

# 东吴新创业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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	东吴创新创业股票
基金主代码	580007
交易代码	580007
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	2010 年 6 月 29 日
基金管理人	东吴基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,030,640.97 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,主要投资于市场中的创业型股票,包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。通过精选具有合理价值的高成长创业型股票,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,动态调整股票、债券、现金等大类资产的配置。运用本公司自行开发的东吴 GARP 策略选股模型,精选具有成长优势与估值优势的创业型上市公司股票。
业绩比较基准	中信标普 200 指数*50%+中信标普小盘指数*50%)*75%+中信标普全债指数*25%
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。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。

### 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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	吕晖	蒋松云
	联系电话	021-50509888-8206	010-66105799
	电子邮箱	lvhui@scfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-50509666/400-821-0588	95588
传真		021-50509888-8211	010-66105798

## 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	-855,291.67
本期利润	6,812,284.10
加权平均基金份额本期利润	0.0577
本期基金份额净值增长率	5.70%
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	-0.0911
期末基金资产净值	96,371,424.83
期末基金份额净值	0.909

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

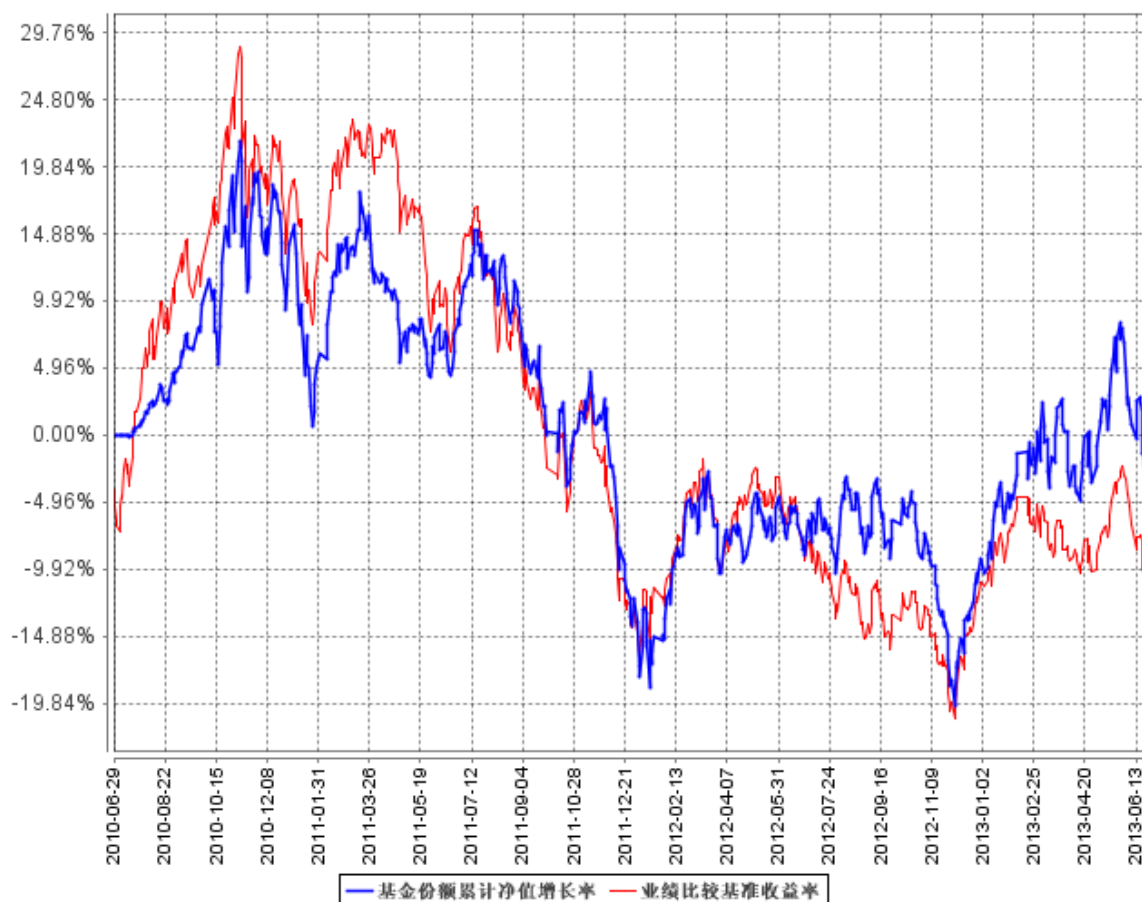
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-10.18%	1.97%	-12.12%	1.38%	1.94%	0.59%
过去三个月	-4.32%	1.61%	-6.68%	1.08%	2.36%	0.53%
过去六个月	5.70%	1.45%	-4.20%	1.06%	9.90%	0.39%
过去一年	3.77%	1.26%	-6.81%	1.05%	10.58%	0.21%
过去三年	-4.02%	1.21%	-9.82%	1.13%	5.80%	0.08%
自基金合同生效起至今	-4.02%	1.21%	-14.18%	1.14%	10.16%	0.07%

