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	155,678.61	155,678.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,387.49	18,387.49
应付托管费	-	-	-	-	-	2,758.14	2,758.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,467.85	50,467.85
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	230,360.65	230,360.65
负债总计	-	-	-	-	-	457,652.74	457,652.74
利率敏感度缺口	1,273,108.56	-	-	-	-	-17,930,661.68	19,203,770.24
上年度末 2014 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	6,474,224.18	-	-	-	-	-	6,474,224.18
清算备付金	49,053.40	-	-	-	-	-	49,053.40
存出保证金	7,765.20	-	-	-	-	-	7,765.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-66,561,498.46	66,561,498.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	131,601.69	131,601.69
应收利息	-	-	-	-	-	1,856.37	1,856.37
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	99,112.44	99,112.44
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,531,042.78	-	-	-	-	-66,794,068.96	73,325,111.74
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	225,225.92	225,225.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	282,566.00	282,566.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,949.90	47,949.90
应付托管费	-	-	-	-	-	7,192.46	7,192.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	47,594.48	47,594.48
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	360,462.78	360,462.78
负债总计	-	-	-	-	-	970,991.54	970,991.54
利率敏感度缺口	6,531,042.78	-	-	-	-	-65,823,077.42	72,354,120.20

注：表中所示为本基金资产及负债的利率风险敞口，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日

孰早者予以分类。

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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为股票型指数增强基金，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金原则上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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	上年度末
----	-----	------

	2015 年 6 月 30 日		2014 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	18,170,092.07	94.62	66,561,498.46	91.99
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	18,170,092.07	94.62	66,561,498.46	91.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金选用业绩基准作为衡量系统风险的标准		
	2. 选用报告期间统计所得 beta 值作为期末系统风险对本基金的影响系数		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
	1. 业绩基准下跌 1%	-199,719.21	-715,292.83
	2. 业绩基准下跌 5%	-998,596.05	-3,576,464.16
	3. 业绩基准下跌 10%	1,997,192.10	-7,152,928.32

注: 报告期内, 本基金 beta 值为 1.04, 2014 年 beta 值为 0.99。

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	18,170,092.07	92.41
	其中: 股票	18,170,092.07	92.41
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	-	-
	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	1,246,568.68	6.34
7	其他各项资产	244,762.23	1.24
8	合计	19,661,422.98	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	33,592.00	0.17
B	采矿业	326,226.90	1.70
C	制造业	10,301,286.69	53.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,924.18	0.44
E	建筑业	160,344.72	0.83
F	批发和零售业	379,660.22	1.98
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	1,117,160.69	5.82
J	金融业	1,916,635.34	9.98
K	房地产业	1,436,201.99	7.48
L	租赁和商务服务业	332,679.58	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	509,923.85	2.66
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	397,909.02	2.07
S	综合	111,103.72	0.58
	合计	17,107,648.90	89.08

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	38,099.88	0.20
C	制造业	437,851.27	2.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,868.28	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,661.24	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	63,783.72	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,585.57	0.30
J	金融业	143,031.39	0.74
K	房地产业	33,495.00	0.17
L	租赁和商务服务业	147,009.90	0.77
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	43,260.66	0.23
R	文化、体育和娱乐业	50,796.26	0.26
S	综合	-	-
	合计	1,062,443.17	5.53

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

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	000651	格力电器	11,916	761,432.40	3.97
2	000024	招商地产	16,823	614,039.50	3.20
3	000002	万科A	36,666	532,390.32	2.77
4	000709	河北钢铁	62,794	439,558.00	2.29
5	000783	长江证券	30,795	429,590.25	2.24
6	000001	平安银行	28,817	418,999.18	2.18
7	000625	长安汽车	18,638	394,193.70	2.05
8	000630	铜陵有色	37,230	384,213.60	2.00
9	000333	美的集团	10,000	372,800.00	1.94

