

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

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 2015 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

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(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

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

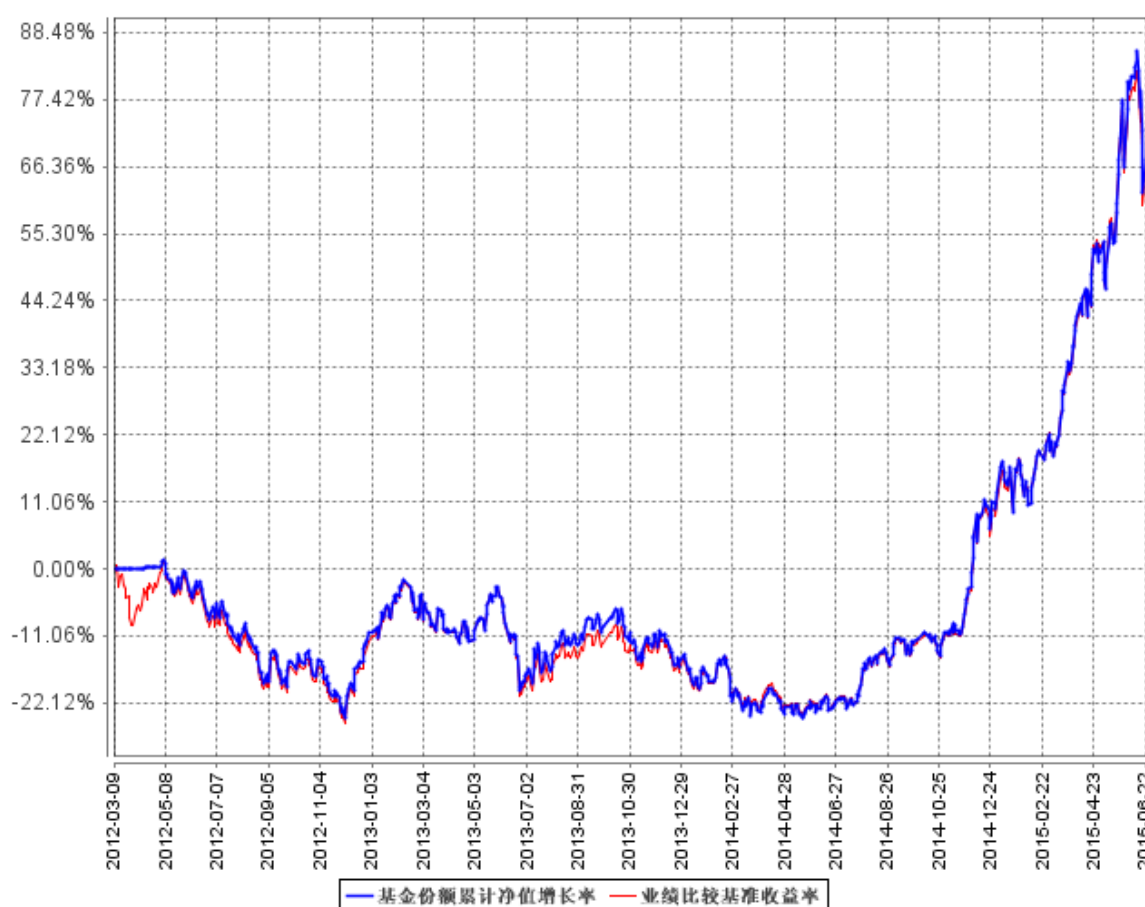
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-8. 42%	3. 58%	-7. 67%	3. 32%	-0. 75%	0. 26%

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、东吴创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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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合规守信、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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	166,616.02	131,601.69
应收利息	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	-	-
资产总计	19,661,422.98	73,325,111.74
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 6 月 30 日	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	-	-
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	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	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	12,528,469.22	64,287,371.15
未分配利润	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	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	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	26,771,121.40	-3,623,389.72
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	137,707.27	583,638.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	86,159.41	14,353.40
减：二、费用	804,044.16	750,923.11
1. 管理人报酬	225,125.80	247,625.31
2. 托管费	33,768.93	37,143.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	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(基金净值)	58,484,199.73	-8,279,135.33	50,205,064.40
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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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 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 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。

6.4.8.1.2 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 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。

6.4.8.2 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 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 × 1% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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 × 0.15% / 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内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.8.4.2 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 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
------------------	-----------------	-------------	-----------------	-------------

6.4.8.6 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 利润分配情况

6.4.9.1 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。

6.4.10 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 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	-
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	重大事项	30.81	-	-	5,793	111,230.98	178,482.33	-

		28 日	停牌							
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	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 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。

6.4.11 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	57,585.57	0.30

	服务业		
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前十名股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

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

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

注：投资者欲了解本报告期末基金积极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	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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	曾亭曦	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	-	-	-	-	-	-

§ 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
2015 年 8 月 27 日