注：本基金业绩比较基准=( 中信标普 200 指数\*50%+中信标普小盘指数\*50% ) \*75%+中信标普全债指数\*25%

### 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. 东吴新创业基金于 2010 年 6 月 29 日成立。

2. 比较基准=75%\*( 中信标普 200 指数 × 50%+中信标普小盘指数 × 50% ) +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，创造性地树立公司独特的文化体系，在众多基金管理公司中树立自己鲜明的企业形象。

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下共管理基金 15 只，其中股票型基金 5 只，分别为东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、东吴新经济股票型证券投资基金、东吴创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		
周 健	本基金基金经理	2012 年 10 月 27 日	-	6.5 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、东吴创新创业股票基金基金经理、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

今年上半年，A 股市场结构明显分化，表现在成长股持续大幅跑赢周期股，中小市值股票也维持绝对强势，估值大幅扩张，相对于大盘股的估值溢价刷新历史纪录，即便是在六月份由流动性危机触发的股市大跌中，创业板指数相对其他指数仍有明显的超额收益。

市场没有理会投资者对成长股和中小市值股票高估值的担忧，本基金也顺势而为，上半年股票仓位总体维持在中高水平，并持续超配了消费电子和医药等行业，也适度参与了节能环保等相关主题投资，取得了相对较好的收益。

需要检讨的是，几个重仓股一季报业绩低于预期，导致本基金净值在第二季度遭受不小的损失。今后本基金将进一步加强重仓持有股票的持续跟踪，规避业绩低于预期带来的风险，为投资者创造超额回报。

#### 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 0.909 元，累计净值 0.969 元；本报告期份额净值增长率 5.70%，同期业绩比较基准收益率为-4.20%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金预计股市呈现宽幅波动的概率较大，因为总体趋紧的流动性将对股市形成压制，来自经济基本面的支撑力度也偏弱，政府实施财政刺激和放松货币政策的概率目前看也不会太高，具体分析如下：

流动性将总体趋紧已经成为市场的一致预期，尤其是 6 月份银行间流动性压力测试已经让金融机构和投资者认识到新的高层领导的态度变化，市场对未来金融机构流动性的创造的预期值已



经降低到最低位。从外部因素来看，美国量化宽松政策退出的路径虽不清晰但市场预期却在不断强化，下半年美元继续走强和全球资金流动方向逆转发生的概率在增大，国内流动性宽松的外部环境也将面临挑战。同时，在资金需求方面，IPO 开闸和银行再融资等对资金的抽离作用也不容小视。

从经济基本面来看，所谓 7 上 8 下的 GDP 增速应该是未来几个季度的常态，盘活存量使空转货币流向实体经济是一个渐进的过程，我们对货币对经济的促进作用不能抱有太高的期望。相反，“钱荒”已经促使投资者开始产生实体经济也终将受到负面冲击的预期。就目前情势看，经济失速下行的风险还不大，不至于触及高层对 GDP 增速回落至 7% 的容忍底线，所以我们也很难指望政府会出台措施对冲经济增速下行。也就是说，至少在第三季度我们将很难看到过去熟悉的所谓“经济退、政策进”的场景，尤其最近高层领导的讲话应该是强化了这种预期。