10	002415	海康威视	7,509	336,403.20	1.75
11	002241	歌尔声学	9,092	326,402.80	1.70
12	000768	中航飞机	6,914	301,312.12	1.57
13	300024	机器人	3,834	296,214.84	1.54
14	000100	TCL 集团	51,190	289,223.50	1.51
15	000725	京东方 A	51,617	267,892.23	1.39
16	002024	苏宁云商	17,017	260,360.10	1.36
17	000858	五 粮 液	8,017	254,138.90	1.32
18	000063	中兴通讯	10,496	249,909.76	1.30
19	000776	广发证券	11,015	249,489.75	1.30
20	000166	申万宏源	14,822	240,857.50	1.25
21	000069	华侨城 A	17,794	230,966.12	1.20
22	002450	康得新	7,032	215,179.20	1.12
23	300027	华谊兄弟	5,593	213,317.02	1.11
24	002594	比亚迪	3,834	211,751.82	1.10
25	000778	新兴铸管	20,095	204,165.20	1.06
26	002465	海格通信	6,316	203,312.04	1.06
27	000538	云南白药	2,330	201,009.10	1.05
28	300104	乐视网	3,819	197,671.44	1.03
29	002202	金风科技	9,487	184,711.89	0.96
30	000793	华闻传媒	8,896	184,592.00	0.96
31	000157	中联重科	22,340	181,177.40	0.94
32	000917	电广传媒	5,793	178,482.33	0.93
33	002405	四维图新	4,056	177,652.80	0.93
34	000728	国元证券	4,670	177,366.60	0.92
35	000629	攀钢钒钛	33,046	177,126.56	0.92
36	000338	潍柴动力	5,567	176,251.22	0.92
37	300070	碧水源	3,559	173,643.61	0.90
38	000423	东阿阿胶	2,948	160,666.00	0.84
39	002081	金 螳 螂	5,688	160,344.72	0.83
40	002304	洋河股份	2,216	153,701.76	0.80
41	000039	中集集团	4,664	150,647.20	0.78
42	002230	科大讯飞	4,233	147,901.02	0.77
43	002106	莱宝高科	7,738	146,480.34	0.76
44	000060	中金岭南	7,782	144,667.38	0.75
45	002073	软控股份	6,060	139,986.00	0.73
46	000800	一汽轿车	5,585	138,954.80	0.72
47	000568	泸州老窖	4,205	137,125.05	0.71
48	300017	网宿科技	2,922	135,639.24	0.71

49	000839	中信国安	5,697	134,278.29	0.70
50	000559	万向钱潮	5,983	130,788.38	0.68
51	002008	大族激光	4,514	129,642.08	0.68
52	000623	吉林敖东	3,858	129,628.80	0.68
53	002500	山西证券	7,148	129,307.32	0.67
54	000061	农产品	6,322	128,968.80	0.67
55	000012	南玻A	9,646	128,677.64	0.67
56	000402	金融街	8,804	124,400.52	0.65
57	000963	华东医药	1,669	119,300.12	0.62
58	000960	锡业股份	5,718	115,217.70	0.60
59	002456	欧菲光	3,395	114,547.30	0.60
60	000825	太钢不锈	15,745	111,946.95	0.58
61	000009	中国宝安	6,812	111,103.72	0.58
62	000425	徐工机械	8,368	111,043.36	0.58
63	300124	汇川技术	2,288	109,824.00	0.57
64	000970	中科三环	5,308	109,397.88	0.57
65	002344	海宁皮城	5,467	107,317.21	0.56
66	002142	宁波银行	4,996	105,665.40	0.55
67	002475	立讯精密	3,119	105,453.39	0.55
68	000826	桑德环境	2,708	105,314.12	0.55
69	002570	贝因美	5,215	101,223.15	0.53
70	000792	盐湖股份	3,530	100,181.40	0.52
71	300058	蓝色光标	6,097	96,393.57	0.50
72	000878	云南铜业	3,905	95,672.50	0.50
73	000983	西山煤电	9,910	93,946.80	0.49
74	002385	大北农	6,930	93,693.60	0.49
75	000581	威孚高科	2,929	90,769.71	0.47
76	000831	五矿稀土	3,540	90,553.20	0.47
77	002292	奥飞动漫	2,358	87,929.82	0.46
78	000046	泛海控股	5,981	87,621.65	0.46
79	002030	达安基因	1,924	85,233.20	0.44
80	000598	兴蓉环境	8,874	84,924.18	0.44
81	000876	新希望	4,309	83,637.69	0.44
82	000750	国海证券	4,973	83,546.40	0.44
83	000977	浪潮信息	2,818	83,271.90	0.43
84	000400	许继电气	3,275	82,399.00	0.43
85	300002	神州泰岳	5,393	82,189.32	0.43
86	000686	东北证券	4,202	81,812.94	0.43
87	002038	双鹭药业	1,433	81,179.45	0.42