本基金关注的上行风险因素包括：政府出台直接针对股市的利好政策、QFII 和 RQFII 新增资金重新大规模入市、政府在宏观政策上摇摆不定等。

#### 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

根据基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%。

本基金本报告期末未分配利润。

## § 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

2013 年上半年，本基金托管人在对东吴新创业股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2013 年上半年，东吴新创业股票型证券投资基金的管理人——东吴基金管理有限公司在东吴新创业股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东吴新创业股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对东吴基金管理有限公司编制和披露的东吴新创业股票型证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：东吴新创业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	20,777,168.64	21,879,288.05
结算备付金	507,506.57	114,621.52
存出保证金	81,304.90	1,000,000.00

交易性金融资产	80,000,651.62	81,338,612.71
其中：股票投资	80,000,651.62	81,338,612.71
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	640,995.12	6,230,203.08
应收利息	2,771.19	6,005.37
应收股利	-	-
应收申购款	160,981.10	7,700.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	102,171,379.14	110,576,430.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2013 年 6 月 30 日</b>	<b>2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	4,990,086.21	-
应付赎回款	139,333.97	265,264.85
应付管理人报酬	125,661.25	177,980.26
应付托管费	20,943.55	29,663.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	335,036.39	62,484.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,892.94	380,505.20
负债合计	5,799,954.31	915,898.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	106,030,640.97	127,583,083.71
未分配利润	-9,659,216.14	-17,922,550.77
所有者权益合计	96,371,424.83	109,660,532.94
负债和所有者权益总计	102,171,379.14	110,576,430.94

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.909 元，基金份额总额 106,030,640.97 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东吴新创业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
<b>一、收入</b>	8,692,340.94	10,208,049.64
1.利息收入	67,008.73	121,427.06
其中：存款利息收入	67,008.73	121,427.06
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）	945,269.71	-1,261,628.46
其中：股票投资收益	511,708.13	-2,221,372.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	433,561.58	959,743.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,667,575.77	11,331,778.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	12,486.73	16,472.45
<b>减：二、费用</b>	1,880,056.84	1,709,642.60
1.管理人报酬	820,225.56	1,234,973.60
2.托管费	136,704.30	205,828.95
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	724,877.69	65,096.13
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	198,249.29	203,743.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	6,812,284.10	8,498,407.04
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	6,812,284.10	8,498,407.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东吴新创业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)	127,583,083.71	-17,922,550.77	109,660,532.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,812,284.10	6,812,284.10
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)	-21,552,442.74	1,451,050.53	-20,101,392.21
其中：1.基金申购款	10,571,667.41	-467,879.14	10,103,788.27
2.基金赎回款	-32,124,110.15	1,918,929.67	-30,205,180.48
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)	106,030,640.97	-9,659,216.14	96,371,424.83
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)	195,231,918.20	-32,623,083.84	162,608,834.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,498,407.04	8,498,407.04
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)	-9,420,098.61	1,065,361.04	-8,354,737.57
其中：1.基金申购款	8,115,831.28	-1,060,487.60	7,055,343.68
2.基金赎回款	-17,535,929.89	2,125,848.64	-15,410,081.25
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)	185,811,819.59	-23,059,315.76	162,752,503.83

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：

<u>任少华</u>	<u>吕晖</u>	<u>袁渊</u>
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

东吴创新创业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[2010]568号《关于同意东吴创新创业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2010年6月29日正式生效，首次设立募集规模为434,036,741.03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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 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》、《东吴创新创业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
中国工商银行股份有限公司	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	66,416,818.78	13.97%	9,728,591.62	24.95%

## 债券交易

无。



## 债券回购交易

无。

### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

### 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	60,311.18	14.10%	55,812.23	16.66%
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	7,904.61	24.43%	-	-

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 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	820,225.56
其中：支付销售机构的客 户维护费	270,240.45	289,929.56

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	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	136,704.30	205,828.95

注：支付基金托管人中国工商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	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
基金合同生效日（2010年6月29日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,550,036.70	10,550,036.70
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	10,550,036.70	-
期末持有的基金份额	-	10,550,036.70
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.68%

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它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
中国工商银行股份有限公司	20,777,168.64	63,453.85	36,509,566.69	121,193.85

**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**

本基金本报告期末无认购新发/增发证券。

**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
000999	华润三九	2013 年 6 月 3 日	重大资产重组	26.55	2013 年 8 月 19 日	26.51	50,000	1,441,559.61	1,327,500.00	-