88	002236	大华股份	2,516	80,310.72	0.42
89	002146	荣盛发展	6,220	77,750.00	0.40
90	002007	华兰生物	1,724	76,355.96	0.40
91	000895	双汇发展	3,276	69,877.08	0.36
92	002422	科伦药业	1,729	69,229.16	0.36
93	300315	掌趣科技	4,675	63,346.25	0.33
94	000729	燕京啤酒	6,073	63,159.20	0.33
95	000937	冀中能源	6,877	55,153.54	0.29
96	000999	华润三九	1,638	49,778.82	0.26
97	002353	杰瑞股份	1,120	49,672.00	0.26
98	002001	新 和 成	2,780	47,510.20	0.25
99	002069	獐 子 岛	1,700	33,592.00	0.17

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	601888	中国国旅	1,703	112,908.90	0.59
2	601006	大秦铁路	4,543	63,783.72	0.33
3	002153	石基信息	443	57,585.57	0.30
4	300005	探路者	2,005	54,937.00	0.29
5	600436	片仔癀	728	48,535.76	0.25
6	600066	宇通客车	2,322	47,717.10	0.25
7	603288	海天味业	1,429	45,642.26	0.24
8	300015	爱尔眼科	1,341	43,260.66	0.23
9	601901	方正证券	3,561	42,340.29	0.22
10	300146	汤臣倍健	1,054	41,401.12	0.22
11	601009	南京银行	1,734	39,535.20	0.21
12	601168	西部矿业	3,489	38,099.88	0.20
13	601179	中国西电	3,587	36,766.75	0.19
14	600085	同仁堂	1,000	35,910.00	0.19
15	600535	天士力	720	35,827.20	0.19
16	002400	省广股份	1,350	34,101.00	0.18
17	600340	华夏幸福	1,100	33,495.00	0.17
18	601169	北京银行	2,405	32,034.60	0.17
19	600309	万华化学	1,251	30,249.18	0.16
20	000156	华数传媒	817	29,232.26	0.15
21	600369	西南证券	1,482	29,121.30	0.15

22	002470	金正大	1,198	26,008.58	0.14
23	600648	外高桥	703	24,661.24	0.13
24	600674	川投能源	1,828	22,868.28	0.12
25	600373	中文传媒	900	21,564.00	0.11
26	600332	白云山	579	19,952.34	0.10
27	600316	洪都航空	431	14,903.98	0.08

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	000166	申万宏源	1,544,448.84	2.13
2	000100	TCL 集团	1,260,829.00	1.74
3	000002	万科 A	1,104,302.12	1.53
4	000651	格力电器	993,714.48	1.37
5	000333	美的集团	980,602.35	1.36
6	000709	河北钢铁	791,323.00	1.09
7	000001	平安银行	755,753.00	1.04
8	300024	机器人	656,502.00	0.91
9	002500	山西证券	619,063.20	0.86
10	002241	歌尔声学	581,934.00	0.80
11	000625	长安汽车	547,908.00	0.76
12	000963	华东医药	547,292.38	0.76
13	000581	威孚高科	530,257.00	0.73
14	002465	海格通信	500,738.50	0.69
15	002073	软控股份	491,791.00	0.68
16	000776	广发证券	475,789.00	0.66
17	000063	中兴通讯	471,968.00	0.65
18	000725	京东方 A	458,692.00	0.63
19	600648	外高桥	448,481.00	0.62
20	000425	徐工机械	433,929.00	0.60

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	000002	万 科 A	4,535,102.21	6.27
2	000651	格力电器	4,364,069.39	6.03
3	000333	美的集团	3,279,742.42	4.53
4	000001	平安银行	3,152,130.37	4.36
5	000776	广发证券	3,053,409.37	4.22
6	000100	TCL 集团	2,186,244.37	3.02
7	000063	中兴通讯	2,114,289.66	2.92
8	002024	苏宁云商	1,783,005.15	2.46
9	000783	长江证券	1,734,971.09	2.40
10	000625	长安汽车	1,661,870.59	2.30
11	000166	申万宏源	1,506,615.18	2.08
12	002415	海康威视	1,500,339.68	2.07
13	000725	京东方 A	1,363,303.40	1.88
14	002202	金风科技	1,352,967.28	1.87
15	000858	五 粮 液	1,284,611.58	1.78
16	000338	潍柴动力	1,250,489.57	1.73
17	300024	机器人	1,242,520.24	1.72
18	002241	歌尔声学	1,198,414.81	1.66
19	000157	中联重科	1,179,979.69	1.63
20	000800	一汽轿车	1,127,876.78	1.56