**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	80,000,651.62	78.30
	其中：股票	80,000,651.62	78.30
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	21,284,675.21	20.83
6	其他各项资产	886,052.31	0.87
7	合计	102,171,379.14	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	57,852,985.43	60.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,758,574.60	5.98
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	3,640,000.00	3.78
J	金融业	469,000.00	0.49
K	房地产业	1,952,400.00	2.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,909,878.00	4.06
N	水利、环境和公共设施管理业	4,085,373.59	4.24

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	2,332,440.00	2.42
S	综合	-	-
	合计	80,000,651.62	83.01

### 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	002138	顺络电子	295,800	5,324,400.00	5.52
2	002140	东华科技	160,000	3,969,600.00	4.12
3	600867	通化东宝	252,000	3,752,280.00	3.89
4	600637	百视通	130,000	3,640,000.00	3.78
5	601965	中国汽研	380,000	3,515,000.00	3.65
6	300054	鼎龙股份	200,000	3,438,000.00	3.57
7	002450	康得新	110,000	3,077,800.00	3.19
8	600887	伊利股份	95,000	2,971,600.00	3.08
9	002022	科华生物	200,000	2,962,000.00	3.07
10	002415	海康威视	79,989	2,826,811.26	2.93

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](http://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	600143	金发科技	6,255,000.00	5.70
2	600887	伊利股份	6,155,567.91	5.61
3	600316	洪都航空	6,069,118.40	5.53
4	600498	烽火通信	5,523,670.91	5.04
5	002255	海陆重工	5,461,780.26	4.98
6	300284	苏交科	5,388,380.00	4.91

7	002138	顺络电子	4,922,886.88	4.49
8	300347	泰格医药	4,602,087.60	4.20
9	002415	海康威视	4,473,737.09	4.08
10	600388	龙净环保	4,435,052.98	4.04
11	002376	新北洋	4,292,451.69	3.91
12	300115	长盈精密	4,133,623.60	3.77
13	600418	江淮汽车	4,037,043.34	3.68
14	002344	海宁皮城	3,967,868.82	3.62
15	000887	中鼎股份	3,845,915.60	3.51
16	601965	中国汽研	3,700,625.60	3.37
17	002250	联化科技	3,575,873.23	3.26
18	000826	桑德环境	3,391,075.96	3.09
19	000800	一汽轿车	3,370,142.76	3.07
20	002022	科华生物	3,285,669.58	3.00
21	600048	保利地产	3,271,912.90	2.98
22	601098	中南传媒	3,269,544.00	2.98
23	002258	利尔化学	3,205,877.51	2.92
24	601628	中国人寿	3,192,232.47	2.91
25	000423	东阿阿胶	3,168,860.32	2.89
26	002656	卡奴迪路	3,114,693.00	2.84
27	600637	百视通	3,103,490.99	2.83
28	002007	华兰生物	3,093,244.70	2.82
29	601117	中国化学	3,079,635.00	2.81
30	000731	四川美丰	3,062,159.40	2.79
31	000012	南玻A	3,032,223.00	2.77
32	600867	通化东宝	3,024,200.00	2.76
33	600352	浙江龙盛	2,986,100.78	2.72
34	002223	鱼跃医疗	2,984,404.41	2.72
35	002450	康得新	2,981,668.00	2.72
36	300101	国腾电子	2,844,718.20	2.59
37	000625	长安汽车	2,765,870.62	2.52
38	002236	大华股份	2,633,474.00	2.40
39	300244	迪安诊断	2,536,799.00	2.31
40	600030	中信证券	2,527,019.11	2.30
41	000596	古井贡酒	2,514,800.00	2.29
42	600305	恒顺醋业	2,502,977.50	2.28

43	600223	鲁商置业	2,437,918.53	2.22
44	600703	三安光电	2,362,000.00	2.15
45	002273	水晶光电	2,361,751.14	2.15
46	000525	红太阳	2,286,454.22	2.09

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	600143	金发科技	12,027,962.80	10.97
2	600486	扬农化工	7,619,375.44	6.95
3	002255	海陆重工	6,917,431.32	6.31
4	600316	洪都航空	6,163,299.78	5.62
5	002140	东华科技	6,134,452.98	5.59
6	002376	新北洋	5,284,525.50	4.82
7	002570	贝因美	5,104,616.47	4.65
8	600388	龙净环保	5,098,258.00	4.65
9	600588	用友软件	4,988,427.94	4.55
10	002004	华邦颖泰	4,750,158.08	4.33
11	002344	海宁皮城	4,188,034.30	3.82
12	002603	以岭药业	4,171,663.00	3.80
13	600418	江淮汽车	3,988,489.90	3.64
14	002250	联化科技	3,829,601.00	3.49
15	002236	大华股份	3,605,935.14	3.29
16	600111	包钢稀土	3,569,956.06	3.26
17	002258	利尔化学	3,540,375.08	3.23
18	600498	烽火通信	3,468,207.59	3.16
19	600887	伊利股份	3,468,100.00	3.16
20	600559	老白干酒	3,459,518.00	3.15
21	300284	苏交科	3,414,850.78	3.11
22	300115	长盈精密	3,376,541.00	3.08
23	601117	中国化学	3,301,135.04	3.01
24	000800	一汽轿车	3,265,438.00	2.98
25	000731	四川美丰	3,225,722.00	2.94
26	300251	光线传媒	3,181,405.00	2.90
27	002007	华兰生物	3,135,021.35	2.86

28	600048	保利地产	3,106,501.20	2.83
29	002223	鱼跃医疗	3,103,575.40	2.83
30	000423	东阿阿胶	3,056,400.00	2.79
31	601628	中国人寿	3,008,979.71	2.74
32	300244	迪安诊断	2,998,929.93	2.73
33	002152	广电运通	2,809,805.36	2.56
34	000780	平庄能源	2,793,352.74	2.55
35	002273	水晶光电	2,779,557.37	2.53
36	300101	国腾电子	2,768,716.00	2.52
37	000651	格力电器	2,725,400.00	2.49
38	300347	泰格医药	2,640,754.87	2.41
39	002656	卡奴迪路	2,636,619.51	2.40
40	000596	古井贡酒	2,562,527.00	2.34
41	600267	海正药业	2,552,030.20	2.33
42	600030	中信证券	2,545,000.00	2.32
43	000525	红太阳	2,515,259.77	2.29
44	600223	鲁商置业	2,476,120.00	2.26
45	000625	长安汽车	2,428,177.91	2.21
46	002299	圣农发展	2,376,312.43	2.17
47	002155	辰州矿业	2,371,675.92	2.16
48	600315	上海家化	2,257,673.19	2.06
49	300054	鼎龙股份	2,228,226.00	2.03
50	300122	智飞生物	2,197,035.20	2.00

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	232,870,430.35
卖出股票收入（成交）总额	242,387,675.34

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**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**

本基金本报告期末持有股指期货。

**7.10 投资组合报告附注****7.10.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.10.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.10.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	81,304.90
2	应收证券清算款	640,995.12
3	应收股利	-
4	应收利息	2,771.19
5	应收申购款	160,981.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	886,052.31

**7.10.4 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。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,097	14,940.21	21,510,341.52	20.29%	84,520,299.45	79.71%

### 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（2010年6月29日）基金份额总额	434,036,741.03
本报告期期初基金份额总额	127,583,083.71
本报告期基金总申购份额	10,571,667.41
减：本报告期基金总赎回份额	32,124,110.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	106,030,640.97

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决议。

### 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	
长江证券	1	85,618,812.84	18.02%	76,418.54	17.86%	-
海通证券	2	73,514,859.17	15.47%	65,817.96	15.38%	-
东吴证券	2	66,416,818.78	13.97%	60,311.18	14.10%	-
国信证券	1	65,978,572.34	13.88%	60,066.57	14.04%	-
中信建投	1	63,519,475.32	13.37%	56,980.80	13.32%	-
申银万国	1	40,521,883.88	8.53%	36,891.19	8.62%	-
国泰君安	1	27,965,088.18	5.88%	25,459.71	5.95%	-
兴业证券	1	21,261,602.76	4.47%	18,814.43	4.40%	-
中投证券	1	16,690,622.09	3.51%	14,769.58	3.45%	-
中信证券	1	8,247,851.72	1.74%	7,298.59	1.71%	-
银河证券	1	5,522,518.61	1.16%	5,027.72	1.18%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

注：租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序

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

本报告期本基金退租 2 个交易单元，分别为安信证券，中信证券。

### 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

## § 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