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	42,222,699.94
卖出股票收入（成交）总额	109,338,445.10

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序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序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 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序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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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	26,539.88
2	应收证券清算款	166,616.02
3	应收股利	-
4	应收利息	297.00
5	应收申购款	51,309.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,762.23

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000709	河北钢铁	439,558.00	2.29	临时停牌
2	000630	铜陵有色	384,213.60	2.00	重大事项停牌
3	000024	招商地产	614,039.50	3.20	重大事项停牌

7.12.5.2 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。

7.12.6 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
314	39,899.58	6,333,423.61	50.55%	6,195,045.61	49.45%

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	毛维贤	32,108.00	14.61%
2	刘玉坤	30,003.00	13.66%
3	刘梅	30,001.00	13.66%
4	张向阳	16,531.00	7.52%
5	曾亨曦	11,686.00	5.32%
6	许子光	11,000.00	5.01%
7	黄工贝	10,000.00	4.55%
8	谷怀玉	10,000.00	4.55%
9	张茂明	8,800.00	4.01%
10	陈增伟	7,100.00	3.23%

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

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。

8.4 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

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 3 月 9 日）基金份额总额	385,199,023.48
本报告期期初基金份额总额	64,287,371.15
本报告期基金总申购份额	30,295,192.01
减:本报告期基金总赎回份额	82,054,093.94
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	12,528,469.22

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

2015 年 6 月 23 日东吴基金管理有限公司召开 2015 年第一次临时股东会，会议经过审议，全体股东一致通过如下决议：

（1）同意金燕萍女士辞去第二届董事会董事、副董事长职务；同意戴继雄先生辞去公司第二届董事会董事职务；

（2）同意张平先生辞去公司第二届董事会独立董事、第二届董事会风险控股委员会委员职务；

（3）选举陈辉峰先生、全卓伟女士担任公司第二届董事会董事，任期与公司第二届董事会一致；

（4）选举袁勇志先生担任第二届董事会独立董事，任期与公司第二届董事会一致。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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天衡会计师事务所（特殊普通合伙）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

（1）管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，中国证监会以及上海证监局对公司原基金经理魏立波涉嫌违规从事股票交易进行了调查，上海证监局于 2015 年 1 月 23 日对公司作出了采取责令整改措施的决定。公司对此高度重视，及时制定整改计划和整改方案，认真进行改进，逐一落实各项整改要求。

(2) 本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	123,750,444.33	82.72%	110,036.19	82.78%	-
中银国际	1	25,859,397.03	17.28%	22,883.13	17.22%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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

本基金本报告期交易单元退租 2 个交易单元为第一创业证券和红塔证券。

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	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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管理的基金 2014 年年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2015 年 1 月 5 日
2	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 6 日
3	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开通定期定额投资业务并参加工商银行“2015 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 15 日
4	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）2014 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 1 月 21 日
5	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并推出转换业务的公告	中证证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 5 日
6	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增江苏银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 19 日
7	东吴基金管理有限公司关于变更江苏银行股份有限公司上线代销旗下基金并推出定期定额业务及转换业务时间的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 21 日
8	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	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 3 月 25 日
9	东吴基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法变更的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 3 月 25 日
10	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）2014 年年度报告以及摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站	2015 年 3 月 28 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	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 3 月 30 日

12	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2015 年第 1 季度报告	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 4 月 20 日
13	东吴深证 100 指数增强型证券投资基金更新招募说明书以及摘要	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 4 月 22 日
14	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	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 5 月 6 日
15	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	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 5 月 29 日
16	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 5 月 29 日
17	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	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 6 月 3 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	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 6 月 4 日
19	东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加柜台、网上交易申购费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 公司网站	2015 年 6 月 8 日
20	东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 12 日
21	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在上海好买基金销售有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 12 日
22	关于东吴基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 26 日
23	东吴基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 26 日

24	东吴基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 26 日
25	东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 29 日
26	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	中国证券报 上海证券报 证券时报 证券日报 公司网站	2015 年 6 月 30 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深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）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、报告期内东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）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
2015 年 8 月 27 日